

【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】	2020年8月14日提出
【計算期間】	第1期(自 2019年6月10日至 2020年5月15日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド2019-06
【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 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< 商品分類の定義 >

1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

- (1) 株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げ

る資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。

(5)資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 独立した区分

(1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。

(2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。

(3)ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

< 補足として使用する商品分類 >

(1)インデックス型：目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。

中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。

年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。

年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。

年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。

年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

◆「保証契約」の表記について

本書において、信託期間中の基準価額が、あらかじめ定められた価格（以下、本書において「確保ライン」といいます。）を下回った場合に、株式会社りそな銀行が「確保ライン」を下回る差額を信託財産に支払うことを約束する契約について「保証契約」ということがあります。

本契約は民法上の保証契約を意味するものではなく、保証類似行為として行われるものです。

また本契約は、株式会社りそな銀行がファンドの元本を保証するものではありません。

◆「保証会社」の表記について

本書において、「保証契約」にもとづき支払うことを約束する株式会社りそな銀行については、販売会社および受託会社としてのりそな銀行と混同を避けるため「保証会社」と表記することがあります。

投資対象

- 主として複数の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）などへの分散投資を行います。
- RAMマネーマザーファンドを除く各マザーファンドは、各投資対象資産における代表的なインデック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。

※投資するマザーファンドについては後述の「ファンドの仕組み」を、各インデックスについては後述の「インデックスの著作権等について」をご参照ください。

ファンドの特色

- 1** 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、信託財産の収益確保を目指します。
- 2** ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した「確保ライン」を上回る水準で運用を継続することを目指します。
- 3** 以下の条件に該当した場合、ファンドは繰上償還*します。このとき、ファンド設定時に締結するりそな銀行との保証契約の履行により「確保ライン」を下回ることなく繰上償還します。

- 基準価額が「確保ライン」まで下落した場合。
- 基準価額と「確保ライン」との差が20営業日連続して50円未満となった場合。

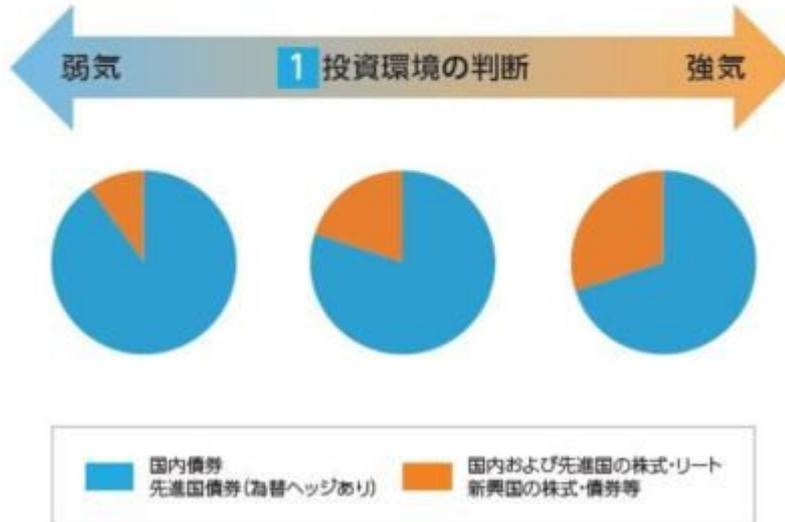
*基準価額が「確保ライン」を上回っている場合でも、上記の条件以外の理由によって委託会社が繰上償還を決定することがあります。

1 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、 信託財産の収益確保を目指します。

Point

主として国内債券および先進国債券（為替ヘッジあり）に投資を行い、安定した収益の確保を目指しつつ、定量的手法による投資環境の判定基準にしたがって、国内および先進国の株式・不動産投資信託証券（リート）ならびに新興国の株式・債券等へも機動的に投資することにより、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。

投資環境の判断と投資割合のイメージ

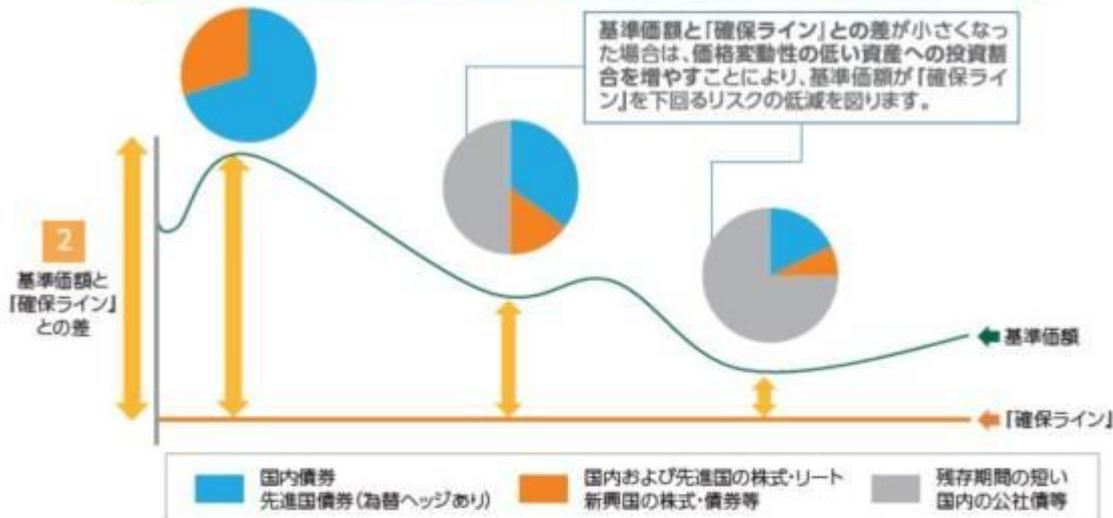


2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した『確保ライン』を上回る水準で運用を継続することを目指します。

Point

投資環境の悪化等により基準価額が『確保ライン』に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。

『基準価額と『確保ライン』との差』と投資割合のイメージ

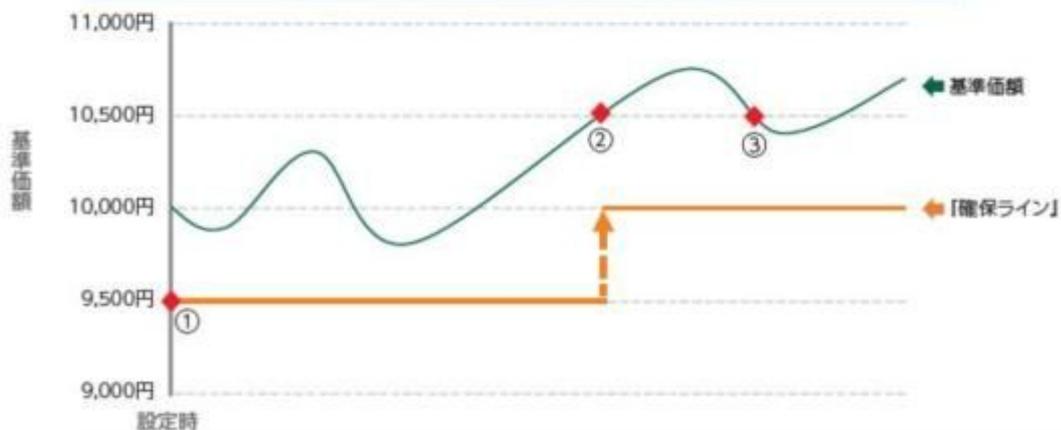


『確保ライン』は設定後に見直される場合があります。

Point

- ① 設定時の『確保ライン』は、9,500円とします。『確保ライン』の引き下げはありません。
- ② 信託期間中、基準価額が10,500円以上となった場合はその翌営業日より『確保ライン』を10,000円に引き上げます。以降の見直しはありません。
- ③ 『確保ライン』を10,000円に引き上げた後に基準価額が10,500円を下回った場合でも、『確保ライン』は10,000円に据え置きます(引き下げません)。

『確保ライン』の引き上げイメージ



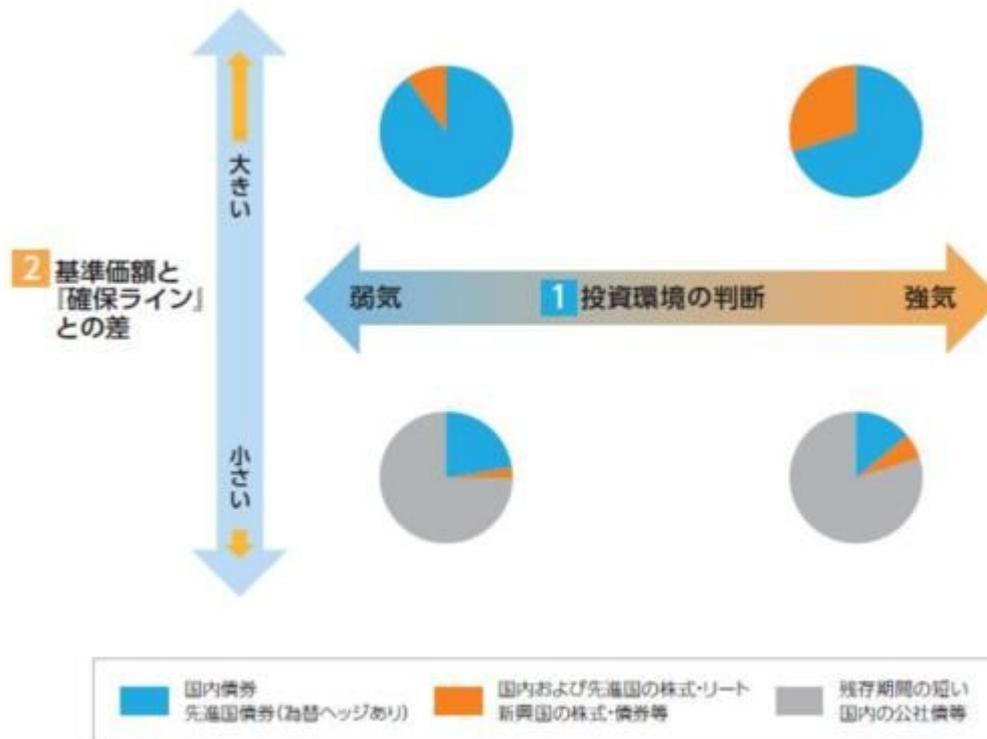
⚠️ ご注意ください

ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。

投資対象資産への投資割合のイメージ

1 投資環境の判断 と 2 基準価額と「確保ライン」との差

2つの要因を組み合わせると、ポートフォリオの変更イメージは、以下のようになります。

⚠️ **ご注意ください**

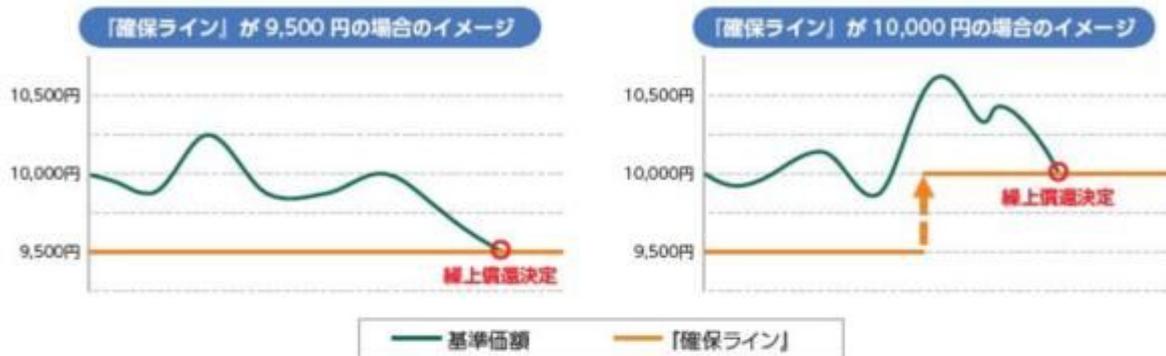
上記の図は、ファンドにおける投資割合の変化について説明することを目的に単純化したものであり、実際の運用において上記の投資割合で運用することを示唆・保証するものではありません。

3

以下の条件に該当した場合、ファンドは繰上償還します。
このとき、ファンド設定時に締結するりそな銀行との保証契約の
履行により『確保ライン』を下回ることなく繰上償還します。

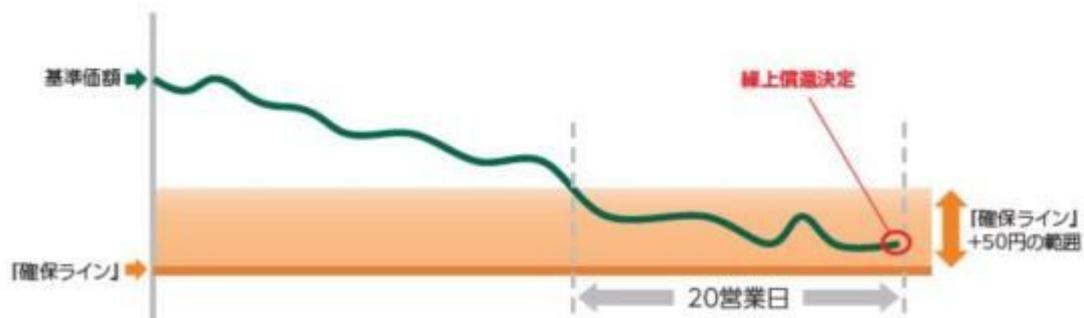
条件① 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



条件② 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合

基準価額と『確保ライン』との差が小さくなった場合、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを抑制するために、相対的に価格変動リスクの小さい残存期間の短い国内の公社債等への投資割合を高めます。この場合、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクは低下しますが、同時に、値上がりする可能性も低下します。したがって、基準価額が『確保ライン』+50円未満となる期間が20営業日連続する場合は、以降もこのような状況が継続する可能性が高いと考えられるため、ファンドを繰上償還します。

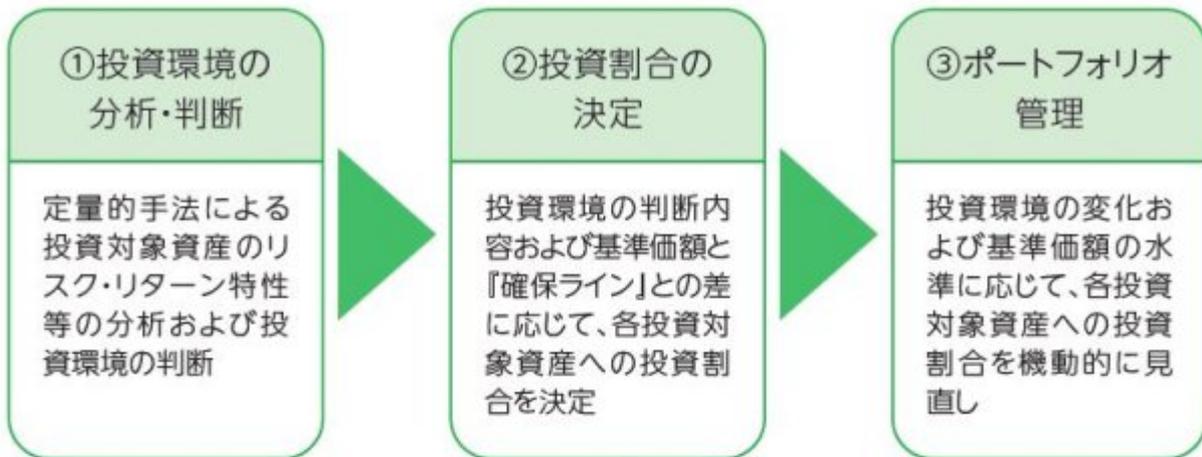


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

※保証契約には保証料がかかり、投資者に信託財産で間接的にご負担いただきます。詳しくは後述の「手続・手数料等 ファンドの費用・税金」をご確認ください。

※繰上償還について、詳しくは後述の「投資リスク その他の留意点」をご確認ください。

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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。

分配方針

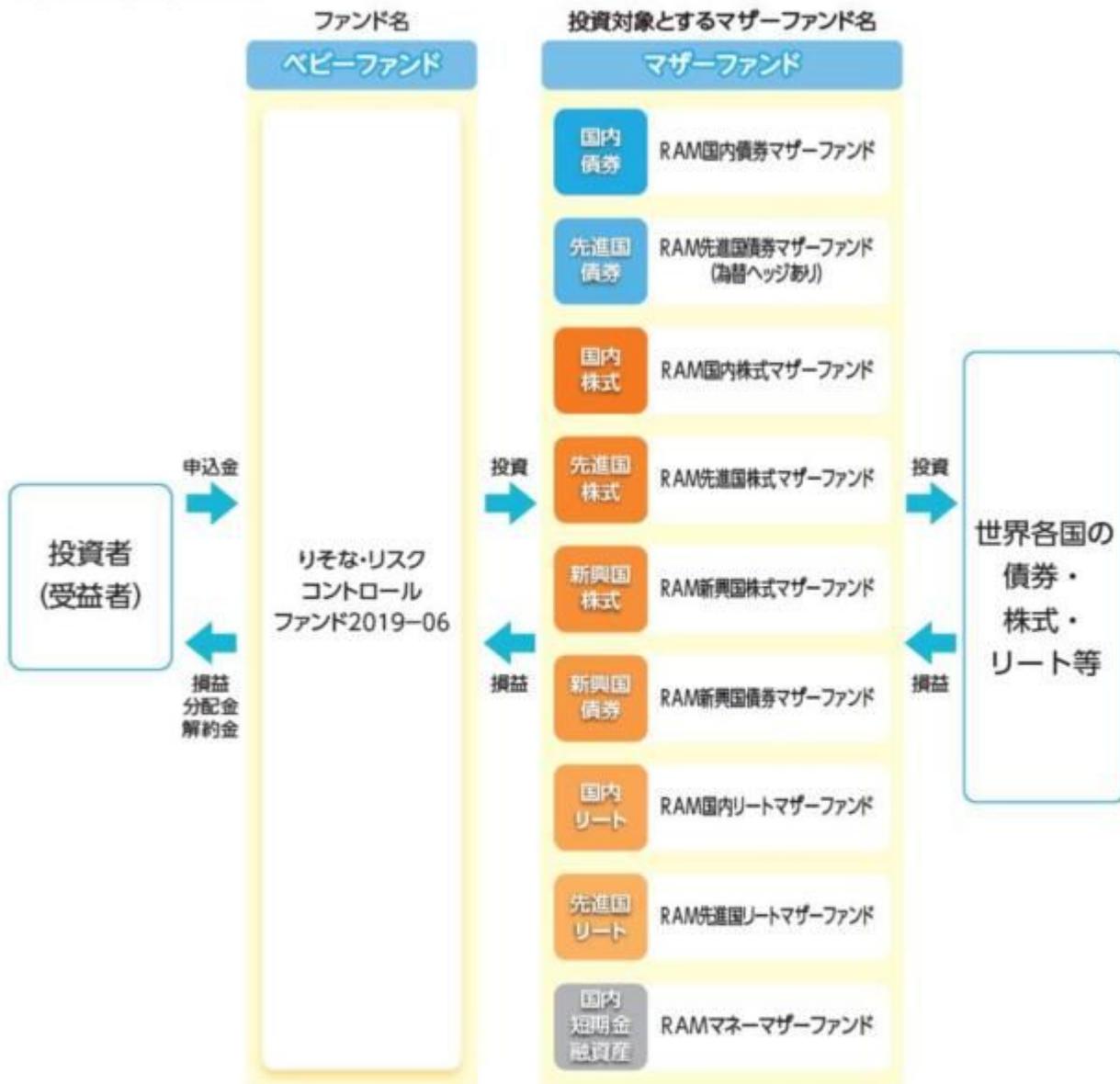
原則、毎年5月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
- 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。

■ ファンドの仕組み

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。

インデックスの著作権等について

●RAM国内債券マザーファンド

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

●RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RAM国内株式マザーファンド

「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄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、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

●RAM先進国株式マザーファンド

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

●RAM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。

●RAM新興国債券マザーファンド

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

●RAM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東京証券取引所に帰属します。

●RAM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。

※RAMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

信託金限度額

500億円を限度とします。

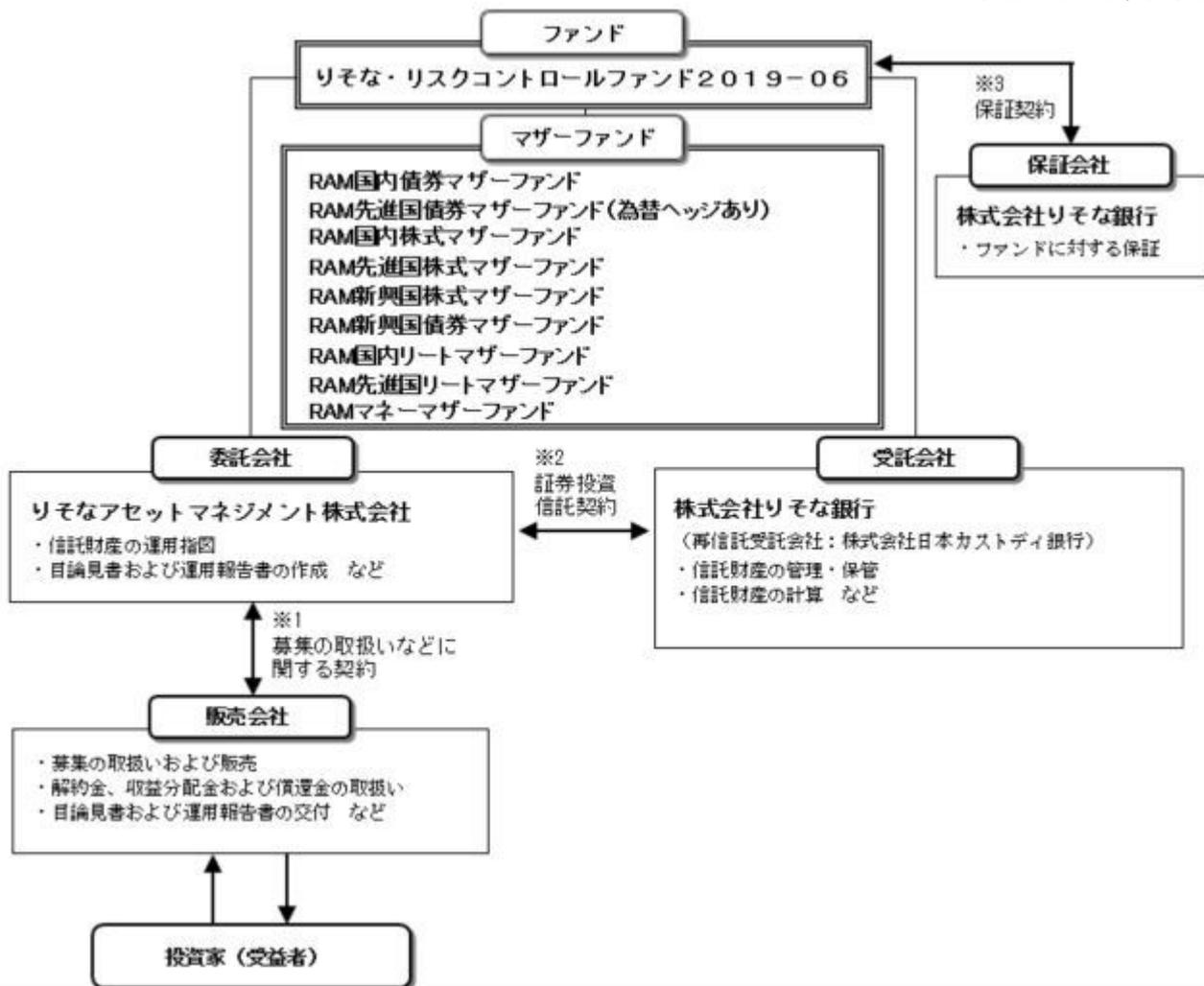
(2) 【ファンドの沿革】

2019年6月10日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を保証会社が信託財産に支払うことを規定したものの。

注) 本契約は民法上の保証契約を意味するものではなく、保証類似行為として行われるものです。
また本契約は、株式会社りそな銀行がファンドの元本を保証するものではありません。

委託会社の概況（2020年5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】

RAM国内債券マザーファンド、RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RAM国内株式

マザーファンド、RAM先進国株式マザーファンド、RAM新興国株式マザーファンド、RAM新興国債券マザーファンド、RAM国内リートマザーファンド、RAM先進国リートマザーファンドおよびRAMマネーマザーファンド(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*。

*上記は設定時点における主要投資対象であり、将来の市場環境および市場構造の変化等によっては、一部のマザーファンドへの投資割合がゼロとなる場合や、新たに主要投資対象を追加する場合があります。

主として、次項に掲げる各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内債券および先進国債券(為替ヘッジあり)に投資を行い、安定した収益を確保しつつ、定量的手法による投資環境の判定基準に従って、国内および先進国の株式・不動産投資信託証券(リート)ならびに新興国の株式・債券等へも機動的に投資することにより、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。各投資対象資産への投資は、各資産を投資対象とするマザーファンドを通じて行います。また、各マザーファンドは下記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

マザーファンド	実質的投資対象	インデックス
RAM国内債券マザーファンド	国内債券	NOMURA - B P I 総合
RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)
RAM国内株式マザーファンド	国内株式	東証株価指数(TOPIX、配当込み)
RAM先進国株式マザーファンド	先進国株式	M S C I - K O K U S A I 指数(配当込み、円換算ベース)
RAM新興国株式マザーファンド	新興国株式	M S C I エマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
RAM新興国債券マザーファンド	新興国債券	J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
RAM国内リートマザーファンド	国内リート	東証REIT指数(配当込み)
RAM先進国リートマザーファンド	先進国リート	S & P 先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)

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。

投資環境の悪化等により、基準価額があらかじめ定めた閾値(以下『確保ライン』といいます。)に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、RAMマネーマザーファンド受益証券への投資を通じて残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。

ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ信託財産の着実な成長を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託者が保証するものではありません。

設定時における『確保ライン』は9,500円とします。設定後、基準価額が最初に10,500円を上回った日の翌営業日以降は『確保ライン』を10,000円に見直すものとし、その後の信託期間においては『確保ライン』の見直しは行わないものとします。また、『確保ライン』の引き下げは行いません。

上記の方針に関わらず、以下の場合は、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替えた後、繰上償還を行います。

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

ロ 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。

一の会社(以下「保証会社」といいます。)との間で、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回ることがないように保証契約を締結します。信託契約締結当初の保証会社は、株式会社りそな銀行です。保証会社は、基準価額が『確保ライン』まで下落した場合および償還時において、契約の規定に基づき基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。ただし、保証会社が破綻した場合は、保証契約の履行はありません。

資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった

場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条、第21条および第22条に定めるものに限りません。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19) の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

なお、1) の証券または証書ならびに12) および17) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

<RAM国内債券マザーファンド>

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券
投資方針	主として、NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、NOMURA - B P I 総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< RAM先進国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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。

投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< RAM国内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、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

< RAM先進国株式マザーファンド >

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

主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）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。 ・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）
投資方針	<p>主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R A M新興国株式マザーファンド >

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

その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R A M新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・ J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に投資し、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。

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

< R A M国内リートマザーファンド >

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

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

< R A M先進国リートマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

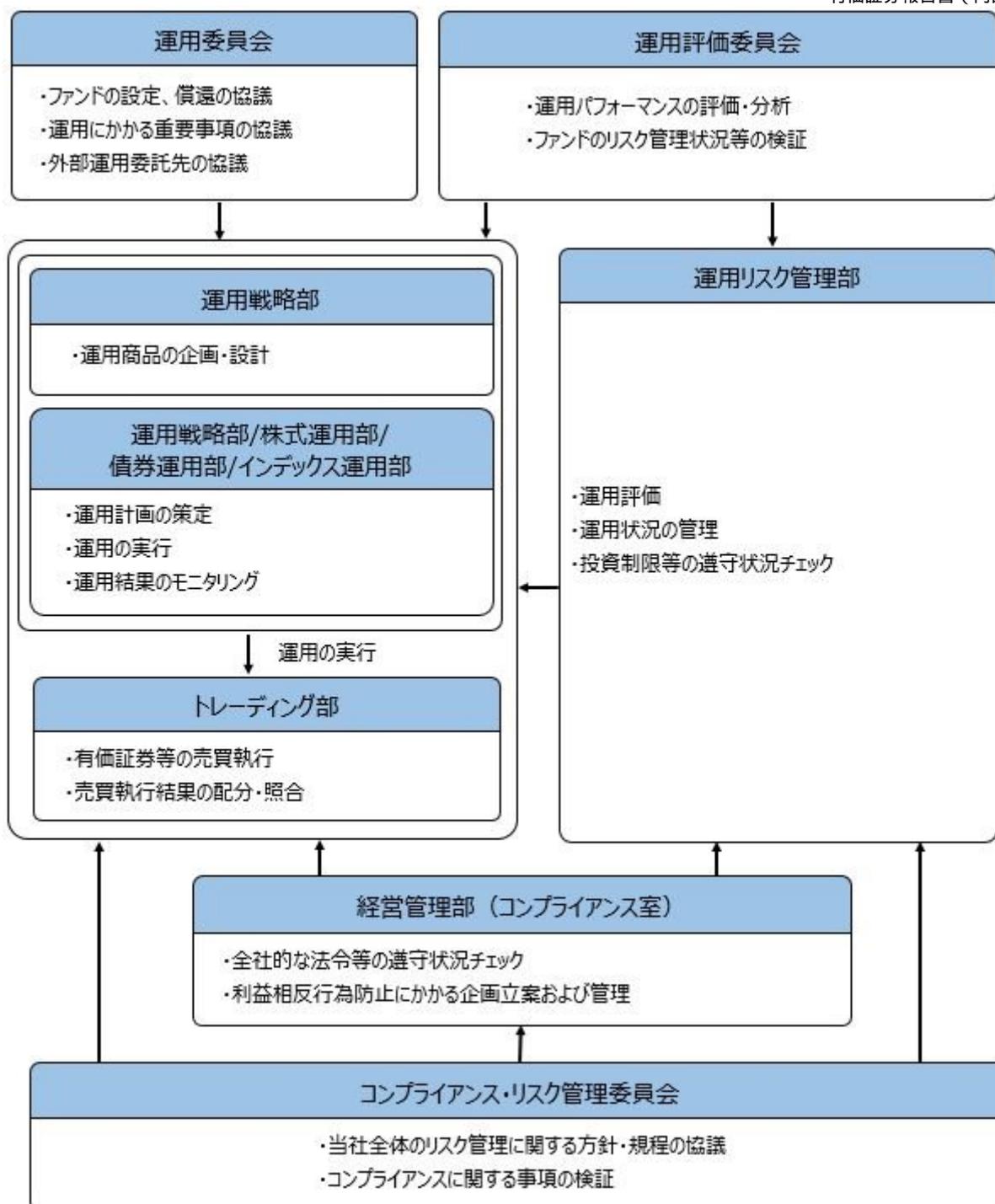
< RAMマネーマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、金融市場の短期金利水準に応じた投資成果と流動性の確保を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、残存期間の短い国内の公社債への投資により利息等収益の獲得および流動性の確保を図ります。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



運用委員会は5名程度、運用評価委員会は5名程度、コンプライアンス・リスク管理委員会は3名程度で構成されています。

りそなアセットマネジメント株式会社の運用体制に関する社内規則等は次の通りです。
委託会社では、運用に関する社内規程およびリスク管理規程を定め、適切な運用を行うと共に運用リスクの管理を行っています。

ファンドの関係法人に対する管理体制

委託会社は、受託会社または再信託受託会社に対して、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、外部監査法人による内部統制の整備および運用状況の報告書を受託会社より受け取っております。

上記の運用体制は、2020年5月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
- 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。

収益分配金の支払い

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

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券

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および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)).
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。)ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差し引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債

権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、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. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。)を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5. 前記3. および4. においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 6. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 13) 直物為替先渡取引の運用指図
1. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
 2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
 3. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3. において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する直物為替先渡取引の一部の解約（反対の売買による解消を含む。）を指図するものとします。
 4. 前記3. においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
 5. 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
 6. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲
1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
 2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
 3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。
- 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限
- 外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 16) 外国為替予約取引の指図および範囲
- 委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額を

います。)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、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. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

同一法人の発行する株式について、委託会社が運用の指図を行なう投資信託全体で、当該株式の議決権の過半数を保有することとなる取引は行ないません。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

当ファンドの基準価額は、実質的に組み入れている有価証券等の値動きにより影響を受けませんが、運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。また、投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重にご判断くださいますようお願いいたします。

市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

資産配分リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証契約は保証会社（株式会社りそな銀行）の信用リスクの影響を受けます。保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったときは、ファンドは繰上償還します。この場合、基準価額または償還価額は『確保ライン』を下回る可能性があります。

（その他の留意点）

当ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を割り込むことがないように運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。

当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証会社の破綻等により保証契約が履行されない場合には、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回る可能性があります。

次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。

- ・基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
- ・基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
- ・保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき。

また次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意の上、繰上償還することができます。

- ・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。
- ・繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき。
- ・やむを得ない事情が発生したとき。

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

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

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の方が小さかった場合も同様です。

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

（2）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期

的にパフォーマンス評価を実施するとともに、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。

運用評価委員会は、運用実績および主な投資制限等の遵守状況や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。

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2020年5月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

<当初設定日以降、2019年7月4日まで>

年率1.2204%（税抜1.13%）

<2019年7月5日以降>

1ヵ月に1度見直すものとし、前月末営業日における各マザーファンド（RAMマネーマザーファンドを除きます。）の時価総額のうち当ファンドが保有する部分の合計が、純資産総額に占める割合（以下「リスク性資産割合」といいます。）に応じ、以下の表に掲げる率を毎月初第5営業日より適用するものとします。

リスク性資産割合	信託報酬
50%以上	年率1.243%（税抜1.13%）
25%以上50%未満	年率0.561%（税抜0.51%）
25%未満	年率0.297%（税抜0.27%）

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落し、繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の信託報酬の総額は0円とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

<当初設定日以降、2019年7月4日まで>

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

0.55%	0.55%	0.03%
-------	-------	-------

< 2019年7月5日以降 >

リスク性資産割合	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
50%以上	0.55%	0.55%	0.03%
25%以上50%未満	0.24%	0.24%	0.03%
25%未満	0.12%	0.12%	0.03%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

保証料

保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率0.216%を乗じて得た額とします。信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。

上記の信託報酬に保証料を加えた費用は最大で年率1.459%（税込）となります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落し、繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の保証料の総額は0円とします。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

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せん。）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せん。）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せん。）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、毎年、年間120万円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5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度（ジュニアNISA）をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円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5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

収益分配金ならびに解約時および償還時の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。

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2020年5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。

５【運用状況】

【りそな・リスクコントロールファンド2019-06】

以下の運用状況は2020年5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	21,639,989,145	98.17
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		403,470,726	1.83
合計（純資産総額）		22,043,459,871	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R A Mマナーマザーファンド	12,820,254,203	0.9992	12,810,000,000	0.9985	12,801,023,821	58.07
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	5,750,367,086	1.0564	6,075,001,407	1.0589	6,089,063,707	27.62
日本	親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	1,443,235,058	1.0567	1,525,105,320	1.0551	1,522,757,309	6.91
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国株式マザーファンド	584,060,765	1.1640	679,883,137	1.2618	736,967,873	3.34
日本	親投資信託受益証券	R A M先進国リートマザーファンド	137,619,113	0.8461	116,447,510	0.9138	125,756,345	0.57
日本	親投資信託受益証券	R A M国内株式マザーファンド	109,917,246	1.0342	113,682,048	1.1075	121,733,349	0.55
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国株式マザーファンド	107,553,542	1.0840	116,593,616	1.1245	120,943,957	0.55
日本	親投資信託受益証券	R A M国内リートマザーファンド	52,500,756	1.0874	57,093,365	1.1666	61,247,381	0.28
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国債券マザーファンド	59,256,934	0.9668	57,295,405	1.0209	60,495,403	0.27

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	98.17
合計	98.17

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2020年 5月15日)	22,085	22,085	0.9690	0.9690
2019年 6月末日	27,638		1.0057	
7月末日	27,571		1.0114	
8月末日	27,550		1.0193	
9月末日	27,205		1.0167	
10月末日	26,737		1.0114	
11月末日	26,438		1.0154	
12月末日	25,960		1.0173	
2020年 1月末日	25,311		1.0262	
2月末日	24,704		1.0175	
3月末日	22,695		0.9711	
4月末日	22,214		0.9702	
5月末日	22,043		0.9715	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2019年 6月10日～2020年 5月15日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2019年 6月10日～2020年 5月15日	3.10

(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	2019年 6月10日～2020年 5月15日	27,612,309,231	4,819,198,124

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

R A M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	67,183,025,720	84.30
地方債証券	日本	3,921,409,500	4.92
特殊債券	日本	4,655,132,183	5.84
社債券	日本	3,104,369,000	3.90
	フランス	98,562,000	0.12
	オーストラリア	99,564,000	0.12
	小計	3,302,495,000	4.14
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		629,031,188	0.79
合計（純資産総額）		79,691,093,591	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	1,100,000,000	101.02	1,111,247,600	100.95	1,110,505,000	0.100	2024/3/20	1.39
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	1,060,000,000	100.68	1,067,241,400	100.61	1,066,487,200	0.100	2022/9/20	1.34
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	930,000,000	101.01	939,424,200	100.99	939,281,400	0.100	2024/6/20	1.18
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	930,000,000	100.73	936,792,800	100.67	936,314,700	0.100	2022/12/20	1.17
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	830,000,000	100.88	837,314,300	100.75	836,299,700	0.100	2023/3/20	1.05
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	820,000,000	100.84	826,918,300	100.82	826,789,600	0.100	2023/6/20	1.04
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	790,000,000	101.35	800,683,900	101.11	798,832,200	0.100	2029/9/20	1.00
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	734,000,000	103.12	756,905,100	102.83	754,772,200	0.400	2025/9/20	0.95
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	700,000,000	101.58	711,095,000	101.45	710,171,000	0.100	2026/12/20	0.89
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	650,000,000	101.26	658,212,100	101.05	656,831,500	0.100	2029/12/20	0.82
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	631,000,000	102.78	648,591,900	102.58	647,305,040	0.400	2025/3/20	0.81

日本	国債証券	第132回利付国債(5年)	640,000,000	100.64	644,111,800	100.54	643,488,000	0.100	2022/6/20	0.81
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	630,000,000	101.42	638,961,500	101.46	639,210,600	0.100	2028/9/20	0.80
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	610,000,000	102.00	622,207,500	101.47	618,985,300	0.100	2027/3/20	0.78
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	600,000,000	101.81	610,894,800	101.53	609,192,000	0.100	2028/3/20	0.76
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	600,000,000	100.91	605,477,800	100.91	605,466,000	0.100	2023/12/20	0.76
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	580,000,000	101.52	588,870,400	101.28	587,429,800	0.100	2029/3/20	0.74
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	550,000,000	101.56	558,581,500	101.37	557,546,000	0.100	2026/6/20	0.70
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	540,000,000	101.56	548,468,800	101.42	547,716,600	0.100	2026/9/20	0.69
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	532,000,000	102.98	547,859,440	102.69	546,348,040	0.600	2023/12/20	0.69
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	530,000,000	101.61	538,557,500	101.37	537,287,500	0.100	2028/12/20	0.67
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	500,000,000	101.51	507,573,200	101.22	506,125,000	0.100	2029/6/20	0.64
日本	国債証券	第166回利付国債(20年)	460,000,000	108.31	498,266,000	106.57	490,222,000	0.700	2038/9/20	0.62
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	425,000,000	115.13	489,326,900	114.14	485,099,250	1.200	2034/12/20	0.61
日本	国債証券	第164回利付国債(20年)	470,000,000	104.72	492,225,500	103.20	485,063,500	0.500	2038/3/20	0.61
日本	国債証券	第146回利付国債(20年)	400,000,000	121.41	485,651,600	120.21	480,868,000	1.700	2033/9/20	0.60
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	470,000,000	101.71	478,060,500	101.52	477,153,400	0.100	2027/12/20	0.60
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	470,000,000	101.11	475,226,500	101.07	475,057,200	0.100	2024/12/20	0.60
日本	国債証券	第129回利付国債(5年)	450,000,000	100.40	451,813,500	100.33	451,525,500	0.100	2021/9/20	0.57
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	440,000,000	101.05	444,634,000	101.03	444,571,600	0.100	2024/9/20	0.56

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	84.30
地方債証券	4.92
特殊債券	5.84
社債券	4.14
合計	99.21

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	66,640,172,035	46.13
	カナダ	2,844,690,076	1.97
	メキシコ	1,164,917,524	0.81
	ドイツ	10,696,924,036	7.40
	イタリア	13,001,591,909	9.00
	フランス	14,437,523,584	9.99
	オランダ	2,773,892,829	1.92
	スペイン	8,584,359,860	5.94
	ベルギー	3,616,934,718	2.50
	オーストリア	2,191,852,254	1.52
	フィンランド	782,938,515	0.54
	アイルランド	1,088,888,383	0.75
	イギリス	9,623,371,046	6.66
	スウェーデン	418,408,828	0.29
	ノルウェー	356,286,060	0.25
	デンマーク	707,159,953	0.49
	ポーランド	841,217,717	0.58
	オーストラリア	3,006,769,090	2.08
	シンガポール	659,043,752	0.46
	マレーシア	662,298,653	0.46
イスラエル	547,887,134	0.38	
	小計	144,647,127,956	100.13
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		183,338,392	0.13
合計（純資産総額）		144,463,789,564	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		3,394,841,218	2.35
	売建		146,146,112,780	101.16

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,900,000	11,113.32	989,085,671	11,141.95	991,634,027	1.625	2022/12/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	13,591.79	856,282,896	14,545.74	916,381,761	3.000	2048/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,260,000	11,095.64	916,500,127	11,087.98	915,867,204	2.000	2022/2/15	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	11,205.88	893,109,372	11,272.16	898,391,768	1.375	2025/1/31	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	11,282.67	857,483,576	11,322.78	860,531,441	1.500	2024/11/30	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,360,000	11,256.93	715,940,772	12,366.99	786,541,167	2.375	2029/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,780,000	12,776.32	738,471,738	12,972.48	749,809,683	3.125	2028/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,531.74	631,939,831	11,680.65	640,099,945	2.750	2023/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,904.36	623,788,842	12,083.47	633,173,984	2.250	2027/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	11,180.66	626,117,082	11,174.71	625,784,246	2.375	2022/3/15	0.43
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	18,184.11	625,533,678	17,923.17	616,557,391	5.500	2029/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,953.35	586,004,680	11,512.64	615,926,256	2.125	2024/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,956.24	579,878,107	12,519.26	607,184,310	2.750	2028/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,790,000	11,775.32	564,038,077	12,665.22	606,664,397	2.875	2028/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,620,000	12,140.80	560,905,191	12,707.02	587,064,378	2.875	2028/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,660,000	12,577.98	586,134,201	12,563.36	585,452,927	2.625	2029/2/15	0.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	2,660,000	21,710.54	577,500,604	21,474.56	571,223,413	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,100,000	11,176.13	569,982,658	11,188.58	570,617,599	1.875	2022/10/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,940,000	11,460.54	566,151,041	11,473.99	566,815,410	1.625	2026/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,080,000	11,073.17	562,517,495	11,129.77	565,392,537	1.625	2022/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,780,000	12,692.87	479,790,687	14,655.79	553,988,965	3.000	2049/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,710,000	11,373.81	535,706,503	11,489.95	541,177,019	1.625	2026/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,670,000	11,020.46	514,655,839	11,071.38	517,033,856	1.875	2022/2/28	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,570,000	13,462.15	480,599,098	14,357.98	512,580,071	2.875	2049/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,620,000	12,080.53	437,315,299	14,141.66	511,928,270	2.875	2046/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,470,000	11,332.58	506,566,625	11,444.38	511,563,941	1.500	2027/1/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,340,000	11,518.31	499,894,926	11,690.73	507,377,980	2.500	2024/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,270,000	11,439.49	488,466,434	11,819.05	504,673,813	2.250	2025/11/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,960,000	12,836.90	508,341,609	12,735.12	504,311,117	1.750	2023/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,600,000	10,896.60	501,243,783	10,930.46	502,801,456	1.500	2021/8/31	0.35

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.13
合計	100.13

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	14,660,900.00	1,575,313,705	1,576,339,968	1.09
	カナダドル	買建	953,600.00	74,255,115	74,380,800	0.05
	メキシコペソ	買建	6,121,700.00	29,547,609	29,567,811	0.02
	ユーロ	買建	11,458,900.00	1,349,324,435	1,365,098,757	0.94
	英ポンド	買建	1,817,700.00	240,568,414	240,881,604	0.17
	スウェーデンクローナ	買建	2,127,000.00	23,684,357	23,992,560	0.02
	オーストラリアドル	買建	883,300.00	62,993,864	63,014,622	0.04
	シンガポールドル	買建	284,200.00	21,528,860	21,565,096	0.01
	米ドル	売建	628,016,000.00	66,999,293,251	67,523,395,020	46.74
	カナダドル	売建	36,696,000.00	2,821,072,577	2,862,249,840	1.98
	メキシコペソ	売建	243,583,000.00	1,087,818,724	1,176,330,810	0.81
	ユーロ	売建	483,892,000.00	56,185,570,424	57,646,169,280	39.90
	英ポンド	売建	73,457,000.00	9,773,331,273	9,734,411,240	6.74
	スウェーデンクローナ	売建	37,733,000.00	410,419,512	425,628,240	0.29
	ノルウェークローネ	売建	33,641,000.00	349,374,604	369,714,590	0.26
	デンマーククローネ	売建	45,145,000.00	705,038,748	721,417,100	0.50
	ポーランドズロチ	売建	31,421,000.00	802,470,630	839,569,120	0.58
	オーストラリアドル	売建	42,415,000.00	2,963,642,743	3,025,850,820	2.09
	シンガポールドル	売建	8,680,000.00	656,361,485	658,627,240	0.46
	マレーシアリングット	売建	24,810,000.00	608,740,801	613,055,100	0.42
イスラエルシェケル	売建	17,958,000.00	553,359,750	549,694,380	0.38	

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	20,061,793,330	97.80
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		450,507,936	2.20
合計（純資産総額）		20,512,301,266	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	514,470,000	2.51
----------	----	----	-------------	------

(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	101,900	7,409.83	755,062,459	6,755.00	688,334,500	3.36
日本	株式	ソニー	電気機器	57,200	7,473.04	427,458,054	6,874.00	393,192,800	1.92
日本	株式	キーエンス	電気機器	8,300	38,246.25	317,443,909	44,350.00	368,105,000	1.79
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	71,100	4,533.33	322,320,447	4,832.00	343,555,200	1.67
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	76,000	4,112.05	312,515,960	4,191.00	318,516,000	1.55
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	119,800	2,709.24	324,567,824	2,444.00	292,791,200	1.43
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	616,000	526.48	324,312,832	444.20	273,627,200	1.33
日本	株式	第一三共	医薬品	26,100	7,428.30	193,878,781	10,085.00	263,218,500	1.28
日本	株式	任天堂	その他製品	5,600	41,815.48	234,166,688	43,540.00	243,824,000	1.19
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	62,500	4,045.71	252,857,148	3,710.00	231,875,000	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	66,800	3,238.30	216,318,526	3,136.00	209,484,800	1.02
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	71,900	2,793.65	200,863,569	2,784.00	200,169,600	0.98
日本	株式	信越化学工業	化学	15,400	12,143.09	187,003,640	12,620.00	194,348,000	0.95
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	62,300	3,574.82	222,711,746	3,119.00	194,313,700	0.95
日本	株式	花王	化学	21,900	8,887.07	194,626,978	8,647.00	189,369,300	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	64,100	3,117.07	199,804,457	2,951.50	189,191,150	0.92
日本	株式	HOYA	精密機器	18,200	10,582.06	192,593,492	10,110.00	184,002,000	0.90
日本	株式	ダイキン工業	機械	11,600	15,154.60	175,793,360	15,850.00	183,860,000	0.90
日本	株式	ファナック	電気機器	8,700	18,956.09	164,918,028	19,215.00	167,170,500	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,223,700	150.98	184,764,460	134.50	164,587,650	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	26,800	6,297.05	168,761,157	6,015.00	161,202,000	0.79
日本	株式	三菱商事	卸売業	63,100	2,711.34	171,085,834	2,515.00	158,696,500	0.77
日本	株式	S M C	機械	2,900	48,314.81	140,112,976	54,370.00	157,673,000	0.77
日本	株式	日立製作所	電気機器	43,900	4,078.83	179,060,991	3,455.00	151,674,500	0.74
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	79,200	1,835.27	145,353,708	1,914.50	151,628,400	0.74
日本	株式	中外製薬	医薬品	9,500	11,184.15	106,249,425	15,890.00	150,955,000	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	31,800	5,678.67	180,581,855	4,668.00	148,442,400	0.72
日本	株式	日本電産	電気機器	22,000	6,939.89	152,677,678	6,622.00	145,684,000	0.71
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	62,900	2,495.18	156,947,120	2,310.00	145,299,000	0.71
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	9,300	14,265.59	132,670,000	15,615.00	145,219,500	0.71

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.21
		建設業	2.56
		食料品	3.90
		繊維製品	0.51
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.12
		医薬品	6.99
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.63
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.54
		機械	5.00
		電気機器	14.21
		輸送用機器	7.13
		精密機器	2.56
		その他製品	2.33
		電気・ガス業	1.56
		陸運業	4.24
		海運業	0.14
		空運業	0.36
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	9.32
		卸売業	4.54
		小売業	4.82
		銀行業	4.97
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	2.01
その他金融業	1.11		
不動産業	2.07		
サービス業	5.27		
合 計			97.80

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	33	日本円	454,758,150	514,470,000	2.51

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

R A M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	19,596,017,377	43.00
	カナダ	1,008,924,291	2.21
	パナマ	6,344,778	0.01
	ドイツ	876,575,608	1.92
	イタリア	171,271,060	0.38
	フランス	994,373,219	2.18
	オランダ	534,367,707	1.17
	スペイン	250,532,803	0.55
	ベルギー	85,269,929	0.19
	オーストリア	18,537,983	0.04
	ルクセンブルク	24,618,697	0.05
	フィンランド	123,047,674	0.27
	アイルランド	539,981,778	1.18
	ポルトガル	18,655,207	0.04
	イギリス	1,402,396,208	3.08
	スイス	1,105,233,448	2.43
	スウェーデン	264,477,574	0.58
	ノルウェー	57,651,458	0.13
	デンマーク	227,886,525	0.50
	ケイマン	56,046,791	0.12
	リベリア	8,716,984	0.02
	オーストラリア	598,839,638	1.31
	バミューダ	97,902,443	0.21
ニュージーランド	30,444,283	0.07	
パプアニューギニア	3,598,028	0.01	
香港	244,300,889	0.54	

	シンガポール	102,201,398	0.22
	イスラエル	67,233,542	0.15
	キュラソー	19,895,752	0.04
	ジャージー	90,084,411	0.20
	英ヴァージン諸島	2,849,871	0.01
	マン島	7,504,988	0.02
	小計	28,635,782,342	62.84
投資証券	アメリカ	640,251,615	1.40
	カナダ	7,491,160	0.02
	フランス	17,706,624	0.04
	イギリス	18,592,824	0.04
	オーストラリア	40,902,566	0.09
	香港	12,096,027	0.03
	シンガポール	16,380,704	0.04
	小計	753,421,520	1.65
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,182,038,343	35.51
合計(純資産総額)		45,571,242,205	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	10,649,992,695	23.37
	買建	ドイツ	2,846,483,269	6.25

(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		495,309,720	1.09
	売建		2,659,500,930	5.84

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	32,598	34,227.87	1,115,760,247	34,221.42	1,115,549,931	2.45
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	53,174	17,746.75	943,665,748	19,505.94	1,037,208,960	2.28
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	3,092	200,182.14	618,963,205	258,190.28	798,324,355	1.75

アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・ 娯楽	17,614	23,435.08	412,785,644	24,243.71	427,028,775	0.94
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・ 娯楽	2,263	157,715.32	356,909,784	152,340.97	344,747,631	0.76
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・ 娯楽	2,193	157,657.25	345,742,371	152,503.34	334,439,840	0.73
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	19,304	15,948.84	307,876,593	15,803.68	305,074,318	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェ ア・サービ ス	12,549	22,043.65	276,625,764	20,888.77	262,133,273	0.58
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲 料・タバコ	21,820	12,144.52	264,993,600	11,468.71	250,247,400	0.55
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	22,979	14,317.61	329,004,579	10,737.94	246,747,257	0.54
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・ パーソナル 用品	18,296	13,456.30	246,196,541	12,479.93	228,332,832	0.50
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア 機器・サー ビス	6,946	31,485.85	218,700,778	32,685.89	227,036,220	0.50
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェ ア・サービ ス	6,575	34,804.23	228,837,845	32,506.31	213,729,047	0.47
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半 導体製造装 置	31,897	7,362.57	234,844,185	6,634.60	211,623,868	0.46
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	7,988	24,946.96	199,276,317	26,359.90	210,562,915	0.46
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	5,154	36,049.95	185,801,469	38,056.20	196,141,655	0.43
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	9,625	24,394.25	234,794,712	19,903.80	191,574,104	0.42
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信 サービス	30,352	6,481.90	196,738,884	5,991.57	181,856,181	0.40
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信 サービス	53,610	4,139.90	221,940,307	3,339.88	179,051,063	0.39
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	62,549	3,606.55	225,586,484	2,673.19	167,205,724	0.37
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バ イオテクノ ロジー・ラ イフサイエ ンス	40,562	4,281.84	173,680,180	4,105.49	166,527,104	0.37
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・ 娯楽	13,148	15,062.80	198,045,726	12,554.12	165,061,668	0.36
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	18,661	9,245.42	172,528,958	8,499.17	158,603,034	0.35
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半 導体製造装 置	4,260	26,934.11	114,739,328	36,504.28	155,508,252	0.34
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	31,028	5,252.84	162,985,135	4,902.83	152,125,020	0.33
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲 料・タバコ	29,804	6,202.33	184,854,255	5,063.58	150,915,168	0.33
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	30,943	7,131.38	220,666,589	4,843.15	149,861,628	0.33
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	15,755	10,209.65	160,853,130	9,298.53	146,498,460	0.32

アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	10,209	15,367.11	156,882,849	14,225.14	145,224,492	0.32
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	3,542	37,782.81	133,826,735	40,843.11	144,666,331	0.32

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	2.40
		素材	2.72
		資本財	4.01
		商業・専門サービス	0.80
		運輸	1.20
		自動車・自動車部品	0.71
		耐久消費財・アパレル	1.18
		消費者サービス	1.01
		メディア・娯楽	4.31
		小売	3.73
		食品・生活必需品小売り	1.01
		食品・飲料・タバコ	3.06
		家庭用品・パーソナル用品	1.40
		ヘルスケア機器・サービス	3.51
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.90
		銀行	3.70
		各種金融	2.77
		保険	2.06
		不動産	0.29
		ソフトウェア・サービス	7.44
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.46		
電気通信サービス	1.43		
公益事業	2.33		
半導体・半導体製造装置	2.40		
投資証券			1.65
合計			64.49

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	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	SP500MIN2006	買建	652	米ドル	85,933,162.5	9,240,392,961	99,042,060	10,649,992,695	23.37
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002006	買建	1,345	ユーロ	21,220,450	2,527,992,205	23,893,925	2,846,483,269	6.25

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,650,000.00	392,398,360	392,448,000	0.86
	カナダドル	買建	292,000.00	22,756,494	22,776,000	0.05
	ユーロ	買建	100,000.00	11,791,160	11,913,000	0.03
	英ポンド	買建	190,000.00	25,167,590	25,178,800	0.06
	スイスフラン	買建	215,000.00	23,932,553	23,976,800	0.05
	スウェーデンクローナ	買建	674,000.00	7,524,064	7,602,720	0.02
	オーストラリアドル	買建	160,000.00	11,423,424	11,414,400	0.03
	米ドル	売建	17,672,000.00	1,900,093,440	1,900,093,440	4.17
	カナダドル	売建	1,042,000.00	81,271,832	81,276,000	0.18
	ユーロ	売建	2,665,000.00	317,457,465	317,481,450	0.70
	英ポンド	売建	884,000.00	117,145,912	117,147,680	0.26
	スイスフラン	売建	943,000.00	105,160,625	105,163,360	0.23
	スウェーデンクローナ	売建	2,095,000.00	23,644,170	23,631,600	0.05
	ノルウェークローネ	売建	470,000.00	5,166,663	5,165,300	0.01
	デンマーククローネ	売建	1,370,000.00	21,890,819	21,892,600	0.05
	オーストラリアドル	売建	670,000.00	47,797,130	47,797,800	0.10
	香港ドル	売建	2,399,000.00	33,274,130	33,250,140	0.07
	シンガポールドル	売建	87,000.00	6,600,951	6,601,560	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	15,437,776	0.23
	アルゼンチン	3,821,530	0.06
	メキシコ	81,566,691	1.21
	ブラジル	219,742,178	3.25
	チリ	25,741,751	0.38
	コロンビア	10,584,107	0.16

	ペルー	1,203,207	0.02
	オランダ	3,479,223	0.05
	スペイン	599,019	0.01
	ルクセンブルク	5,616,403	0.08
	ギリシャ	10,282,296	0.15
	トルコ	19,118,692	0.28
	チェコ	5,262,760	0.08
	ハンガリー	10,436,143	0.15
	ポーランド	33,622,452	0.50
	ロシア	152,527,726	2.26
	ケイマン	941,430,713	13.92
	バミューダ	41,797,443	0.62
	香港	120,950,008	1.79
	シンガポール	1,408,221	0.02
	マレーシア	80,451,237	1.19
	タイ	102,054,913	1.51
	フィリピン	34,509,550	0.51
	インドネシア	67,373,197	1.00
	韓国	515,059,305	7.62
	台湾	531,712,807	7.86
	中国	561,992,727	8.31
	インド	346,035,843	5.12
	カタール	43,864,514	0.65
	エジプト	5,075,937	0.08
	南アフリカ	163,856,403	2.42
	アラブ首長国連邦	29,139,141	0.43
	マン島	1,603,740	0.02
	サウジアラビア	140,423,458	2.08
	小計	4,327,781,111	64.01
投資証券	メキシコ	2,016,232	0.03
	南アフリカ	3,136,329	0.05
	小計	5,152,561	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,428,655,957	35.92
合計(純資産総額)		6,761,589,629	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,594,160,139	38.37

(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		298,550,510	4.42
	売建		63,780	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 (%)
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	13,330	22,935.07	305,724,533	21,451.15	285,943,959	4.23
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	43,900	5,351.87	234,947,453	5,661.73	248,550,123	3.68
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	188,000	1,188.70	223,476,202	1,052.52	197,873,760	2.93
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	36,561	5,283.51	193,170,774	4,379.75	160,128,405	2.37
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	737,000	89.04	65,626,460	85.71	63,173,134	0.93
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	3,401	15,159.51	51,557,506	17,987.63	61,175,934	0.90
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	21,730	2,139.38	46,488,838	2,105.31	45,748,549	0.68
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	42,500	1,309.60	55,658,230	1,061.05	45,094,838	0.67
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	47,000	960.35	45,136,864	750.36	35,267,249	0.52
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	499,000	77.67	38,758,328	69.76	34,813,284	0.51
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	5,620	4,246.35	23,864,542	5,486.18	30,832,335	0.46
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	4,168	8,523.52	35,526,055	7,290.91	30,388,513	0.45
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	12,523	3,484.66	43,638,484	2,321.89	29,077,041	0.43
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	21,206	1,817.25	38,536,752	1,255.95	26,633,684	0.39
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	26,108	1,115.77	29,130,570	1,011.58	26,410,383	0.39
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	3,156	11,314.30	35,707,952	8,226.04	25,961,398	0.38
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	95,800	327.82	31,405,213	269.57	25,825,189	0.38
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	42,102	804.32	33,863,666	593.13	24,972,190	0.37
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	608,000	44.24	26,901,142	39.52	24,033,936	0.36
ブラジル	株式	VALE SA	素材	24,000	1,058.47	25,403,397	995.28	23,886,919	0.35
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	6,289	4,180.16	26,289,077	3,780.14	23,773,363	0.35
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	2,050	13,913.30	28,522,279	11,432.58	23,436,809	0.35
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・ 娯楽	582	35,175.21	20,471,974	39,382.86	22,920,826	0.34

韓国	株式	NAVER CORP	メディア・ 娯楽	1,070	15,860.12	16,970,339	20,899.44	22,362,411	0.33
カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	39,267	595.95	23,401,197	519.79	20,410,672	0.30
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・ サービス	6,903	3,111.13	21,476,176	2,866.14	19,785,027	0.29
台湾	株式	MEDIA TEK INC	半導体・半 導体製造装 置	12,000	1,488.42	17,861,050	1,646.80	19,761,600	0.29
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	電気通信 サービス	257,100	75.79	19,486,740	72.98	18,765,009	0.28
サウジア ラビア	株式	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	素材	7,803	2,509.20	19,579,334	2,379.61	18,568,097	0.27
インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LTD	家庭用品・ パーソナル 用品	6,302	3,102.48	19,551,880	2,874.22	18,113,388	0.27

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.10
		素材	4.64
		資本財	1.99
		商業・専門サービス	0.19
		運輸	1.04
		自動車・自動車部品	1.21
		耐久消費財・アパレル	0.82
		消費者サービス	0.94
		メディア・娯楽	5.60
		小売	6.94
		食品・生活必需品小売り	1.04
		食品・飲料・タバコ	2.41
		家庭用品・パーソナル用品	0.80
		ヘルスケア機器・サービス	0.73
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1.65
		銀行	9.66
		各種金融	1.32
		保険	2.24
		不動産	1.62
		ソフトウェア・サービス	1.20
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.17		
電気通信サービス	2.79		
公益事業	1.59		
半導体・半導体製造装置	4.31		
投資証券			0.08
合計			64.08

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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 2006	買建	526	米ドル	21,825,915	2,346,940,638	24,124,990	2,594,160,139	38.37

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,689,593.85	181,653,970	181,665,125	2.69
	メキシコペソ	買建	1,290,000.00	6,224,671	6,230,700	0.09
	トルコリラ	買建	200,000.00	3,173,944	3,149,200	0.05
	チェココルナ	買建	70,000.00	307,080	308,700	0.00
	ハンガリーフォリント	買建	2,150,000.00	731,869	732,505	0.01
	ポーランドズロチ	買建	29,000.00	772,531	774,880	0.01
	香港ドル	買建	7,590,000.00	105,271,574	105,197,400	1.56
	南アフリカランド	買建	80,000.00	492,232	492,000	0.01
	オフショア人民元	売建	4,255.20	63,949	63,780	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。

R A M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,242,731,625	29.05
	アイルランド	2,957,143,685	69.13
	小計	4,199,875,310	98.19
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		77,486,506	1.81
合計(純資産総額)		4,277,361,816	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		29,944,320	0.70
	売建		55,372,800	1.29

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	493,285	6,264.43	3,090,153,330	5,994.79	2,957,143,685	69.13
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	378,424	3,613.00	1,367,248,939	3,283.96	1,242,731,625	29.05

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.19
合計	98.19

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	278,500.00	29,928,724	29,944,320	0.70
	米ドル	売建	515,000.00	55,373,366	55,372,800	1.29

(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。

RAM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	16,111,534,340	96.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		642,990,657	3.84

合計(純資産総額)	16,754,524,997	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	449,064,000	2.68

(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	1,775	826,478.3	1,466,998,982	676,000	1,199,900,000	7.16
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,833	753,387.31	1,380,958,939	588,000	1,077,804,000	6.43
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,758	296,972.99	819,051,506	304,000	838,432,000	5.00
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5,916	176,651.86	1,045,072,403	132,500	783,870,000	4.68
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,615	278,210.49	727,520,431	266,400	696,636,000	4.16
日本	投資証券	GLP投資法人	4,564	135,354.39	617,757,435	143,700	655,846,800	3.91
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,738	338,645.57	588,566,000	335,500	583,099,000	3.48
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,651	216,794.28	791,515,916	155,800	568,825,800	3.40
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,464	212,656.22	736,641,146	142,200	492,580,800	2.94
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,115	180,775.33	743,890,482	114,200	469,933,000	2.80
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,360	165,257.54	390,007,794	176,700	417,012,000	2.49
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	609	683,724.12	416,387,989	653,000	397,677,000	2.37
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,204	458,119.12	551,575,420	329,000	396,116,000	2.36
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	5,358	87,196.34	467,197,989	67,100	359,521,800	2.15
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,197	283,838.26	339,754,397	286,500	342,940,500	2.05
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	567	807,305.59	457,742,269	598,000	339,066,000	2.02
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	918	528,527.88	485,188,593	366,500	336,447,000	2.01
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,108	176,173.71	371,374,180	145,500	306,714,000	1.83
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,704	164,170.75	279,746,958	160,700	273,832,800	1.63
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	423	814,463.32	344,517,984	629,000	266,067,000	1.59
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,903	66,166.37	390,580,082	44,850	264,749,550	1.58
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	798	348,520.6	278,119,438	326,000	260,148,000	1.55
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	522	516,153.01	269,431,871	469,000	244,818,000	1.46
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	651	424,869.15	276,589,816	350,000	227,850,000	1.36
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,695	181,839.19	308,217,427	133,300	225,943,500	1.35
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,978	142,414.36	281,695,604	114,000	225,492,000	1.35
日本	投資証券	日本リート投資法人	595	470,252.85	279,800,445	378,500	225,207,500	1.34
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,243	102,888.24	230,778,322	98,900	221,832,700	1.32

日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,038	49,410.14	397,158,705	27,280	219,276,640	1.31
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,196	206,452.93	246,917,704	181,300	216,834,800	1.29

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	96.16
合計	96.16

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	264	日本円	479,685,640	449,064,000	2.68

(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。

RAM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年 5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	10,180,312,525	74.64
	カナダ	247,399,118	1.81
	ドイツ	36,698,373	0.27
	イタリア	1,916,891	0.01
	フランス	312,339,490	2.29
	オランダ	23,571,526	0.17
	スペイン	72,647,399	0.53
	ベルギー	167,189,139	1.23
	アイルランド	18,820,970	0.14
	イギリス	682,365,599	5.00
	オーストラリア	878,901,453	6.44
	ニュージーランド	60,019,703	0.44
	香港	229,205,634	1.68
	シンガポール	573,717,310	4.21
韓国	2,497,592	0.02	

	イスラエル	8,754,257	0.06
	ガーンジー	30,711,851	0.23
	マン島	2,609,781	0.02
	小計	13,529,678,611	99.20
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		108,749,836	0.80
合計（純資産総額）		13,638,428,447	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		145,598,685	1.07
	売建		68,513,900	0.50

(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	87,969	10,090.61	887,661,328	10,005.66	880,188,476	6.45
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	10,504	65,205.11	684,914,545	74,555.92	783,135,441	5.74
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	31,322	14,179.98	444,145,368	15,704.75	491,904,383	3.61
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	17,898	23,496.38	420,538,215	21,633.96	387,204,629	2.84
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,622	22,470.54	373,505,384	17,100.49	284,244,443	2.08
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	41,576	8,514.22	353,987,435	6,545.35	272,129,517	2.00
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	48,339	8,537.88	412,712,678	5,520.59	266,859,810	1.96
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	40,814	7,785.17	317,744,010	5,989.42	244,452,229	1.79
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,578	17,352.11	252,959,149	16,682.20	243,193,173	1.78
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,531	13,853.08	506,067,227	6,424.91	234,708,661	1.72
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	192,853	1,055.16	203,492,347	1,099.50	212,042,549	1.55
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,866	31,996.62	251,685,467	26,759.91	210,493,498	1.54
香港	投資証券	LINK REIT	252,200	1,088.61	274,547,493	790.59	199,386,798	1.46
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	64,596	3,209.64	207,330,474	2,817.28	181,985,406	1.33
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	44,456	5,732.42	254,840,654	3,952.80	175,725,801	1.29
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,694	14,259.36	195,267,722	12,651.97	173,256,211	1.27
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	11,037	16,549.94	182,661,713	14,896.13	164,408,597	1.21
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	43,858	3,809.78	167,089,677	3,745.26	164,260,047	1.20
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	59,015	3,700.10	218,361,833	2,751.69	162,391,145	1.19
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,445	11,498.18	177,589,435	10,454.06	161,463,059	1.18
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	17,094	14,190.73	242,576,409	9,436.83	161,313,220	1.18
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	130,616	1,183.49	154,583,108	1,123.85	146,793,366	1.08
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	21,674	7,526.02	163,119,059	6,720.62	145,662,826	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	34,892	4,991.54	174,164,904	4,134.52	144,261,968	1.06

アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	20,533	8,631.83	177,237,506	6,696.96	137,508,852	1.01
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	61,338	2,303.78	141,309,773	1,951.66	119,711,504	0.88
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	11,550	11,473.91	132,523,746	9,951.90	114,944,462	0.84
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	54,616	2,667.53	145,690,349	2,083.93	113,815,997	0.83
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	84,980	1,708.57	145,194,300	1,293.58	109,928,930	0.81
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	635,360	252.85	160,654,011	169.81	107,892,388	0.79

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.20
合計	99.20

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	1,028,000.00	110,536,932	110,530,560	0.81
	カナダドル	買建	15,000.00	1,169,008	1,170,000	0.01
	ユーロ	買建	50,500.00	5,954,475	6,016,065	0.04
	英ポンド	買建	61,000.00	8,080,151	8,083,720	0.06
	オーストラリアドル	買建	115,000.00	8,210,620	8,204,100	0.06
	香港ドル	買建	300,000.00	4,160,910	4,158,000	0.03
	シンガポールドル	買建	98,000.00	7,432,761	7,436,240	0.05
	米ドル	売建	501,000.00	53,867,520	53,867,520	0.39
	ユーロ	売建	32,000.00	3,811,872	3,812,160	0.03
	英ポンド	売建	22,000.00	2,915,396	2,915,440	0.02
	オーストラリアドル	売建	45,000.00	3,210,255	3,210,300	0.02
	香港ドル	売建	170,000.00	2,357,900	2,356,200	0.02
	シンガポールドル	売建	31,000.00	2,352,063	2,352,280	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RAMマネーマザーファンド

以下の運用状況は2020年5月29日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	41,920,610,100	59.19
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		28,901,675,064	40.81
合計（純資産総額）		70,822,285,164	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第896回国庫短期証券	23,500,000,000	100.07	23,517,682,000	100.00	23,502,021,000		2020/6/22	33.18
日本	国債証券	第895回国庫短期証券	8,000,000,000	100.29	8,023,316,000	100.15	8,012,584,000		2021/3/22	11.31
日本	国債証券	第893回国庫短期証券	6,500,000,000	100.15	6,509,961,500	100.04	6,502,983,500		2020/9/10	9.18
日本	国債証券	第871回国庫短期証券	3,700,000,000	100.11	3,704,143,000	100.07	3,702,893,400		2020/11/20	5.23
日本	国債証券	第864回国庫短期証券	200,000,000	100.10	200,208,200	100.06	200,128,200		2020/10/20	0.28

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	59.19
合計	59.19

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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なってありません。

2【換金（解約）手続等】

（1）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（2）取扱時間

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

(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つき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

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

(6) 手取額

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

(7) 解約単位

最低単位を1口単位として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。

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

- ・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。
- ・また基準価額が『確保ライン』まで下落した場合は、償還日までの一定期間において解約請求の受付を中止する場合があります。

3【資産管理等の概要】

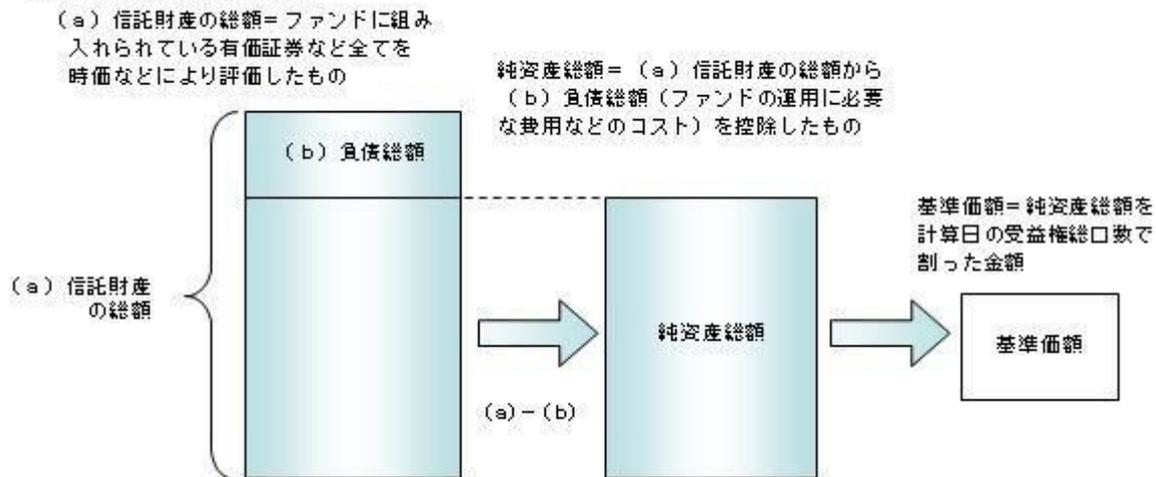
(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

います。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
- 金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
- 価格情報会社の提供する価額

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

* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2029年5月15日までとします(2019年6月10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5月16日から翌年5月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 信託財産の純資産総額が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) 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合
 - ロ) 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合
 - ハ) 保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき
 - ニ) 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
 - ホ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ヘ) 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。)
 - ト) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更(保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。)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(保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。)または併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

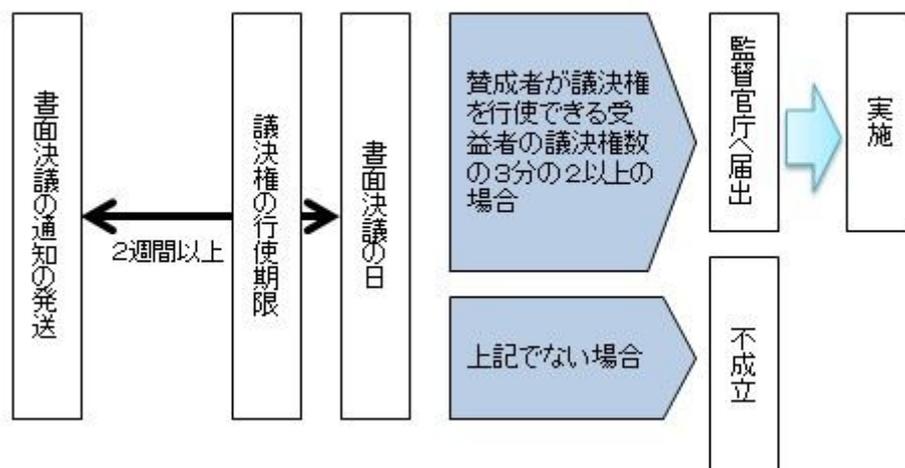
書面決議

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

<書面決議の主な流れ>



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

- ・委託会社は、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、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有

します。

- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年 6月10日から2020年 5月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【りそな・リスクコントロールファンド2019-06】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2020年 5月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,819,678,418
親投資信託受益証券	19,444,484,796
流動資産合計	22,264,163,214
資産合計	22,264,163,214
負債の部	
流動負債	
未払解約金	47,946,000
未払受託者報酬	3,264,784
未払委託者報酬	103,609,502
未払利息	7,647
その他未払費用	23,658,982
流動負債合計	178,486,915
負債合計	178,486,915
純資産の部	
元本等	
元本	22,793,111,107
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	707,434,808
元本等合計	22,085,676,299
純資産合計	22,085,676,299
負債純資産合計	22,264,163,214

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2019年 6月10日 至 2020年 5月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	339,442,213
営業収益合計	339,442,213
営業費用	
支払利息	572,855
受託者報酬	7,873,823
委託者報酬	272,506,579
その他費用	54,387,534
営業費用合計	335,340,791
営業利益又は営業損失（ ）	674,783,004
経常利益又は経常損失（ ）	674,783,004
当期純利益又は当期純損失（ ）	674,783,004
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（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	32,651,804
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	32,651,804
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	707,434,808

(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本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2019年 6月10日）から2020年 5月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
設定年月日	2019年 6月10日
設定元本額	27,612,309,231円
期首元本額	27,612,309,231円
元本残存率	82.5%
2. 計算期間の末日における受益権の総数	22,793,111,107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	707,434,808円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9690円
(10,000口当たり純資産額)	(9,690円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 6月10日 至 2020年 5月15日	
分配金の計算過程	
A 当ファンドの配当等収益額	572,855円
B 親ファンドの配当等収益額	390,083,023円
RAM国内株式マザーファンド	9,833,420円
RAM国内リートマザーファンド	9,155,046円
RAM先進国株式マザーファンド	44,130,427円
RAM新興国株式マザーファンド	9,525,772円
RAM先進国リートマザーファンド	16,938,343円
RAM国内債券マザーファンド	25,035,529円
RAM新興国債券マザーファンド	16,107,802円
RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	259,835,264円
RAMマネーマザーファンド	478,580円
C 配当等収益額合計(A+B)	389,510,168円

D 経費	334,767,936円
E 差引配当等収益額(C-D)	54,742,232円
F 当ファンドの当期末残存受益権口数	22,793,111,107口
G 当ファンドの期中平均残存受益権口数	25,309,743,779口
H 分配対象配当等収益額(E×F/G)	49,299,028円
I 元本超過額	0円
J 分配可能額(H>I)	49,299,028円
K 10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	21円
L 10,000口当たりの分配額	0円
M 収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

<p>第1期 自 2019年 6月10日 至 2020年 5月15日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期 2020年 5月15日現在</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2019年 6月10日 至 2020年 5月15日
該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2019年 6月10日 至 2020年 5月15日
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	24,564,886
合計	24,564,886

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	1,094,403,708	1,155,580,875	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	4,384,509,952	4,651,088,157	
	R A M国内株式マザーファンド	81,836,054	84,274,768	
	R A M先進国株式マザーファンド	427,805,843	501,516,789	
	R A M新興国株式マザーファンド	77,409,694	85,003,584	
	R A M新興国債券マザーファンド	44,163,302	42,639,668	
	R A M国内リートマザーファンド	38,398,009	40,782,525	
	R A M先進国リートマザーファンド	100,003,178	81,292,583	
	R A Mマネーマザーファンド	12,820,254,203	12,802,305,847	
合計		19,068,783,943	19,444,484,796	

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R A M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	549,501
コール・ローン	1,224,317,021
国債証券	65,011,934,600
地方債証券	3,922,538,200
特殊債券	4,657,708,764
社債券	3,299,248,000
未収利息	137,673,203
前払費用	19,579,969
流動資産合計	78,273,549,258
資産合計	78,273,549,258
負債の部	
流動負債	
未払金	828,067,800
未払解約金	1,440,000
未払利息	3,320
その他未払費用	3,642
流動負債合計	829,514,762
負債合計	829,514,762
純資産の部	
元本等	
元本	73,341,449,737
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,102,584,759
元本等合計	77,444,034,496
純資産合計	77,444,034,496
負債純資産合計	78,273,549,258

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	62,505,375,914円
期中追加設定元本額	71,172,230,834円

期中一部解約元本額	60,336,157,011円
期末元本額	73,341,449,737円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,592,699,839円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,643,569,661円
りそなラップ型ファンド(成長型)	348,367,516円
DCりそな グローバルバランス	360,806,379円
つみたてバランスファンド	1,192,829,707円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	898,184,177円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	174,927,204円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	39,122,859円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	10,895,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,839,198円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	403,439円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	74,883円
リスクコントロール・オープン	23,917,025円
FWりそな円建債券アクティブファンド	350,361,254円
FWりそな国内債券インデックスファンド	49,084,984,680円
Smart-i 国内債券インデックス	607,726,099円
Smart-i 8資産バランス 安定型	252,027,207円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	167,410,829円
Smart-i 8資産バランス 成長型	63,572,813円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,094,403,708円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	987,032,651円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	555,829,887円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	401,234,937円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,998,603,733円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	7,330,254円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	6,305,614,593円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	175,679,462円
2. 計算日における受益権の総数	73,341,449,737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	1.0559円
(10,000口当たり純資産額)	(10,559円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	577,859,720	

地方債証券	22,611,800
特殊債券	21,867,019
社債券	34,444,000
合計	656,782,539

(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401回利付国債(2年)	300,000,000	300,873,000	
	第402回利付国債(2年)	150,000,000	150,471,000	
	第403回利付国債(2年)	280,000,000	280,946,400	
	第404回利付国債(2年)	170,000,000	170,615,400	
	第405回利付国債(2年)	200,000,000	200,838,000	
	第406回利付国債(2年)	250,000,000	251,057,500	
	第407回利付国債(2年)	330,000,000	331,452,000	
	第408回利付国債(2年)	400,000,000	401,824,000	
	第409回利付国債(2年)	180,000,000	180,864,000	
	第410回利付国債(2年)	410,000,000	412,017,200	
	第411回利付国債(2年)	200,000,000	201,032,000	
	第128回利付国債(5年)	320,000,000	320,976,000	
	第129回利付国債(5年)	450,000,000	451,665,000	
	第130回利付国債(5年)	240,000,000	241,051,200	
	第131回利付国債(5年)	360,000,000	361,825,200	
	第132回利付国債(5年)	640,000,000	643,686,400	

第133回利付国債（5年）	1,060,000,000	1,066,847,600	
第134回利付国債（5年）	930,000,000	936,649,500	
第135回利付国債（5年）	830,000,000	836,391,000	
第136回利付国債（5年）	820,000,000	826,748,600	
第137回利付国債（5年）	290,000,000	292,531,700	
第138回利付国債（5年）	600,000,000	605,526,000	
第139回利付国債（5年）	960,000,000	969,264,000	
第140回利付国債（5年）	850,000,000	858,568,000	
第141回利付国債（5年）	440,000,000	444,611,200	
第142回利付国債（5年）	470,000,000	474,991,400	
第143回利付国債（5年）	250,000,000	252,675,000	
第1回利付国債（40年）	40,000,000	60,190,000	
第2回利付国債（40年）	100,000,000	146,730,000	
第3回利付国債（40年）	110,000,000	162,996,900	
第4回利付国債（40年）	150,000,000	224,119,500	
第5回利付国債（40年）	150,000,000	217,471,500	
第6回利付国債（40年）	140,000,000	200,372,200	
第7回利付国債（40年）	160,000,000	220,676,800	
第8回利付国債（40年）	170,000,000	219,629,800	
第9回利付国債（40年）	290,000,000	281,613,200	
第10回利付国債（40年）	260,000,000	295,570,600	
第11回利付国債（40年）	220,000,000	242,930,600	
第12回利付国債（40年）	220,000,000	220,356,400	
第315回利付国債（10年）	295,000,000	299,430,900	
第316回利付国債（10年）	300,000,000	304,176,000	
第317回利付国債（10年）	40,000,000	40,686,000	
第318回利付国債（10年）	366,000,000	371,786,460	
第319回利付国債（10年）	240,000,000	244,903,200	
第320回利付国債（10年）	202,000,000	205,803,660	
第321回利付国債（10年）	241,000,000	246,222,470	
第322回利付国債（10年）	220,000,000	224,360,400	
第323回利付国債（10年）	340,000,000	347,704,400	
第324回利付国債（10年）	183,000,000	186,762,480	
第325回利付国債（10年）	330,000,000	337,566,900	
第326回利付国債（10年）	280,000,000	286,339,200	
第327回利付国債（10年）	387,000,000	396,771,750	
第328回利付国債（10年）	411,000,000	420,025,560	
第329回利付国債（10年）	297,000,000	305,853,570	
第330回利付国債（10年）	257,000,000	265,290,820	
第331回利付国債（10年）	90,000,000	92,297,700	
第332回利付国債（10年）	532,000,000	546,502,320	
第333回利付国債（10年）	225,000,000	231,513,750	

第334回利付国債(10年)	261,000,000	268,999,650
第335回利付国債(10年)	345,000,000	354,646,200
第336回利付国債(10年)	180,000,000	185,238,000
第337回利付国債(10年)	170,000,000	173,335,400
第338回利付国債(10年)	631,000,000	647,122,050
第339回利付国債(10年)	375,000,000	385,083,750
第340回利付国債(10年)	674,000,000	693,027,020
第341回利付国債(10年)	320,000,000	327,657,600
第342回利付国債(10年)	230,000,000	233,042,900
第343回利付国債(10年)	460,000,000	466,348,000
第344回利付国債(10年)	490,000,000	497,046,200
第345回利付国債(10年)	700,000,000	710,465,000
第346回利付国債(10年)	610,000,000	619,247,600
第347回利付国債(10年)	190,000,000	192,988,700
第348回利付国債(10年)	220,000,000	223,502,400
第349回利付国債(10年)	470,000,000	477,552,900
第350回利付国債(10年)	600,000,000	609,480,000
第351回利付国債(10年)	400,000,000	406,192,000
第352回利付国債(10年)	480,000,000	487,252,800
第353回利付国債(10年)	530,000,000	537,552,500
第354回利付国債(10年)	580,000,000	587,980,800
第355回利付国債(10年)	500,000,000	506,385,000
第356回利付国債(10年)	790,000,000	799,614,300
第357回利付国債(10年)	580,000,000	586,403,200
第358回利付国債(10年)	180,000,000	181,859,400
第1回利付国債(30年)	60,000,000	75,837,000
第7回利付国債(30年)	40,000,000	50,529,200
第11回利付国債(30年)	50,000,000	60,065,000
第12回利付国債(30年)	40,000,000	50,268,400
第13回利付国債(30年)	90,000,000	112,177,800
第14回利付国債(30年)	60,000,000	78,195,600
第15回利付国債(30年)	160,000,000	211,444,800
第16回利付国債(30年)	70,000,000	92,835,400
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,782,000
第18回利付国債(30年)	60,000,000	78,270,000
第19回利付国債(30年)	100,000,000	130,857,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	134,237,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	118,397,700
第22回利付国債(30年)	50,000,000	67,499,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	216,689,600
第24回利付国債(30年)	100,000,000	135,753,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	132,870,000
第26回利付国債(30年)	145,000,000	195,529,600

第27回利付国債(30年)	215,000,000	294,917,650	
第28回利付国債(30年)	110,000,000	151,746,100	
第29回利付国債(30年)	70,000,000	95,890,200	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	258,215,700	
第31回利付国債(30年)	130,000,000	175,315,400	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	295,511,050	
第33回利付国債(30年)	280,000,000	370,549,200	
第34回利付国債(30年)	255,000,000	348,993,000	
第35回利付国債(30年)	256,000,000	341,578,240	
第36回利付国債(30年)	285,000,000	381,951,300	
第37回利付国債(30年)	300,000,000	397,179,000	
第38回利付国債(30年)	220,000,000	287,460,800	
第39回利付国債(30年)	170,000,000	226,292,100	
第40回利付国債(30年)	155,000,000	203,279,400	
第41回利付国債(30年)	155,000,000	200,163,900	
第42回利付国債(30年)	170,000,000	219,769,200	
第43回利付国債(30年)	140,000,000	181,385,400	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	233,460,000	
第45回利付国債(30年)	180,000,000	225,338,400	
第46回利付国債(30年)	220,000,000	275,609,400	
第47回利付国債(30年)	250,000,000	319,497,500	
第48回利付国債(30年)	213,000,000	262,311,630	
第49回利付国債(30年)	200,000,000	246,430,000	
第50回利付国債(30年)	210,000,000	228,333,000	
第51回利付国債(30年)	230,000,000	221,943,100	
第52回利付国債(30年)	200,000,000	202,592,000	
第53回利付国債(30年)	190,000,000	197,237,100	
第54回利付国債(30年)	210,000,000	228,419,100	
第55回利付国債(30年)	80,000,000	86,970,400	
第56回利付国債(30年)	220,000,000	239,329,200	
第57回利付国債(30年)	200,000,000	217,446,000	
第58回利付国債(30年)	320,000,000	348,137,600	
第59回利付国債(30年)	190,000,000	201,844,600	
第60回利付国債(30年)	150,000,000	167,176,500	
第61回利付国債(30年)	190,000,000	201,776,200	
第62回利付国債(30年)	190,000,000	191,689,100	
第63回利付国債(30年)	180,000,000	176,549,400	
第64回利付国債(30年)	180,000,000	176,522,400	
第65回利付国債(30年)	160,000,000	156,886,400	
第66回利付国債(30年)	50,000,000	49,019,500	
第51回利付国債(20年)	90,000,000	92,153,700	
第52回利付国債(20年)	190,000,000	195,840,600	

第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,726,200
第54回利付国債(20年)	180,000,000	186,823,800
第55回利付国債(20年)	100,000,000	104,017,000
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,457,400
第57回利付国債(20年)	110,000,000	114,800,400
第58回利付国債(20年)	100,000,000	104,880,000
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,952,400
第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,230,000
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,668,000
第62回利付国債(20年)	80,000,000	82,384,800
第63回利付国債(20年)	60,000,000	63,652,200
第64回利付国債(20年)	120,000,000	128,284,800
第65回利付国債(20年)	380,000,000	408,131,400
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,578,600
第68回利付国債(20年)	90,000,000	98,145,900
第69回利付国債(20年)	60,000,000	65,199,000
第70回利付国債(20年)	110,000,000	121,493,900
第71回利付国債(20年)	100,000,000	109,626,000
第72回利付国債(20年)	210,000,000	230,500,200
第73回利付国債(20年)	180,000,000	197,663,400
第75回利付国債(20年)	100,000,000	110,803,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	109,830,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	22,063,400
第78回利付国債(20年)	50,000,000	55,172,500
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,171,400
第80回利付国債(20年)	90,000,000	100,233,000
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,419,700
第82回利付国債(20年)	170,000,000	190,291,200
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,249,700
第84回利付国債(20年)	120,000,000	134,320,800
第85回利付国債(20年)	150,000,000	169,578,000
第86回利付国債(20年)	100,000,000	114,228,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	102,276,000
第88回利付国債(20年)	185,000,000	212,466,950
第89回利付国債(20年)	120,000,000	137,079,600
第90回利付国債(20年)	170,000,000	195,205,900
第91回利付国債(20年)	80,000,000	92,372,800
第92回利付国債(20年)	215,000,000	246,712,500
第93回利付国債(20年)	80,000,000	91,661,600
第94回利付国債(20年)	140,000,000	161,373,800
第95回利付国債(20年)	185,000,000	216,938,400
第96回利付国債(20年)	70,000,000	81,083,800
第97回利付国債(20年)	130,000,000	152,228,700

第98回利付国債(20年)	70,000,000	81,450,600	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	99,342,900	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	178,365,730	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,940,600	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	174,352,350	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	119,429,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,779,900	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	14,191,080	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	47,639,200	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	94,923,200	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	257,239,400	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	93,848,800	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	232,217,700	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	60,190,500	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	244,911,450	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	101,961,750	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	192,504,000	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	121,276,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	170,385,600	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	271,617,750	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	157,277,290	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	177,064,500	
第120回利付国債(20年)	140,000,000	162,437,800	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	244,776,150	
第122回利付国債(20年)	150,000,000	177,556,500	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	322,915,750	
第124回利付国債(20年)	140,000,000	169,118,600	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	147,970,800	
第126回利付国債(20年)	40,000,000	48,460,400	
第127回利付国債(20年)	70,000,000	84,050,400	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	270,909,000	
第129回利付国債(20年)	150,000,000	178,951,500	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	215,283,600	
第131回利付国債(20年)	120,000,000	142,170,000	
第132回利付国債(20年)	120,000,000	142,490,400	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	293,735,400	
第134回利付国債(20年)	135,000,000	162,229,500	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,599,200	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	94,260,000	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	202,612,800	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	105,114,600	
第139回利付国債(20年)	160,000,000	188,782,400	

	第140回利付国債(20年)	300,000,000	358,302,000
	第141回利付国債(20年)	185,000,000	221,395,050
	第142回利付国債(20年)	170,000,000	205,553,800
	第143回利付国債(20年)	245,000,000	290,660,650
	第144回利付国債(20年)	180,000,000	211,271,400
	第145回利付国債(20年)	335,000,000	402,435,500
	第146回利付国債(20年)	340,000,000	409,200,200
	第147回利付国債(20年)	345,000,000	411,357,300
	第148回利付国債(20年)	365,000,000	430,922,650
	第149回利付国債(20年)	290,000,000	343,072,900
	第150回利付国債(20年)	370,000,000	433,110,900
	第151回利付国債(20年)	425,000,000	485,945,000
	第152回利付国債(20年)	380,000,000	434,758,000
	第153回利付国債(20年)	350,000,000	406,098,000
	第154回利付国債(20年)	288,000,000	330,131,520
	第155回利付国債(20年)	320,000,000	357,356,800
	第156回利付国債(20年)	360,000,000	368,506,800
	第157回利付国債(20年)	240,000,000	237,957,600
	第158回利付国債(20年)	300,000,000	311,286,000
	第159回利付国債(20年)	280,000,000	294,907,200
	第160回利付国債(20年)	280,000,000	299,390,000
	第161回利付国債(20年)	270,000,000	284,091,300
	第162回利付国債(20年)	170,000,000	178,700,600
	第163回利付国債(20年)	270,000,000	283,770,000
	第164回利付国債(20年)	470,000,000	485,500,600
	第165回利付国債(20年)	260,000,000	268,231,600
	第166回利付国債(20年)	400,000,000	426,704,000
	第167回利付国債(20年)	290,000,000	298,897,200
	第168回利付国債(20年)	290,000,000	293,598,900
	第169回利付国債(20年)	250,000,000	248,427,500
	第170回利付国債(20年)	330,000,000	327,604,200
	第171回利付国債(20年)	250,000,000	247,935,000
	第172回利付国債(20年)	90,000,000	90,918,900
	国債証券合計	59,568,000,000	65,011,934,600
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	117,233,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,896,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,445,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,231,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,936,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,679,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,911,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,871,000

	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,116,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,836,000	
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,888,600	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,171,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,289,000	
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,670,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,536,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,340,000	
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,813,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,874,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,961,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,402,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,716,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	119,141,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,285,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,639,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,146,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,607,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,596,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,233,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,827,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,265,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,646,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,263,000	
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,957,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,233,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,089,600	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,975,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,749,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,072,000	
	地方債証券合計	3,830,000,000	3,922,538,200	
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,147,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,321,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,785,000	
	第27回道路債券	100,000,000	109,204,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	117,001,620	
	第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	129,995,930	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,127,000	
	第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,373,000	

	第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	135,255,680	
	第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,501,000	
	第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,902,000	
	第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,203,000	
	第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,634,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	110,618,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	130,009,900	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,959,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,045,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,920,750	
	第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,475,780	
	F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,281,000	
	F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,584,000	
	第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,037,000	
	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	114,853,000	
	第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	97,019,000	96,674,582	
	第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,116,000	
	第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,461,000	
	第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,592,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,681,000	89,918,986	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,850,000	89,841,566	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,957,000	90,821,486	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,468,000	90,456,621	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,776,000	93,580,367	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,640,000	94,992,161	
	第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,948,000	97,297,625	
	第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,521,000	99,532,942	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	69,109,000	69,099,324	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	72,110,000	72,150,381	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	76,241,000	76,337,063	
	第327回信金中金債	100,000,000	100,018,000	
	第340回信金中金債	100,000,000	100,142,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,424,000	
	第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,054,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,032,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,073,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,860,000	
	特殊債券合計	4,514,320,000	4,657,708,764	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,574,000	

第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	99,582,000	
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	98,319,000	
第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,269,000	
第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,573,000	
第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,155,000	
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,832,000	
第12回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,642,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,078,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,656,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,289,000	
第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,457,000	
第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,565,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,704,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,819,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	97,775,000	
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,383,000	
第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	98,546,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,658,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,445,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,628,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,658,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,354,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,168,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,881,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,372,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,015,000	
第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,951,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,616,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,347,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,210,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,727,000	
社債券合計	3,300,000,000	3,299,248,000	
合計		76,891,429,564	

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。

RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	101,032,164
コール・ローン	3,305,925,218
国債証券	137,020,311,908
派生商品評価勘定	221,633,671
未収入金	4,087,114
未収利息	579,394,221
前払費用	379,247,320
流動資産合計	141,611,631,616
資産合計	141,611,631,616
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	553,642,380
未払金	2,479,977,781
未払利息	8,966
その他未払費用	703
流動負債合計	3,033,629,830
負債合計	3,033,629,830
純資産の部	
元本等	
元本	130,639,248,772
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,938,753,014
元本等合計	138,578,001,786
純資産合計	138,578,001,786
負債純資産合計	141,611,631,616

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	73,960,027,701円
期中追加設定元本額	217,278,183,330円
期中一部解約元本額	160,598,962,259円
期末元本額	130,639,248,772円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,075,222,531円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,280,360,862円
りそなラップ型ファンド(成長型)	818,442,994円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	896,067,657円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	174,537,440円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	39,030,271円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	10,915,447円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,837,580円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	402,697円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	75,089円
リスクコントロール・オープン	95,823,583円
FWりそな円建債券アクティブファンド	674,830,118円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	73,211,482,818円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	567,294,158円
Smart-i 8資産バランス 安定型	251,931,071円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	167,718,311円
Smart-i 8資産バランス 成長型	63,419,743円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	4,384,509,952円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	3,954,353,230円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	2,226,824,246円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,607,470,330円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,007,578,669円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,289,919,467円

グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	7,332,358円
りそなD A Aファンド(適格機関投資家専用)	6,718,469,986円
りそなF T R Cバランスファンド(適格機関投資家専用)	111,398,164円
2. 計算日における受益権の総数	130,639,248,772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	1.0608円
(10,000口当たり純資産額)	(10,608円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	<p>国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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）

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		2,901,465,747
合計		2,901,465,747

（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）

（2020年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,430,298,047	-	2,429,922,544	375,503
	米ドル	1,194,141,949	-	1,196,003,538	1,861,589
	メキシコペソ	16,526,166	-	16,789,248	263,082
	ユーロ	975,444,502	-	973,063,816	2,380,686

英ポンド	181,859,546	-	181,654,956	204,590
ポーランドズロチ	9,003,618	-	8,983,850	19,768
オーストラリアドル	53,322,266	-	53,427,136	104,870
売建	137,808,065,134	-	138,139,698,340	331,633,206
米ドル	64,173,419,849	-	64,630,527,600	457,107,751
カナダドル	2,702,246,606	-	2,689,648,640	12,597,966
メキシコペソ	1,034,837,733	-	1,038,224,550	3,386,817
ユーロ	53,797,393,132	-	53,822,233,200	24,840,068
英ポンド	9,350,648,683	-	9,225,006,700	125,641,983
スウェーデンクローナ	387,008,902	-	390,872,070	3,863,168
ノルウェークローネ	329,528,713	-	336,846,720	7,318,007
デンマーククローネ	666,789,764	-	665,228,250	1,561,514
ポーランドズロチ	783,295,428	-	780,550,080	2,745,348
オーストラリアドル	2,830,613,858	-	2,814,692,200	15,921,658
シンガポールドル	635,235,605	-	633,855,450	1,380,155
マレーシアリンギット	578,499,929	-	582,201,200	3,701,271
イスラエルシケル	538,546,932	-	529,811,680	8,735,252
合計	140,238,363,181	-	140,569,620,884	332,008,709

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	2,020,000.00	2,043,947.90	
		US TREASURY N/B	2,920,000.00	2,979,198.32	
		US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,812,490.59	
		US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,783,126.07	
		US TREASURY N/B	3,310,000.00	3,374,066.37	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,316,681.60	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,567,285.00	
		US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,829,796.87	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,524,785.10	
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,407,549.01	
		US TREASURY N/B	2,030,000.00	2,053,709.58	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,058,125.00	
		US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,711,064.96	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,548,720.60	
		US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,237,927.10	
		US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,680,050.58	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,069,492.00	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	3,272,773.59	
		US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,622,678.48	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,350,349.52	
		US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,302,050.70	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,384,319.99	
		US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,480,246.84	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,353,040.91	
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,260,269.43			

US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,289,408.53	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,266,499.84	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,142,904.29	
US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,840,879.84	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,559,326.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,155,859.20	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,403,425.60	
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,553,943.26	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,061,875.00	
US TREASURY N/B	8,260,000.00	8,525,384.71	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,242,249.02	
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,813,383.47	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,826,515.52	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,368,820.14	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,826,902.66	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,119,941.20	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,258,779.57	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,532,113.22	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,837,495.10	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,094,766.61	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,548,574.20	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,203,111.27	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,427,475.74	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,964,421.78	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,275,796.82	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,061,517.16	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,061,777.27	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,840,878.70	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,431,497.51	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,767,445.22	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,979,962.36	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,587,554.15	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,810,823.39	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,552,607.70	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,314,159.71	

US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,891,520.59	
US TREASURY N/B	1,980,000.00	2,052,045.66	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,374,304.37	
US TREASURY N/B	8,900,000.00	9,234,966.63	
US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,564,954.59	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,412,232.45	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,460,760.90	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,642,333.96	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,186,720.68	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,549,804.65	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,385,441.32	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,602,480.45	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,221,670.96	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,506,697.06	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,720,253.86	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,452,925.62	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,109,439.03	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,149,561.59	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,939,781.16	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,617,403.00	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,388,060.88	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,170,546.76	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,584,934.37	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,408,813.31	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,307,721.87	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,244,544.56	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,613,812.28	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,637,519.40	
US TREASURY N/B	2,080,000.00	2,263,787.34	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,582,782.75	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,478,125.00	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,060,549.95	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,934,456.93	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,664,950.69	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,493,571.70	

US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,928,039.04	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,631,556.20	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,739,128.50	
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,517,957.70	
US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,729,243.75	
US TREASURY N/B	2,310,000.00	2,472,692.37	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,621,485.11	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,122,734.20	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,594,815.58	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,124,453.00	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,624,734.61	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,820,984.14	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,583,753.03	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,723,076.46	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,907,595.14	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,631,371.75	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,373,374.72	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,308,201.21	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,408,164.03	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	8,020,671.40	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,199,171.82	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,067,265.60	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,891,006.25	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	8,374,414.53	
US TREASURY N/B	900,000.00	972,246.05	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,568,453.01	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,814,130.63	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,860,972.43	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,995,781.25	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,785,310.81	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,380,528.07	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,544,257.70	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,867,184.14	
US TREASURY N/B	1,390,000.00	1,565,107.33	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	2,019,528.40	

US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,514,101.48	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,380,977.93	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,956,365.49	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,912,566.30	
US TREASURY N/B	3,820,000.00	4,303,468.75	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,285,413.69	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,905,195.27	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,185,025.00	
US TREASURY N/B	4,710,000.00	5,048,714.94	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,873,453.04	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,937,409.92	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,830,546.68	
US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,868,645.63	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,048,300.00	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,727,765.24	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,709,295.09	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,495,203.04	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,743,142.35	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,253,593.60	
US TREASURY N/B	4,470,000.00	4,776,439.06	
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,494,899.47	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,398,415.57	
US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,673,612.97	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,918,129.36	
US TREASURY N/B	4,850,000.00	5,676,962.83	
US TREASURY N/B	4,790,000.00	5,673,156.25	
US TREASURY N/B	220,000.00	308,696.08	
US TREASURY N/B	3,170,000.00	3,768,337.50	
US TREASURY N/B	5,780,000.00	7,016,377.83	
US TREASURY N/B	530,000.00	743,842.54	
US TREASURY N/B	4,660,000.00	5,480,596.64	
US TREASURY N/B	6,360,000.00	7,364,929.60	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,719,945.10	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,096,738.05	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	2,060,869.01	

US TREASURY N/B	780,000.00	1,210,523.41	
US TREASURY N/B	610,000.00	913,760.90	
US TREASURY N/B	540,000.00	836,915.59	
US TREASURY N/B	130,000.00	215,916.79	
US TREASURY N/B	690,000.00	1,086,803.88	
US TREASURY N/B	520,000.00	831,654.66	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,381,800.00	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	2,026,106.25	
US TREASURY N/B	340,000.00	550,215.60	
US TREASURY N/B	600,000.00	959,015.58	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,284,897.58	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,525,232.41	
US TREASURY N/B	580,000.00	877,816.37	
US TREASURY N/B	770,000.00	1,221,893.75	
US TREASURY N/B	480,000.00	775,631.23	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,617,215.54	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,432,275.00	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,849,828.05	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	2,101,703.12	
US TREASURY N/B	940,000.00	1,226,406.25	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,426,210.04	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	3,095,662.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,663,593.60	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,619,655.82	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,433,522.62	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	2,003,613.96	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	3,483,767.78	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	3,137,080.05	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,877,164.00	
US TREASURY N/B	2,580,000.00	3,260,071.74	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,851,093.68	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	4,037,317.46	
US TREASURY N/B	3,320,000.00	4,587,306.07	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,821,047.46	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	3,065,689.41	

	US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,862,042.91
	US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,937,057.72
	US TREASURY N/B	1,740,000.00	2,430,358.57
	US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,459,393.72
	US TREASURY N/B	220,000.00	294,688.26
	US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,595,948.03
	US TREASURY N/B	6,300,000.00	8,835,750.00
	US TREASURY N/B	2,040,000.00	2,928,595.23
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	4,505,374.72
	US TREASURY N/B	2,850,000.00	4,286,689.27
	US TREASURY N/B	3,780,000.00	5,345,451.46
	US TREASURY N/B	3,570,000.00	4,949,051.73
	US TREASURY N/B	3,310,000.00	4,085,781.25
	US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,725,712.81
	US TREASURY N/B	2,560,000.00	3,012,199.93
	米ドル 小計	533,010,000.00	598,964,323.01 (64,346,737,220)
カナダドル	GOV OF CANADA	470,000.00	477,031.20
	GOV OF CANADA	770,000.00	794,763.20
	GOV OF CANADA	690,000.00	700,839.90
	GOV OF CANADA	1,360,000.00	1,369,533.60
	GOV OF CANADA	830,000.00	842,607.70
	GOV OF CANADA	780,000.00	797,105.40
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,185,793.80
	GOV OF CANADA	730,000.00	748,038.30
	GOV OF CANADA	860,000.00	904,143.80
	GOV OF CANADA	2,430,000.00	2,471,941.80
	GOV OF CANADA	1,710,000.00	1,782,811.80
	GOV OF CANADA	790,000.00	820,391.30
	GOV OF CANADA	970,000.00	1,025,416.10
	GOV OF CANADA	840,000.00	902,067.60
	GOV OF CANADA	680,000.00	740,112.00
	GOV OF CANADA	980,000.00	1,029,294.00
	GOV OF CANADA	1,490,000.00	1,554,144.50
	GOV OF CANADA	940,000.00	1,029,422.20

	GOV OF CANADA	750,000.00	755,640.00
	GOV OF CANADA	900,000.00	960,813.00
	GOV OF CANADA	1,530,000.00	1,591,842.60
	GOV OF CANADA	900,000.00	1,010,835.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	514,356.50
	GOV OF CANADA	1,130,000.00	1,309,218.00
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,189,431.60
	GOV OF CANADA	760,000.00	1,240,502.40
	GOV OF CANADA	730,000.00	1,206,398.00
	GOV OF CANADA	870,000.00	1,365,030.00
	GOV OF CANADA	1,130,000.00	1,740,188.70
	GOV OF CANADA	960,000.00	1,357,190.40
	GOV OF CANADA	930,000.00	1,168,619.40
	GOV OF CANADA	310,000.00	496,182.90
	カナダドル 小計	30,860,000.00	35,081,706.70 (2,683,750,562)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	16,910,000.00	17,159,456.32
	UNITED MEXICAN STATE	14,200,000.00	14,675,053.90
	UNITED MEXICAN STATE	19,020,000.00	19,576,890.38
	UNITED MEXICAN STATE	7,550,000.00	7,889,523.50
	UNITED MEXICAN STATE	17,240,000.00	18,887,454.40
	UNITED MEXICAN STATE	13,480,000.00	14,938,131.60
	UNITED MEXICAN STATE	15,970,000.00	19,034,962.40
	UNITED MEXICAN STATE	11,760,000.00	11,912,762.40
	UNITED MEXICAN STATE	19,880,000.00	21,879,530.40
	UNITED MEXICAN STATE	17,810,000.00	20,804,039.10
	UNITED MEXICAN STATE	8,980,000.00	10,016,741.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,560,000.00	8,448,224.40
	UNITED MEXICAN STATE	5,800,000.00	7,711,216.00
	UNITED MEXICAN STATE	11,270,000.00	13,154,456.70
	UNITED MEXICAN STATE	12,310,000.00	13,216,016.00
	UNITED MEXICAN STATE	10,410,000.00	11,494,617.90
	メキシコペソ 小計	210,150,000.00	230,799,076.40 (1,036,287,853)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	1,060,000.00	1,117,966.10
	GOV OF AUSTRIA	580,000.00	628,079.68

GOV OF AUSTRIA	410,000.00	415,944.18	
GOV OF AUSTRIA	700,000.00	771,214.50	
GOV OF AUSTRIA	420,000.00	426,960.66	
GOV OF AUSTRIA	740,000.00	753,118.72	
GOV OF AUSTRIA	770,000.00	831,774.02	
GOV OF AUSTRIA	320,000.00	326,791.57	
GOV OF AUSTRIA	780,000.00	855,429.12	
GOV OF AUSTRIA	750,000.00	816,873.45	
GOV OF AUSTRIA	660,000.00	864,314.88	
GOV OF AUSTRIA	750,000.00	803,865.00	
GOV OF AUSTRIA	460,000.00	486,007.48	
GOV OF AUSTRIA	820,000.00	1,205,436.90	
GOV OF AUSTRIA	560,000.00	603,077.44	
GOV OF AUSTRIA	720,000.00	762,849.36	
GOV OF AUSTRIA	320,000.00	323,866.88	
GOV OF AUSTRIA	520,000.00	690,556.36	
GOV OF AUSTRIA	930,000.00	1,558,828.80	
GOV OF AUSTRIA	510,000.00	866,290.83	
GOV OF AUSTRIA	510,000.00	671,152.35	
GOV OF AUSTRIA	170,000.00	190,602.30	
GOV OF AUSTRIA	320,000.00	735,312.00	
GOV OF AUSTRIA	360,000.00	710,987.04	
GOV OF AUSTRIA	200,000.00	298,938.60	
GOV OF BELGIUM	1,050,000.00	1,118,323.50	
GOV OF BELGIUM	1,000,000.00	1,085,380.00	
GOV OF BELGIUM	1,080,000.00	1,203,915.96	
GOV OF BELGIUM	900,000.00	977,747.19	
GOV OF BELGIUM	710,000.00	726,592.70	
GOV OF BELGIUM	670,000.00	753,580.49	
GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,215,981.00	
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,206,213.48	
GOV OF BELGIUM	690,000.00	884,588.97	
GOV OF BELGIUM	1,080,000.00	1,162,182.60	
GOV OF BELGIUM	1,060,000.00	1,132,825.18	
GOV OF BELGIUM	650,000.00	655,920.20	

GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,633,754.00	
GOV OF BELGIUM	900,000.00	966,207.60	
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,236,263.88	
GOV OF BELGIUM	590,000.00	593,455.68	
GOV OF BELGIUM	580,000.00	636,816.80	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,015,814.80	
GOV OF BELGIUM	480,000.00	543,761.28	
GOV OF BELGIUM	540,000.00	742,455.49	
GOV OF BELGIUM	1,320,000.00	2,212,004.52	
GOV OF BELGIUM	330,000.00	383,633.91	
GOV OF BELGIUM	570,000.00	708,459.84	
GOV OF BELGIUM	490,000.00	471,702.42	
GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	1,974,305.05	
GOV OF BELGIUM	650,000.00	1,117,576.20	
GOV OF BELGIUM	770,000.00	942,973.57	
GOV OF BELGIUM	410,000.00	515,772.62	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	541,996.72	
GOV OF BELGIUM	430,000.00	644,691.26	
GOV OF FINLAND	250,000.00	253,037.00	
GOV OF FINLAND	530,000.00	557,999.90	
GOV OF FINLAND	120,000.00	127,390.92	
GOV OF FINLAND	670,000.00	682,541.06	
GOV OF FINLAND	300,000.00	330,176.13	
GOV OF FINLAND	100,000.00	102,157.80	
GOV OF FINLAND	420,000.00	517,758.19	
GOV OF FINLAND	250,000.00	267,626.00	
GOV OF FINLAND	510,000.00	537,526.01	
GOV OF FINLAND	390,000.00	412,716.33	
GOV OF FINLAND	430,000.00	535,363.33	
GOV OF FINLAND	210,000.00	222,627.30	
GOV OF FINLAND	350,000.00	371,234.85	
GOV OF FINLAND	320,000.00	349,843.67	
GOV OF FINLAND	300,000.00	345,297.60	
GOV OF FINLAND	190,000.00	190,807.88	
GOV OF FINLAND	290,000.00	445,522.94	

GOV OF FINLAND	260,000.00	338,323.01	
GOV OF FRANCE	1,670,000.00	1,678,268.17	
GOV OF FRANCE	2,150,000.00	2,266,745.00	
GOV OF FRANCE	2,090,000.00	2,110,509.79	
GOV OF FRANCE	3,580,000.00	3,827,234.80	
GOV OF FRANCE	2,410,000.00	2,436,799.20	
GOV OF FRANCE	2,200,000.00	2,351,913.95	
GOV OF FRANCE	2,000,000.00	2,030,038.00	
GOV OF FRANCE	1,820,000.00	1,848,202.35	
GOV OF FRANCE	3,960,000.00	4,238,859.62	
GOV OF FRANCE	2,020,000.00	2,357,089.52	
GOV OF FRANCE	2,700,000.00	2,751,782.76	
GOV OF FRANCE	2,620,000.00	2,912,258.38	
GOV OF FRANCE	2,580,000.00	2,840,489.70	
GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,163,105.96	
GOV OF FRANCE	2,310,000.00	2,418,315.90	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,065,898.32	
GOV OF FRANCE	2,040,000.00	2,195,556.12	
GOV OF FRANCE	1,470,000.00	1,496,915.70	
GOV OF FRANCE	2,080,000.00	2,557,817.60	
GOV OF FRANCE	2,330,000.00	2,446,500.00	
GOV OF FRANCE	2,290,000.00	2,368,473.72	
GOV OF FRANCE	3,370,000.00	3,662,280.10	
GOV OF FRANCE	2,980,000.00	3,644,569.80	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	2,436,640.70	
GOV OF FRANCE	1,600,000.00	1,720,230.40	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,174,310.40	
GOV OF FRANCE	2,050,000.00	2,159,023.10	
GOV OF FRANCE	2,520,000.00	2,529,500.40	
GOV OF FRANCE	2,710,000.00	3,395,933.52	
GOV OF FRANCE	2,810,000.00	3,260,864.50	
GOV OF FRANCE	2,450,000.00	4,157,373.15	
GOV OF FRANCE	2,220,000.00	2,530,433.70	
GOV OF FRANCE	1,940,000.00	3,222,017.96	
GOV OF FRANCE	2,370,000.00	2,710,787.04	

GOV OF FRANCE	1,660,000.00	2,724,455.08
GOV OF FRANCE	1,910,000.00	2,375,560.59
GOV OF FRANCE	2,360,000.00	4,252,484.00
GOV OF FRANCE	1,850,000.00	2,995,834.50
GOV OF FRANCE	1,690,000.00	2,271,060.87
GOV OF FRANCE	1,760,000.00	2,151,740.80
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,082,093.14
GOV OF FRANCE	870,000.00	1,750,670.55
GOV OF FRANCE	980,000.00	2,075,579.24
GOV OF FRANCE	850,000.00	1,172,629.40
GOV OF GERMANY	1,000,000.00	1,006,840.00
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	1,096,327.05
GOV OF GERMANY	800,000.00	830,353.04
GOV OF GERMANY	1,110,000.00	1,119,967.57
GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,897,785.74
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,163,198.78
GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,463,260.96
GOV OF GERMANY	1,940,000.00	1,966,678.88
GOV OF GERMANY	670,000.00	679,403.45
GOV OF GERMANY	960,000.00	1,011,532.80
GOV OF GERMANY	2,280,000.00	2,400,181.08
GOV OF GERMANY	1,470,000.00	1,496,674.62
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	2,041,789.44
GOV OF GERMANY	480,000.00	490,904.16
GOV OF GERMANY	1,340,000.00	1,432,439.90
GOV OF GERMANY	1,980,000.00	2,160,910.62
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	1,119,238.16
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,214,475.50
GOV OF GERMANY	2,010,000.00	2,070,597.48
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,201,659.80
GOV OF GERMANY	1,340,000.00	1,442,424.24
GOV OF GERMANY	1,270,000.00	1,313,096.18
GOV OF GERMANY	3,050,000.00	3,235,665.70
GOV OF GERMANY	490,000.00	508,085.90
GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,749,630.40

GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,477,165.46	
GOV OF GERMANY	1,720,000.00	1,798,356.32	
GOV OF GERMANY	2,360,000.00	2,514,167.00	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,538,124.45	
GOV OF GERMANY	1,540,000.00	1,673,864.50	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,935,605.10	
GOV OF GERMANY	2,160,000.00	2,356,994.16	
GOV OF GERMANY	930,000.00	1,344,430.32	
GOV OF GERMANY	1,800,000.00	1,933,376.40	
GOV OF GERMANY	1,720,000.00	1,851,621.28	
GOV OF GERMANY	2,160,000.00	2,275,912.08	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,238,062.92	
GOV OF GERMANY	860,000.00	906,033.22	
GOV OF GERMANY	1,450,000.00	2,403,029.90	
GOV OF GERMANY	1,660,000.00	2,908,276.84	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	3,223,967.25	
GOV OF GERMANY	1,280,000.00	2,420,226.56	
GOV OF GERMANY	1,640,000.00	3,345,073.56	
GOV OF GERMANY	1,160,000.00	2,074,254.00	
GOV OF GERMANY	1,940,000.00	3,231,458.00	
GOV OF GERMANY	2,220,000.00	3,797,660.76	
GOV OF GERMANY	1,360,000.00	1,896,400.32	
GOV OF GERMANY	510,000.00	525,574.89	
GOV OF IRELAND	460,000.00	470,601.70	
GOV OF IRELAND	440,000.00	444,388.56	
GOV OF IRELAND	380,000.00	426,370.70	
GOV OF IRELAND	550,000.00	628,651.75	
GOV OF IRELAND	770,000.00	980,032.13	
GOV OF IRELAND	760,000.00	811,304.56	
GOV OF IRELAND	450,000.00	457,398.22	
GOV OF IRELAND	500,000.00	535,451.78	
GOV OF IRELAND	580,000.00	633,155.26	
GOV OF IRELAND	600,000.00	733,858.80	
GOV OF IRELAND	410,000.00	460,076.58	
GOV OF IRELAND	260,000.00	291,954.93	

GOV OF IRELAND	310,000.00	307,721.50	
GOV OF IRELAND	370,000.00	441,269.03	
GOV OF IRELAND	590,000.00	770,929.99	
GOV OF IRELAND	270,000.00	319,437.54	
GOV OF ITALY	810,000.00	836,892.81	
GOV OF ITALY	820,000.00	821,317.90	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	1,815,689.27	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	1,661,326.20	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,575,183.14	
GOV OF ITALY	2,940,000.00	3,014,011.56	
GOV OF ITALY	690,000.00	743,769.63	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,151,376.06	
GOV OF ITALY	810,000.00	820,257.03	
GOV OF ITALY	1,030,000.00	1,036,848.67	
GOV OF ITALY	950,000.00	954,041.30	
GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,118,391.48	
GOV OF ITALY	1,450,000.00	1,473,919.20	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,626,714.48	
GOV OF ITALY	490,000.00	480,473.42	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,605,113.60	
GOV OF ITALY	1,470,000.00	1,474,490.85	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,547,729.40	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,724,783.70	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,241,938.00	
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,217,611.40	
GOV OF ITALY	1,050,000.00	1,040,831.40	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,418,904.90	
GOV OF ITALY	720,000.00	740,640.60	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,027,147.76	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,338,616.95	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,152,716.70	
GOV OF ITALY	750,000.00	792,069.00	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,698,532.71	
GOV OF ITALY	1,510,000.00	1,770,970.28	
GOV OF ITALY	1,190,000.00	1,198,514.45	

GOV OF ITALY	1,430,000.00	1,443,148.85	
GOV OF ITALY	800,000.00	819,471.28	
GOV OF ITALY	1,090,000.00	1,153,888.06	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,735,772.64	
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,427,452.46	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,563,743.85	
GOV OF ITALY	1,190,000.00	1,232,696.01	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,295,955.90	
GOV OF ITALY	550,000.00	526,291.91	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,394,184.24	
GOV OF ITALY	1,420,000.00	1,462,938.10	
GOV OF ITALY	1,780,000.00	2,378,962.70	
GOV OF ITALY	1,310,000.00	1,344,363.92	
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,850,559.00	
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,617,097.00	
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,642,643.05	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,451,348.90	
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,708,486.15	
GOV OF ITALY	1,840,000.00	1,764,837.84	
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,065,885.02	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	2,276,280.33	
GOV OF ITALY	1,750,000.00	1,696,476.25	
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,630,380.00	
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,228,549.92	
GOV OF ITALY	1,060,000.00	1,422,082.75	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	1,797,023.57	
GOV OF ITALY	810,000.00	732,730.86	
GOV OF ITALY	1,000,000.00	1,003,955.89	
GOV OF ITALY	1,930,000.00	2,368,060.59	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,331,093.70	
GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,793,229.00	
GOV OF ITALY	910,000.00	1,000,529.34	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	2,159,120.55	
GOV OF ITALY	1,050,000.00	1,444,424.10	
GOV OF ITALY	1,040,000.00	1,161,546.88	

GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,184,102.48	
GOV OF ITALY	1,080,000.00	1,247,107.32	
GOV OF ITALY	870,000.00	1,074,338.90	
GOV OF ITALY	990,000.00	950,431.68	
GOV OF ITALY	590,000.00	592,511.86	
GOV OF NETHERLANDS	930,000.00	971,115.30	
GOV OF NETHERLANDS	1,310,000.00	1,323,908.27	
GOV OF NETHERLANDS	930,000.00	989,344.49	
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,163,690.42	
GOV OF NETHERLANDS	1,000,000.00	1,076,944.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,320,521.40	
GOV OF NETHERLANDS	1,060,000.00	1,177,697.31	
GOV OF NETHERLANDS	1,030,000.00	1,074,854.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,191,538.88	
GOV OF NETHERLANDS	900,000.00	979,345.44	
GOV OF NETHERLANDS	990,000.00	1,446,035.58	
GOV OF NETHERLANDS	880,000.00	963,996.00	
GOV OF NETHERLANDS	750,000.00	790,791.36	
GOV OF NETHERLANDS	430,000.00	442,121.70	
GOV OF NETHERLANDS	1,030,000.00	1,387,373.95	
GOV OF NETHERLANDS	960,000.00	1,624,341.12	
GOV OF NETHERLANDS	710,000.00	787,328.94	
GOV OF NETHERLANDS	1,130,000.00	2,064,891.94	
GOV OF NETHERLANDS	960,000.00	1,664,420.43	
GOV OF SPAIN	2,290,000.00	2,320,617.30	
GOV OF SPAIN	3,080,000.00	3,096,247.00	
GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,270,768.40	
GOV OF SPAIN	1,760,000.00	1,783,327.39	
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,325,432.08	
GOV OF SPAIN	1,010,000.00	1,012,649.23	
GOV OF SPAIN	960,000.00	973,263.36	
GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,501,325.80	
GOV OF SPAIN	1,680,000.00	1,979,960.13	
GOV OF SPAIN	1,420,000.00	1,632,193.29	
GOV OF SPAIN	700,000.00	705,950.00	

	GOV OF SPAIN	1,140,000.00	1,275,230.32	
	GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,291,576.00	
	GOV OF SPAIN	1,620,000.00	1,735,320.83	
	GOV OF SPAIN	1,840,000.00	2,265,034.48	
	GOV OF SPAIN	1,530,000.00	1,689,256.17	
	GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,415,687.28	
	GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,385,636.10	
	GOV OF SPAIN	1,660,000.00	1,760,469.84	
	GOV OF SPAIN	950,000.00	1,020,284.80	
	GOV OF SPAIN	1,000,000.00	1,023,079.00	
	GOV OF SPAIN	1,670,000.00	1,784,827.53	
	GOV OF SPAIN	1,900,000.00	2,023,813.50	
	GOV OF SPAIN	1,450,000.00	1,545,209.90	
	GOV OF SPAIN	1,430,000.00	1,964,990.17	
	GOV OF SPAIN	1,230,000.00	1,786,700.46	
	GOV OF SPAIN	1,350,000.00	1,442,192.85	
	GOV OF SPAIN	1,340,000.00	1,328,533.62	
	GOV OF SPAIN	1,000,000.00	976,203.00	
	GOV OF SPAIN	1,610,000.00	1,797,024.04	
	GOV OF SPAIN	1,500,000.00	1,564,804.50	
	GOV OF SPAIN	1,300,000.00	2,031,311.10	
	GOV OF SPAIN	1,340,000.00	1,565,714.96	
	GOV OF SPAIN	1,100,000.00	1,213,546.40	
	GOV OF SPAIN	1,360,000.00	1,988,936.08	
	GOV OF SPAIN	1,290,000.00	2,114,417.07	
	GOV OF SPAIN	1,240,000.00	2,010,064.80	
	GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,851,948.00	
	GOV OF SPAIN	1,260,000.00	1,646,754.48	
	GOV OF SPAIN	950,000.00	1,208,459.85	
	GOV OF SPAIN	530,000.00	459,835.73	
	GOV OF SPAIN	750,000.00	1,164,466.50	
	ユーロ 小計	389,650,000.00	457,091,143.33 (53,059,139,917)	
英ポンド	UK TREASURY	890,000.00	933,192.05	
	UK TREASURY	1,900,000.00	2,038,508.86	

UK TREASURY	1,570,000.00	1,588,400.40
UK TREASURY	1,640,000.00	1,706,914.95
UK TREASURY	550,000.00	551,056.00
UK TREASURY	1,680,000.00	1,720,051.20
UK TREASURY	1,260,000.00	1,354,004.69
UK TREASURY	1,680,000.00	1,745,184.00
UK TREASURY	1,020,000.00	1,140,171.50
UK TREASURY	780,000.00	965,466.84
UK TREASURY	1,320,000.00	1,358,036.58
UK TREASURY	1,250,000.00	1,383,462.50
UK TREASURY	1,010,000.00	1,101,703.75
UK TREASURY	1,300,000.00	1,410,084.00
UK TREASURY	650,000.00	852,285.71
UK TREASURY	1,320,000.00	1,488,432.00
UK TREASURY	950,000.00	1,424,512.08
UK TREASURY	1,590,000.00	1,694,669.70
UK TREASURY	1,380,000.00	2,034,508.04
UK TREASURY	990,000.00	1,448,419.50
UK TREASURY	1,050,000.00	1,644,283.82
UK TREASURY	1,200,000.00	1,890,165.60
UK TREASURY	1,700,000.00	2,041,814.24
UK TREASURY	1,140,000.00	1,992,976.72
UK TREASURY	1,080,000.00	1,813,012.41
UK TREASURY	1,080,000.00	1,851,945.98
UK TREASURY	440,000.00	497,692.80
UK TREASURY	1,260,000.00	2,303,015.40
UK TREASURY	1,570,000.00	2,484,327.80
UK TREASURY	1,370,000.00	2,278,170.26
UK TREASURY	1,220,000.00	2,310,619.00
UK TREASURY	1,430,000.00	1,757,598.70
UK TREASURY	980,000.00	1,279,821.20
UK TREASURY	990,000.00	1,973,258.10
UK TREASURY	1,190,000.00	2,315,719.05
UK TREASURY	330,000.00	442,546.50
UK TREASURY	1,290,000.00	2,849,094.00

	UK TREASURY	1,220,000.00	1,736,853.00	
	UK TREASURY	1,060,000.00	2,407,737.00	
	UK TREASURY	1,110,000.00	2,027,781.30	
	UK TREASURY	1,160,000.00	2,687,360.40	
	UK TREASURY	720,000.00	1,132,911.36	
	英ポンド 小計	49,320,000.00	69,657,768.99 (9,148,154,801)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	6,930,000.00	7,480,442.97	
	GOV OF SWEDEN	5,750,000.00	6,127,198.85	
	GOV OF SWEDEN	4,800,000.00	5,484,508.80	
	GOV OF SWEDEN	3,610,000.00	3,911,380.85	
	GOV OF SWEDEN	3,560,000.00	3,829,948.03	
	GOV OF SWEDEN	3,070,000.00	3,317,073.60	
	GOV OF SWEDEN	3,150,000.00	4,981,184.45	
	スウェーデンクローナ 小計	30,870,000.00	35,131,737.55 (385,395,160)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	5,400,000.00	5,607,900.00	
	GOV OF NORWAY	5,200,000.00	5,522,608.00	
	GOV OF NORWAY	4,370,000.00	4,880,328.60	
	GOV OF NORWAY	2,340,000.00	2,536,813.65	
	GOV OF NORWAY	2,850,000.00	3,089,172.00	
	GOV OF NORWAY	2,650,000.00	2,940,164.93	
	GOV OF NORWAY	2,030,000.00	2,317,448.00	
	GOV OF NORWAY	2,720,000.00	3,090,042.40	
	GOV OF NORWAY	1,650,000.00	1,824,528.75	
	ノルウェークローネ 小計	29,210,000.00	31,809,006.33 (336,857,377)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	4,590,000.00	4,834,523.52	
	GOV OF DENMARK	1,390,000.00	1,417,990.84	
	GOV OF DENMARK	3,640,000.00	3,907,680.14	
	GOV OF DENMARK	4,580,000.00	5,160,537.90	
	GOV OF DENMARK	5,310,000.00	5,682,432.78	
	GOV OF DENMARK	4,590,000.00	4,952,632.95	
	GOV OF DENMARK	8,540,000.00	16,108,212.03	
	デンマーククローネ 小計	32,640,000.00	42,064,010.16 (654,936,638)	

ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,050,000.00	1,046,856.72
	GOV OF POLAND	2,480,000.00	2,518,730.40
	GOV OF POLAND	1,110,000.00	1,194,482.10
	GOV OF POLAND	2,040,000.00	2,109,797.17
	GOV OF POLAND	1,750,000.00	1,719,726.22
	GOV OF POLAND	1,240,000.00	1,390,994.80
	GOV OF POLAND	1,420,000.00	1,494,140.46
	GOV OF POLAND	1,960,000.00	2,185,733.20
	GOV OF POLAND	1,930,000.00	2,067,750.27
	GOV OF POLAND	1,600,000.00	1,705,099.99
	GOV OF POLAND	1,710,000.00	1,916,379.90
	GOV OF POLAND	3,010,000.00	3,279,855.81
	GOV OF POLAND	1,960,000.00	2,147,681.15
	GOV OF POLAND	2,210,000.00	2,461,940.00
	GOV OF POLAND	540,000.00	745,929.00
	GOV OF POLAND	2,240,000.00	2,535,345.34
ポーランドズロチ 小計		28,250,000.00	30,520,442.53 (777,050,466)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,180,000.00	1,244,237.77
	GOV OF AUSTRALIA	1,540,000.00	1,582,692.79
	GOV OF AUSTRALIA	1,650,000.00	1,845,364.95
	GOV OF AUSTRALIA	1,950,000.00	2,048,780.36
	GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	2,018,652.12
	GOV OF AUSTRALIA	1,910,000.00	2,093,587.67
	GOV OF AUSTRALIA	1,050,000.00	1,045,831.92
	GOV OF AUSTRALIA	1,780,000.00	2,030,270.84
	GOV OF AUSTRALIA	2,280,000.00	2,782,661.34
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,485,574.94
	GOV OF AUSTRALIA	1,930,000.00	2,221,690.73
	GOV OF AUSTRALIA	1,820,000.00	2,032,149.74
	GOV OF AUSTRALIA	1,780,000.00	2,066,835.43
	GOV OF AUSTRALIA	2,140,000.00	2,585,748.51
	GOV OF AUSTRALIA	1,700,000.00	1,992,198.54
	GOV OF AUSTRALIA	2,030,000.00	2,340,359.79
GOV OF AUSTRALIA	1,320,000.00	1,393,946.52	

	GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	831,950.59
	GOV OF AUSTRALIA	1,080,000.00	1,530,657.32
	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	661,918.61
	GOV OF AUSTRALIA	770,000.00	1,040,257.60
	GOV OF AUSTRALIA	630,000.00	806,711.34
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	478,769.43
	GOV OF AUSTRALIA	850,000.00	1,077,672.66
	オーストラリアドル 小計	34,840,000.00	40,238,521.51 (2,794,565,318)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	600,000.00	613,260.04
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	426,274.71
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	514,055.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	372,925.00
	GOV OF SINGAPORE	400,000.00	415,760.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	376,390.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	307,545.00
	GOV OF SINGAPORE	560,000.00	621,955.60
	GOV OF SINGAPORE	230,000.00	251,965.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	591,570.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	393,360.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	403,550.00
	GOV OF SINGAPORE	520,000.00	618,079.80
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	228,380.00
	GOV OF SINGAPORE	440,000.00	572,657.80
	GOV OF SINGAPORE	250,000.00	293,250.00
	GOV OF SINGAPORE	170,000.00	206,971.60
	GOV OF SINGAPORE	320,000.00	421,280.00
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	568,680.00
	GOV OF SINGAPORE	200,000.00	239,148.00
	シンガポールドル 小計	7,430,000.00	8,437,057.55 (636,744,733)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	695,708.68
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	881,649.12
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,205,695.32
	GOV OF MALAYSIA	480,000.00	494,174.78
	GOV OF MALAYSIA	660,000.00	676,446.34

	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	982,764.26	
	GOV OF MALAYSIA	540,000.00	557,451.39	
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	633,928.28	
	GOV OF MALAYSIA	600,000.00	626,669.52	
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	789,805.90	
	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	597,638.32	
	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	713,071.21	
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	371,023.06	
	GOV OF MALAYSIA	1,080,000.00	1,155,756.49	
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	338,645.11	
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	949,984.66	
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,075,877.14	
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	512,805.48	
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,448,729.01	
	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	823,592.40	
	GOV OF MALAYSIA	1,300,000.00	1,404,315.77	
	GOV OF MALAYSIA	630,000.00	706,924.19	
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	895,549.77	
	GOV OF MALAYSIA	710,000.00	756,322.95	
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,256,900.37	
	GOV OF MALAYSIA	800,000.00	858,175.04	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	299,986.22	
	GOV OF MALAYSIA	650,000.00	765,736.07	
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	881,502.87	
	GOV OF MALAYSIA	540,000.00	649,748.25	
	GOV OF MALAYSIA	590,000.00	696,541.61	
	GOV OF MALAYSIA	640,000.00	760,217.92	
	マレーシアリングット 小計	23,590,000.00	25,463,337.50	(629,453,703)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,900,000.00	2,106,150.00	
	GOV OF ISRAEL	800,000.00	815,120.00	
	GOV OF ISRAEL	1,000,000.00	1,032,500.00	
	GOV OF ISRAEL	1,200,000.00	1,344,420.00	
	GOV OF ISRAEL	1,110,000.00	1,165,444.50	
	GOV OF ISRAEL	1,100,000.00	1,251,085.00	

	GOV OF ISRAEL	1,400,000.00	1,514,730.00	
	GOV OF ISRAEL	1,100,000.00	1,538,515.00	
	GOV OF ISRAEL	1,100,000.00	1,210,495.00	
	GOV OF ISRAEL	1,060,000.00	1,212,958.00	
	GOV OF ISRAEL	500,000.00	513,425.00	
	GOV OF ISRAEL	1,300,000.00	2,296,645.00	
	GOV OF ISRAEL	1,050,000.00	1,519,560.00	
	イスラエルシュケル 小計	14,620,000.00	17,521,047.50	(531,238,160)
	合計		137,020,311,908	(137,020,311,908)

(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 215銘柄	100.0%	46.9%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 313銘柄	100.0%	38.6%
英ポンド	国債証券 42銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券 20銘柄	100.0%	0.5%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	263,188,057
株式	18,120,020,330
派生商品評価勘定	25,391,850
未収入金	187,763
未収配当金	213,353,747
差入委託証拠金	20,790,000
流動資産合計	18,642,931,747
資産合計	
18,642,931,747	
負債の部	
流動負債	
前受金	18,810,000
未払解約金	1,106,000
未払利息	713
その他未払費用	764
流動負債合計	19,917,477
負債合計	
19,917,477	
純資産の部	
元本等	
元本	18,083,758,214
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	539,256,056
元本等合計	18,623,014,270
純資産合計	
18,623,014,270	
負債純資産合計	
18,642,931,747	

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p>
---------------	--

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	24,897,863,945円
期中追加設定元本額	29,947,337,924円
期中一部解約元本額	36,761,443,655円
期末元本額	18,083,758,214円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,095,992,935円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	864,628,008円
りそなラップ型ファンド(成長型)	894,910,841円
DCりそな グローバルバランス	20,178,223円
つみたてバランスファンド	1,825,867,127円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	613,211,373円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	293,552,458円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	168,006,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	12,432,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,025,602円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,632,789円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,696,171円
リスクコントロール・オープン	1,788,918円
FWりそな国内株式アクティブファンド	64,721,878円
FWりそな国内株式インデックスファンド	9,040,977,010円
Smart-i TOPIXインデックス	745,428,014円
Smart-i 8資産バランス 安定型	74,128,849円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	211,602,313円
Smart-i 8資産バランス 成長型	238,979,259円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	81,836,054円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	73,807,173円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	41,563,101円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	30,003,146円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	149,452,585円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,269,248円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	532,188,406円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	436,226,620円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	537,468,539円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	16,182,963円

2. 計算日における受益権の総数	18,083,758,214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	1.0298円
(10,000口当たり純資産額)	(10,298円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式

(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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 5月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,241,807,731
合計		2,241,807,731

(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）

（2020年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	454,758,150	-	480,150,000	25,391,850
合計		454,758,150	-	480,150,000	25,391,850

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	400	2,686.00	1,074,400	
日本水産	12,000	446.00	5,352,000	
マルハニチロ	1,700	2,171.00	3,690,700	
カネコ種苗	400	1,480.00	592,000	
サカタのタネ	1,400	3,735.00	5,229,000	
ホクト	900	1,959.00	1,763,100	
ホクリヨウ	200	650.00	130,000	
住石ホールディングス	2,300	112.00	257,600	
日鉄鉱業	300	4,590.00	1,377,000	
三井松島ホールディングス	500	810.00	405,000	
国際石油開発帝石	48,300	682.00	32,940,600	
石油資源開発	1,600	1,927.00	3,083,200	
K&Oエナジーグループ	600	1,565.00	939,000	
ヒノキヤグループ	300	1,570.00	471,000	
ショーボンドホールディングス	1,900	4,565.00	8,673,500	
ミライト・ホールディングス	3,600	1,458.00	5,248,800	
タマホーム	600	1,341.00	804,600	
サンヨーホームズ	100	612.00	61,200	
日本アクア	500	588.00	294,000	
ファーストコーポレーション	400	495.00	198,000	
ベステラ	200	979.00	195,800	
TATERU	2,400	152.00	364,800	
キャンディル	200	474.00	94,800	
スペースバリューホールディングス	1,500	351.00	526,500	
ダイセキ環境ソリューション	200	1,015.00	203,000	
第一カッター興業	100	1,748.00	174,800	
明豊ファシリティワークス	400	588.00	235,200	
安藤・間	7,200	649.00	4,672,800	
東急建設	3,500	554.00	1,939,000	
コムシスホールディングス	4,300	3,020.00	12,986,000	
ビーアールホールディングス	1,300	510.00	663,000	
高松コンストラクショングループ	700	2,214.00	1,549,800	
東建コーポレーション	400	7,230.00	2,892,000	
ソネック	100	785.00	78,500	

ヤマウラ	500	757.00	378,500
大成建設	9,300	3,530.00	32,829,000
大林組	27,800	910.00	25,298,000
清水建設	28,200	845.00	23,829,000
飛鳥建設	800	1,047.00	837,600
長谷工コーポレーション	10,800	1,150.00	12,420,000
松井建設	1,100	621.00	683,100
銭高組	100	3,655.00	365,500
鹿島建設	21,800	1,185.00	25,833,000
不動テトラ	700	1,308.00	915,600
大末建設	300	735.00	220,500
鉄建建設	600	2,134.00	1,280,400
西松建設	2,100	2,057.00	4,319,700
三井住友建設	6,700	425.00	2,847,500
大豊建設	600	2,411.00	1,446,600
前田建設工業	7,000	826.00	5,782,000
佐田建設	600	399.00	239,400
ナカノフドー建設	800	367.00	293,600
奥村組	1,500	2,414.00	3,621,000
東鉄工業	1,200	2,727.00	3,272,400
イチケン	200	1,218.00	243,600
富士ピー・エス	400	516.00	206,400
浅沼組	300	3,675.00	1,102,500
戸田建設	11,500	629.00	7,233,500
熊谷組	1,300	2,413.00	3,136,900
北野建設	200	2,568.00	513,600
植木組	100	2,394.00	239,400
矢作建設工業	1,200	737.00	884,400
ピーエス三菱	900	521.00	468,900
日本ハウスホールディングス	1,900	278.00	528,200
大東建託	3,000	10,405.00	31,215,000
新日本建設	1,200	698.00	837,600
N I P P O	2,300	2,466.00	5,671,800
東亜道路工業	200	3,075.00	615,000
前田道路	2,500	1,822.00	4,555,000
日本道路	300	6,710.00	2,013,000
東亜建設工業	900	1,475.00	1,327,500
日本国土開発	2,700	555.00	1,498,500
若築建設	500	1,106.00	553,000
東洋建設	3,100	410.00	1,271,000
五洋建設	11,000	539.00	5,929,000
世紀東急工業	1,300	749.00	973,700

福田組	300	4,550.00	1,365,000
住友林業	7,000	1,202.00	8,414,000
日本基礎技術	900	417.00	375,300
巴コーポレーション	1,200	344.00	412,800
大和ハウス工業	27,500	2,390.00	65,725,000
ライト工業	1,600	1,402.00	2,243,200
積水ハウス	30,400	1,803.00	54,811,200
日特建設	700	685.00	479,500
北陸電気工事	500	893.00	446,500
ユアテック	1,600	584.00	934,400
日本リーテック	600	1,952.00	1,171,200
四電工	200	2,300.00	460,000
中電工	1,100	2,203.00	2,423,300
関電工	4,000	906.00	3,624,000
きんでん	6,600	1,719.00	11,345,400
東京エネシス	900	741.00	666,900
トーエネック	300	3,330.00	999,000
住友電設	800	2,445.00	1,956,000
日本電設工業	1,500	2,232.00	3,348,000
協和エクシオ	4,200	2,514.00	10,558,800
新日本空調	700	2,300.00	1,610,000
九電工	2,000	2,915.00	5,830,000
三機工業	2,000	1,230.00	2,460,000
日揮ホールディングス	8,600	1,012.00	8,703,200
中外炉工業	300	1,538.00	461,400
ヤマト	900	624.00	561,600
太平電業	700	2,357.00	1,649,900
高砂熱学工業	2,400	1,658.00	3,979,200
三晃金属工業	100	2,098.00	209,800
朝日工業社	200	2,989.00	597,800
明星工業	1,800	733.00	1,319,400
大気社	1,400	2,997.00	4,195,800
ダイダン	700	2,748.00	1,923,600
日比谷総合設備	900	1,827.00	1,644,300
フィル・カンパニー	200	2,728.00	545,600
OSJBホールディングス	4,400	246.00	1,082,400
東洋エンジニアリング	1,200	362.00	434,400
レイズネクスト	1,500	1,179.00	1,768,500
日本製粉	2,600	1,597.00	4,152,200
日清製粉グループ本社	10,100	1,558.00	15,735,800
日東富士製粉	100	6,020.00	602,000
昭和産業	800	3,170.00	2,536,000

鳥越製粉	800	869.00	695,200
中部飼料	1,100	1,537.00	1,690,700
フィード・ワン	5,900	186.00	1,097,400
東洋精糖	200	1,210.00	242,000
日本甜菜製糖	500	1,637.00	818,500
三井製糖	800	2,194.00	1,755,200
塩水港精糖	900	205.00	184,500
日新製糖	400	1,918.00	767,200
森永製菓	2,100	4,280.00	8,988,000
中村屋	200	4,000.00	800,000
江崎グリコ	2,600	5,100.00	13,260,000
名糖産業	400	1,269.00	507,600
井村屋グループ	500	1,933.00	966,500
不二家	500	2,038.00	1,019,000
山崎製パン	6,700	1,893.00	12,683,100
第一屋製パン	200	940.00	188,000
モロゾフ	200	5,770.00	1,154,000
亀田製菓	500	5,340.00	2,670,000
寿スピリッツ	900	4,780.00	4,302,000
カルビー	4,100	2,943.00	12,066,300
森永乳業	1,600	4,520.00	7,232,000
六甲バター	600	1,426.00	855,600
ヤクルト本社	6,100	6,380.00	38,918,000
明治ホールディングス	5,900	7,660.00	45,194,000
雪印メグミルク	2,100	2,592.00	5,443,200
プリマハム	1,400	2,389.00	3,344,600
日本ハム	3,400	3,665.00	12,461,000
林兼産業	300	578.00	173,400
丸大食品	900	2,001.00	1,800,900
S Foods	700	2,356.00	1,649,200
柿安本店	300	2,397.00	719,100
伊藤ハム米久ホールディングス	5,700	631.00	3,596,700
サッポロホールディングス	3,000	1,922.00	5,766,000
アサヒグループホールディングス	18,600	3,645.00	67,797,000
キリンホールディングス	37,700	1,998.00	75,324,600
宝ホールディングス	6,600	763.00	5,035,800
オエノンホールディングス	2,300	389.00	894,700
養命酒製造	300	1,903.00	570,900
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	6,200	1,865.00	11,563,000
サントリー食品インターナショナル	6,000	4,080.00	24,480,000
ダイドーグループホールディングス	500	4,680.00	2,340,000
伊藤園	2,700	6,060.00	16,362,000

キーコーヒー	900	2,308.00	2,077,200
ユニカフェ	200	938.00	187,600
ジャパンフーズ	100	1,154.00	115,400
日清オイリオグループ	1,100	3,285.00	3,613,500
不二製油グループ本社	2,200	2,701.00	5,942,200
かどや製油	100	3,655.00	365,500
J・オイルミルズ	500	3,995.00	1,997,500
キッコーマン	6,400	4,870.00	31,168,000
味の素	19,700	1,928.00	37,981,600
キューピー	5,000	2,070.00	10,350,000
ハウス食品グループ本社	3,300	3,575.00	11,797,500
カゴメ	3,400	2,784.00	9,465,600
焼津水産化学工業	400	902.00	360,800
アリアケジャパン	800	7,020.00	5,616,000
ピエトロ	100	1,602.00	160,200
エバラ食品工業	200	2,124.00	424,800
やまみ	100	2,149.00	214,900
ニチレイ	4,200	2,966.00	12,457,200
東洋水産	4,600	5,260.00	24,196,000
イトアンド	300	1,744.00	523,200
大冷	100	1,844.00	184,400
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	1,194.00	597,000
日清食品ホールディングス	3,800	9,150.00	34,770,000
永谷園ホールディングス	400	2,193.00	877,200
一正蒲鉾	300	922.00	276,600
フジッコ	1,000	1,949.00	1,949,000
ロック・フィールド	1,000	1,315.00	1,315,000
日本たばこ産業	51,400	2,009.50	103,288,300
ケンコーマヨネーズ	500	2,024.00	1,012,000
わらべや日洋ホールディングス	600	1,662.00	997,200
なとり	500	1,709.00	854,500
イフジ産業	200	774.00	154,800
ピククルスコーポレーション	200	2,217.00	443,400
北の達人コーポレーション	3,100	520.00	1,612,000
ユーグレナ	3,800	671.00	2,549,800
ミヨシ油脂	300	1,076.00	322,800
理研ビタミン	800	2,100.00	1,680,000
片倉工業	1,300	1,020.00	1,326,000
ゲンゼ	600	3,685.00	2,211,000
東洋紡	3,400	1,481.00	5,035,400
ユニチカ	2,500	338.00	845,000
富士紡ホールディングス	400	3,110.00	1,244,000

倉敷紡績	900	2,391.00	2,151,900
シキボウ	500	1,017.00	508,500
日本毛織	2,900	937.00	2,717,300
ダイトウボウ	1,300	122.00	158,600
トーア紡コーポレーション	300	470.00	141,000
ダイドーリミテッド	1,100	205.00	225,500
帝国繊維	1,000	2,393.00	2,393,000
帝人	7,100	1,652.00	11,729,200
東レ	62,900	476.50	29,971,850
サカイオーベックス	200	1,903.00	380,600
住江織物	200	1,872.00	374,400
日本フェルト	500	452.00	226,000
イチカワ	100	1,404.00	140,400
日東製網	100	1,365.00	136,500
アツギ	700	614.00	429,800
ダイニック	300	756.00	226,800
セーレン	2,100	1,281.00	2,690,100
ソトー	300	945.00	283,500
東海染工	100	1,106.00	110,600
小松マテーレ	1,400	727.00	1,017,800
ワコールホールディングス	2,300	2,154.00	4,954,200
ホギメディカル	1,000	3,375.00	3,375,000
レナウン	2,100	78.00	163,800
クラウディアホールディングス	200	423.00	84,600
T S Iホールディングス	2,900	433.00	1,255,700
マツオカコーポレーション	200	2,065.00	413,000
ワールド	1,200	1,322.00	1,586,400
三陽商会	500	1,013.00	506,500
ナイガイ	300	399.00	119,700
オンワードホールディングス	5,200	343.00	1,783,600
ルックホールディングス	300	797.00	239,100
キムラタン	4,400	25.00	110,000
ゴールドウイン	1,600	5,800.00	9,280,000
デサント	1,700	1,415.00	2,405,500
キング	400	488.00	195,200
ヤマトインターナショナル	800	321.00	256,800
特種東海製紙	600	4,145.00	2,487,000
王子ホールディングス	36,300	528.00	19,166,400
日本製紙	3,800	1,471.00	5,589,800
三菱製紙	1,000	380.00	380,000
北越コーポレーション	5,200	399.00	2,074,800
中越パルプ工業	400	1,310.00	524,000

巴川製紙所	300	835.00	250,500
大王製紙	3,800	1,441.00	5,475,800
阿波製紙	200	491.00	98,200
レンゴー	8,200	883.00	7,240,600
トーモク	500	1,769.00	884,500
ザ・パック	700	3,130.00	2,191,000
クラレ	13,700	1,051.00	14,398,700
旭化成	57,600	749.90	43,194,240
共和レザー	500	668.00	334,000
昭和電工	6,200	2,341.00	14,514,200
住友化学	63,800	321.00	20,479,800
住友精化	400	3,020.00	1,208,000
日産化学	4,800	4,090.00	19,632,000
ラサ工業	300	1,445.00	433,500
クレハ	700	4,245.00	2,971,500
多木化学	300	5,750.00	1,725,000
テイカ	600	1,591.00	954,600
石原産業	1,600	706.00	1,129,600
片倉コープアグリ	200	1,155.00	231,000
日本曹達	1,300	2,831.00	3,680,300
東ソー	13,400	1,394.00	18,679,600
トクヤマ	2,500	2,354.00	5,885,000
セントラル硝子	1,800	1,920.00	3,456,000
東亜合成	5,500	984.00	5,412,000
大阪ソーダ	900	2,525.00	2,272,500
関東電化工業	2,100	961.00	2,018,100
デンカ	3,200	2,678.00	8,569,600
信越化学工業	14,900	11,950.00	178,055,000
日本カーバイド工業	300	1,171.00	351,300
堺化学工業	600	1,852.00	1,111,200
第一稀元素化学工業	900	772.00	694,800
エア・ウォーター	8,100	1,518.00	12,295,800
大陽日酸	8,300	1,779.00	14,765,700
日本化学工業	300	2,222.00	666,600
東邦アセチレン	100	1,278.00	127,800
日本パーカラライジング	4,400	1,120.00	4,928,000
高压ガス工業	1,400	752.00	1,052,800
チタン工業	100	1,741.00	174,100
四国化成工業	1,300	1,071.00	1,392,300
戸田工業	200	1,417.00	283,400
ステラ ケミファ	500	2,685.00	1,342,500
保土谷化学工業	300	3,620.00	1,086,000

日本触媒	1,300	5,460.00	7,098,000
大日精化工業	800	2,372.00	1,897,600
カネカ	2,200	2,770.00	6,094,000
三菱瓦斯化学	8,100	1,439.00	11,655,900
三井化学	7,900	1,887.00	14,907,300
J S R	8,100	1,978.00	16,021,800
東京応化工業	1,500	5,220.00	7,830,000
大阪有機化学工業	800	1,728.00	1,382,400
三菱ケミカルホールディングス	58,000	585.40	33,953,200
K Hネオケム	1,500	1,852.00	2,778,000
ダイセル	11,300	860.00	9,718,000
住友ベークライト	1,400	2,842.00	3,978,800
積水化学工業	18,700	1,326.00	24,796,200
日本ゼオン	7,800	930.00	7,254,000
アイカ工業	2,600	3,015.00	7,839,000
宇部興産	4,400	1,709.00	7,519,600
積水樹脂	1,600	2,175.00	3,480,000
タキロンシーアイ	1,900	625.00	1,187,500
旭有機材	500	1,321.00	660,500
日立化成	3,700	4,615.00	17,075,500
ニチバン	500	1,450.00	725,000
リケンテクノス	2,200	411.00	904,200
大倉工業	400	1,513.00	605,200
積水化成品工業	1,200	588.00	705,600
群栄化学工業	200	2,664.00	532,800
タイガースポリマー	500	409.00	204,500
ミライアル	300	1,157.00	347,100
ダイキアクシス	300	733.00	219,900
ダイキョーニシカワ	1,800	560.00	1,008,000
竹本容器	300	711.00	213,300
森六ホールディングス	500	1,478.00	739,000
日本化薬	5,400	1,015.00	5,481,000
カーリットホールディングス	900	509.00	458,100
日本精化	700	1,340.00	938,000
扶桑化学工業	900	3,680.00	3,312,000
トリケミカル研究所	200	9,290.00	1,858,000
A D E K A	4,000	1,413.00	5,652,000
日油	3,300	3,755.00	12,391,500
新日本理化	1,400	173.00	242,200
ハリマ化成グループ	700	908.00	635,600
花王	21,200	8,739.00	185,266,800
第一工業製薬	300	4,685.00	1,405,500

石原ケミカル	200	1,880.00	376,000
日華化学	300	882.00	264,600
ニイタカ	200	2,916.00	583,200
三洋化成工業	500	4,400.00	2,200,000
有機合成薬品工業	700	335.00	234,500
大日本塗料	1,000	926.00	926,000
日本ペイントホールディングス	7,200	6,790.00	48,888,000
関西ペイント	9,800	2,050.00	20,090,000
神東塗料	700	180.00	126,000
中国塗料	2,500	752.00	1,880,000
日本特殊塗料	600	859.00	515,400
藤倉化成	1,200	475.00	570,000
太陽ホールディングス	600	4,655.00	2,793,000
D I C	3,700	2,589.00	9,579,300
サカタインクス	1,900	939.00	1,784,100
東洋インキS Cホールディングス	1,800	1,984.00	3,571,200
T & K T O K A	700	721.00	504,700
富士フィルムホールディングス	17,000	5,128.00	87,176,000
資生堂	17,600	6,475.00	113,960,000
ライオン	11,500	2,460.00	28,290,000
高砂香料工業	600	2,226.00	1,335,600
マンダム	2,000	2,078.00	4,156,000
ミルボン	1,200	4,935.00	5,922,000
ファンケル	3,600	3,090.00	11,124,000
コーセー	1,700	13,280.00	22,576,000
コタ	500	1,187.00	593,500
シーボン	100	2,178.00	217,800
ポーラ・オルビスホールディングス	3,800	1,976.00	7,508,800
ノエビアホールディングス	800	4,860.00	3,888,000
アジュバンコスメジャパン	200	939.00	187,800
エステー	600	1,611.00	966,600
アグロ カネショウ	400	1,450.00	580,000
コニシ	1,500	1,506.00	2,259,000
長谷川香料	1,500	2,242.00	3,363,000
星光P M C	500	638.00	319,000
小林製薬	2,500	9,800.00	24,500,000
荒川化学工業	800	1,311.00	1,048,800
メック	600	2,094.00	1,256,400
日本高純度化学	200	2,682.00	536,400
タカラバイオ	2,300	2,380.00	5,474,000
J C U	1,100	2,965.00	3,261,500
新田ゼラチン	600	703.00	421,800

O A Tアグリオ	200	1,057.00	211,400
デクセリアルズ	2,300	819.00	1,883,700
アース製薬	700	6,320.00	4,424,000
北興化学工業	900	575.00	517,500
大成ラミック	300	2,624.00	787,200
クミアイ化学工業	3,700	848.00	3,137,600
日本農薬	1,600	437.00	699,200
アキレス	600	1,596.00	957,600
有沢製作所	1,400	788.00	1,103,200
日東電工	6,100	5,340.00	32,574,000
レック	900	1,407.00	1,266,300
三光合成	1,000	308.00	308,000
きもと	1,400	150.00	210,000
藤森工業	800	3,225.00	2,580,000
前澤化成工業	600	1,043.00	625,800
未来工業	500	1,936.00	968,000
ウェーブロックホールディングス	300	685.00	205,500
J S P	500	1,375.00	687,500
エフピコ	1,000	7,770.00	7,770,000
天馬	600	1,495.00	897,000
信越ポリマー	1,600	834.00	1,334,400
東リ	2,200	247.00	543,400
ニフコ	3,300	2,104.00	6,943,200
バルカー	700	1,826.00	1,278,200
ユニ・チャーム	17,100	4,050.00	69,255,000
ショーエイコーポレーション	100	723.00	72,300
協和キリン	8,900	2,583.00	22,988,700
武田薬品工業	73,800	4,012.00	296,085,600
アステラス製薬	76,900	1,728.00	132,883,200
大日本住友製薬	6,600	1,344.00	8,870,400
塩野義製薬	11,300	5,714.00	64,568,200
わかもと製薬	1,000	241.00	241,000
あすか製薬	1,000	1,156.00	1,156,000
日本新薬	2,300	7,610.00	17,503,000
バイオフェルミン製薬	200	2,219.00	443,800
中外製薬	9,200	13,105.00	120,566,000
科研製薬	1,500	5,590.00	8,385,000
エーザイ	10,600	7,454.00	79,012,400
ロート製薬	4,600	3,305.00	15,203,000
小野薬品工業	20,400	2,716.50	55,416,600
久光製薬	2,300	4,910.00	11,293,000
持田製薬	1,200	4,020.00	4,824,000

参天製薬	16,500	1,900.00	31,350,000
扶桑薬品工業	300	2,399.00	719,700
日本ケミファ	100	2,555.00	255,500
ツムラ	2,700	2,781.00	7,508,700
日医工	2,500	1,416.00	3,540,000
キッセイ薬品工業	1,600	2,457.00	3,931,200
生化学工業	1,700	1,091.00	1,854,700
栄研化学	1,600	1,747.00	2,795,200
日水製薬	400	1,236.00	494,400
鳥居薬品	600	2,805.00	1,683,000
JCRファーマ	600	11,530.00	6,918,000
東和薬品	1,100	2,151.00	2,366,100
富士製薬工業	600	1,138.00	682,800
沢井製薬	1,800	5,340.00	9,612,000
ゼリア新薬工業	1,600	2,131.00	3,409,600
第一三共	25,400	8,432.00	214,172,800
キョーリン製薬ホールディングス	2,000	2,158.00	4,316,000
大幸薬品	1,100	1,924.00	2,116,400
ダイト	500	3,935.00	1,967,500
大塚ホールディングス	16,900	4,252.00	71,858,800
大正製薬ホールディングス	1,900	6,110.00	11,609,000
ペプチドリーム	4,500	4,365.00	19,642,500
日本コークス工業	7,200	57.00	410,400
ニチレキ	1,000	1,444.00	1,444,000
ユシロ化学工業	500	1,176.00	588,000
ビーピー・カストロール	300	1,175.00	352,500
富士石油	2,300	173.00	397,900
MORESCO	300	949.00	284,700
出光興産	9,800	2,446.00	23,970,800
JXTGホールディングス	133,400	377.60	50,371,840
コスモエネルギーホールディングス	2,600	1,571.00	4,084,600
横浜ゴム	5,100	1,391.00	7,094,100
TOYO TIRE	5,100	1,410.00	7,191,000
ブリヂストン	25,500	3,188.00	81,294,000
住友ゴム工業	8,000	1,020.00	8,160,000
藤倉コンポジット	800	364.00	291,200
オカモト	500	4,105.00	2,052,500
フコク	400	617.00	246,800
ニッタ	1,000	2,068.00	2,068,000
住友理工	1,700	592.00	1,006,400
三ツ星ベルト	1,200	1,492.00	1,790,400
バンドー化学	1,600	601.00	961,600

日東紡績	1,300	5,290.00	6,877,000
A G C	8,800	2,672.00	23,513,600
日本板硝子	4,200	361.00	1,516,200
石塚硝子	200	2,086.00	417,200
日本山村硝子	400	830.00	332,000
日本電気硝子	3,600	1,559.00	5,612,400
オハラ	400	890.00	356,000
住友大阪セメント	1,700	3,570.00	6,069,000
太平洋セメント	5,600	2,110.00	11,816,000
日本ヒューム	900	682.00	613,800
日本コンクリート工業	1,900	254.00	482,600
三谷セキサン	400	4,750.00	1,900,000
アジアパイルホールディングス	1,300	408.00	530,400
東海カーボン	9,300	889.00	8,267,700
日本カーボン	500	3,100.00	1,550,000
東洋炭素	500	1,612.00	806,000
ノリタケカンパニーリミテド	500	3,250.00	1,625,000
T O T O	6,300	3,775.00	23,782,500
日本碍子	10,600	1,370.00	14,522,000
日本特殊陶業	6,700	1,577.00	10,565,900
ダントーホールディングス	600	83.00	49,800
M A R U W A	300	8,070.00	2,421,000
品川リフラクトリーズ	200	2,263.00	452,600
黒崎播磨	200	3,740.00	748,000
ヨータイ	700	603.00	422,100
イソライト工業	500	461.00	230,500
東京窯業	1,100	297.00	326,700
ニッカトー	400	601.00	240,400
フジインコーポレーテッド	800	3,090.00	2,472,000
クニミネ工業	400	1,021.00	408,400
エーアンドエーマテリアル	100	1,125.00	112,500
ニチアス	2,400	2,313.00	5,551,200
ニチハ	1,200	2,229.00	2,674,800
日本製鉄	39,200	888.20	34,817,440
神戸製鋼所	16,000	375.00	6,000,000
中山製鋼所	1,200	352.00	422,400
合同製鐵	500	1,986.00	993,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	23,700	696.00	16,495,200
東京製鐵	4,300	711.00	3,057,300
共英製鋼	1,000	1,377.00	1,377,000
大和工業	1,900	2,143.00	4,071,700
東京鐵鋼	400	1,238.00	495,200

大阪製鐵	500	1,126.00	563,000
淀川製鋼所	1,200	1,690.00	2,028,000
丸一鋼管	2,800	2,725.00	7,630,000
モリ工業	300	2,275.00	682,500
大同特殊鋼	1,400	3,480.00	4,872,000
日本高周波鋼業	300	385.00	115,500
日本冶金工業	700	1,674.00	1,171,800
山陽特殊製鋼	600	968.00	580,800
愛知製鋼	500	2,669.00	1,334,500
日立金属	9,400	1,017.00	9,559,800
日本金属	200	634.00	126,800
大平洋金属	600	1,503.00	901,800
新日本電工	5,600	148.00	828,800
栗本鐵工所	400	1,802.00	720,800
虹技	100	1,216.00	121,600
日本鑄鉄管	100	1,358.00	135,800
三菱製鋼	600	679.00	407,400
日亜鋼業	1,300	258.00	335,400
日本精線	100	3,070.00	307,000
エンビプロ・ホールディングス	400	558.00	223,200
シンニッタン	1,300	251.00	326,300
新家工業	200	1,071.00	214,200
大紀アルミニウム工業所	1,400	542.00	758,800
日本軽金属ホールディングス	22,200	172.00	3,818,400
三井金属鉱業	2,400	2,026.00	4,862,400
東邦亜鉛	400	1,314.00	525,600
三菱マテリアル	5,800	2,229.00	12,928,200
住友金属鉱山	11,200	2,778.50	31,119,200
D O W Aホールディングス	2,200	3,010.00	6,622,000
古河機械金属	1,600	1,052.00	1,683,200
エス・サイエンス	3,700	39.00	144,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	900	950.00	855,000
東邦チタニウム	1,600	625.00	1,000,000
U A C J	1,300	1,661.00	2,159,300
C Kサンエツ	200	3,005.00	601,000
古河電気工業	2,700	2,010.00	5,427,000
住友電気工業	32,800	1,084.50	35,571,600
フジクラ	10,600	302.00	3,201,200
昭和電線ホールディングス	1,000	1,135.00	1,135,000
東京特殊電線	100	2,329.00	232,900
タツタ電線	1,700	597.00	1,014,900
カナレ電気	100	1,678.00	167,800

平河ヒューテック	400	972.00	388,800
リョービ	1,100	1,219.00	1,340,900
アーレスティ	1,100	340.00	374,000
アサヒホールディングス	1,500	2,683.00	4,024,500
稲葉製作所	500	1,369.00	684,500
宮地エンジニアリンググループ	300	1,568.00	470,400
トーカロ	2,400	1,075.00	2,580,000
アルファC o	300	885.00	265,500
SUMCO	10,500	1,649.00	17,314,500
川田テクノロジーズ	200	4,870.00	974,000
RS Technologies	200	3,275.00	655,000
信和	500	740.00	370,000
東洋製罐グループホールディングス	5,600	1,017.00	5,695,200
ホッカンホールディングス	500	1,526.00	763,000
コロナ	500	965.00	482,500
横河ブリッジホールディングス	1,600	1,950.00	3,120,000
駒井ハルテック	200	1,501.00	300,200
高田機工	100	2,232.00	223,200
三和ホールディングス	8,300	875.00	7,262,500
文化シャッター	2,600	780.00	2,028,000
三協立山	1,100	877.00	964,700
アルインコ	600	911.00	546,600
東洋シャッター	200	675.00	135,000
LIXILグループ	12,900	1,319.00	17,015,100
日本フィルコン	700	507.00	354,900
ノーリツ	1,800	1,233.00	2,219,400
長府製作所	900	2,270.00	2,043,000
リンナイ	1,700	8,450.00	14,365,000
ダイニチ工業	500	674.00	337,000
日東精工	1,200	433.00	519,600
三洋工業	100	1,701.00	170,100
岡部	1,800	771.00	1,387,800
ジーテクト	1,100	1,054.00	1,159,400
東プレ	1,600	1,278.00	2,044,800
高周波熱錬	1,700	552.00	938,400
東京製綱	600	531.00	318,600
サンコール	700	393.00	275,100
モリテック スチール	700	279.00	195,300
パイオラックス	1,300	1,560.00	2,028,000
エイチワン	900	512.00	460,800
日本発條	9,400	691.00	6,495,400
中央発條	100	2,681.00	268,100

アドバネクス	100	1,363.00	136,300
立川ブラインド工業	400	1,150.00	460,000
三益半導体工業	700	2,180.00	1,526,000
日本ドライケミカル	200	1,352.00	270,400
日本製鋼所	2,700	1,319.00	3,561,300
三浦工業	3,800	4,320.00	16,416,000
タクマ	3,000	1,210.00	3,630,000
ツガミ	1,800	951.00	1,711,800
オークマ	1,000	4,235.00	4,235,000
芝浦機械	1,000	2,098.00	2,098,000
アマダ	10,900	962.00	10,485,800
アイダエンジニアリング	2,300	722.00	1,660,600
滝澤鉄工所	300	1,001.00	300,300
F U J I	3,800	1,786.00	6,786,800
牧野フライス製作所	1,000	3,075.00	3,075,000
オーエスジー	4,100	1,424.00	5,838,400
ダイジェット工業	100	1,332.00	133,200
旭ダイヤモンド工業	2,300	464.00	1,067,200
D M G 森精機	5,500	1,158.00	6,369,000
ソディック	2,100	805.00	1,690,500
ディスコ	1,200	25,070.00	30,084,000
日東工器	500	1,946.00	973,000
日進工具	300	2,867.00	860,100
パンチ工業	800	352.00	281,600
富士ダイス	400	614.00	245,600
豊和工業	500	775.00	387,500
O K K	400	474.00	189,600
石川製作所	200	1,538.00	307,600
東洋機械金属	600	403.00	241,800
津田駒工業	200	827.00	165,400
エンシュウ	200	1,000.00	200,000
島精機製作所	1,400	1,544.00	2,161,600
オプトラン	1,000	2,790.00	2,790,000
N C ホールディングス	300	534.00	160,200
イワキポンプ	600	958.00	574,800
フリー	900	822.00	739,800
ヤマシンフィルタ	1,900	867.00	1,647,300
日阪製作所	1,100	739.00	812,900
やまびこ	1,700	901.00	1,531,700
平田機工	400	5,560.00	2,224,000
ペガサスミシン製造	900	322.00	289,800
マルマエ	300	879.00	263,700

タツモ	400	1,530.00	612,000
ナブテスコ	5,200	3,275.00	17,030,000
三井海洋開発	900	1,373.00	1,235,700
レオン自動機	900	1,233.00	1,109,700
S M C	2,800	52,300.00	146,440,000
ホソカワミクロン	300	5,530.00	1,659,000
ユニオンツール	300	2,863.00	858,900
オイレス工業	1,100	1,319.00	1,450,900
日精エー・エス・ビー機械	300	3,245.00	973,500
サトーホールディングス	1,200	2,214.00	2,656,800
技研製作所	800	4,105.00	3,284,000
日本エアーテック	300	1,197.00	359,100
カワタ	300	750.00	225,000
日精樹脂工業	700	960.00	672,000
オカダアイヨン	300	876.00	262,800
ワイエイシイホールディングス	400	418.00	167,200
小松製作所	40,200	2,040.00	82,008,000
住友重機械工業	5,100	2,246.00	11,454,600
日立建機	3,600	2,505.00	9,018,000
日工	1,200	593.00	711,600
巴工業	400	1,802.00	720,800
井関農機	900	1,189.00	1,070,100
T O W A	900	943.00	848,700
丸山製作所	200	1,299.00	259,800
北川鉄工所	400	1,615.00	646,000
ローツェ	400	5,110.00	2,044,000
タカキタ	300	529.00	158,700
クボタ	47,000	1,391.00	65,377,000
荏原実業	200	2,271.00	454,200
三菱化工機	300	1,591.00	477,300
月島機械	1,600	1,211.00	1,937,600
帝国電機製作所	700	1,317.00	921,900
東京機械製作所	300	237.00	71,100
新東工業	2,100	720.00	1,512,000
澁谷工業	800	2,663.00	2,130,400
アイチ コーポレーション	1,500	689.00	1,033,500
小森コーポレーション	2,200	735.00	1,617,000
鶴見製作所	700	1,834.00	1,283,800
住友精密工業	100	2,147.00	214,700
日本ギア工業	300	262.00	78,600
酒井重工業	200	2,055.00	411,000
荏原製作所	3,700	2,299.00	8,506,300

石井鐵工所	100	2,535.00	253,500
西島製作所	900	697.00	627,300
北越工業	900	995.00	895,500
ダイキン工業	11,300	14,425.00	163,002,500
オルガノ	300	6,560.00	1,968,000
トーヨーカネツ	400	1,882.00	752,800
栗田工業	4,800	2,996.00	14,380,800
椿本チエイン	1,300	2,506.00	3,257,800
大同工業	400	631.00	252,400
木村化工機	700	437.00	305,900
アネスト岩田	1,400	819.00	1,146,600
ダイフク	4,500	7,910.00	35,595,000
サムコ	200	1,869.00	373,800
加藤製作所	500	1,154.00	577,000
油研工業	100	1,355.00	135,500
タダノ	4,300	785.00	3,375,500
フジテック	3,200	1,476.00	4,723,200
C K D	2,400	1,847.00	4,432,800
キトー	700	1,145.00	801,500
平和	2,500	1,840.00	4,600,000
理想科学工業	800	1,442.00	1,153,600
S A N K Y O	2,000	2,740.00	5,480,000
日本金銭機械	1,000	535.00	535,000
マースグループホールディングス	600	1,627.00	976,200
フクシマガリレイ	500	3,150.00	1,575,000
オーイズミ	400	416.00	166,400
ダイコク電機	400	1,199.00	479,600
竹内製作所	1,500	1,647.00	2,470,500
アマノ	2,300	2,183.00	5,020,900
J U K I	1,200	599.00	718,800
サンデンホールディングス	1,200	349.00	418,800
蛇の目マシン工業	800	423.00	338,400
マックス	1,400	1,520.00	2,128,000
グローリー	2,300	2,379.00	5,471,700
新晃工業	800	1,395.00	1,116,000
大和冷機工業	1,300	939.00	1,220,700
セガサミーホールディングス	8,800	1,383.00	12,170,400
日本ピストンリング	300	1,093.00	327,900
リケン	400	2,685.00	1,074,000
T P R	1,200	1,226.00	1,471,200
ツバキ・ナカシマ	1,800	793.00	1,427,400
ホシザキ	2,600	8,070.00	20,982,000

大豊工業	700	489.00	342,300
日本精工	16,700	731.00	12,207,700
N T N	20,500	201.00	4,120,500
ジェイテクト	8,500	760.00	6,460,000
不二越	800	3,220.00	2,576,000
日本トムソン	2,600	366.00	951,600
T H K	5,200	2,570.00	13,364,000
ユーシン精機	700	663.00	464,100
前澤給装工業	300	2,040.00	612,000
イーグル工業	1,100	715.00	786,500
前澤工業	600	349.00	209,400
日本ピラー工業	900	1,392.00	1,252,800
キッツ	3,600	693.00	2,494,800
マキタ	11,600	3,375.00	39,150,000
日立造船	7,000	359.00	2,513,000
三菱重工業	14,900	2,549.00	37,980,100
I H I	6,400	1,256.00	8,038,400
スター精密	1,400	1,195.00	1,673,000
日清紡ホールディングス	5,900	704.00	4,153,600
イビデン	5,400	2,974.00	16,059,600
コニカミノルタ	19,400	368.00	7,139,200
ブラザー工業	10,800	1,861.00	20,098,800
ミネベアミツミ	16,500	1,800.00	29,700,000
日立製作所	42,600	3,089.00	131,591,400
三菱電機	88,700	1,300.00	115,310,000
富士電機	5,300	2,691.00	14,262,300
東洋電機製造	300	1,234.00	370,200
安川電機	9,500	3,510.00	33,345,000
シンフォニアテクノロジー	1,100	1,036.00	1,139,600
明電舎	1,600	1,642.00	2,627,200
オリジン	200	1,455.00	291,000
山洋電気	400	4,695.00	1,878,000
デンヨー	800	1,881.00	1,504,800
東芝テック	1,100	3,365.00	3,701,500
芝浦メカトロニクス	200	2,774.00	554,800
マブチモーター	2,500	3,180.00	7,950,000
日本電産	21,300	6,030.00	128,439,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	500	320.00	160,000
トレックス・セミコンダクター	500	1,033.00	516,500
東光高岳	500	951.00	475,500
ダブル・スコープ	1,400	356.00	498,400
宮越ホールディングス	300	573.00	171,900

ダイヘン	1,000	3,630.00	3,630,000
ヤーマン	1,400	694.00	971,600
JVCケンウッド	7,200	157.00	1,130,400
ミマキエンジニアリング	800	400.00	320,000
第一精工	400	2,395.00	958,000
日新電機	2,100	1,063.00	2,232,300
大崎電気工業	1,800	498.00	896,400
オムロン	7,900	6,670.00	52,693,000
日東工業	1,300	1,845.00	2,398,500
I D E C	1,300	1,647.00	2,141,100
正興電機製作所	200	863.00	172,600
不二電機工業	100	1,231.00	123,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3,000	1,617.00	4,851,000
サクサホールディングス	200	1,731.00	346,200
メルコホールディングス	300	2,499.00	749,700
テクノメディカ	200	1,807.00	361,400
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	200	483.00	96,600
日本電気	10,800	4,800.00	51,840,000
富士通	8,500	10,420.00	88,570,000
沖電気工業	3,600	1,032.00	3,715,200
岩崎通信機	400	839.00	335,600
電気興業	400	2,429.00	971,600
サンケン電気	1,000	2,057.00	2,057,000
ナカヨ	200	1,266.00	253,200
アイホン	500	1,599.00	799,500
ルネサスエレクトロニクス	42,400	558.00	23,659,200
セイコーエプソン	11,000	1,096.00	12,056,000
ワコム	6,000	474.00	2,844,000
アルバック	1,600	2,875.00	4,600,000
アクセル	400	696.00	278,400
E I Z O	700	3,445.00	2,411,500
ジャパンディスプレイ	25,400	45.00	1,143,000
日本信号	2,300	1,025.00	2,357,500
京三製作所	2,100	500.00	1,050,000
能美防災	1,200	1,890.00	2,268,000
ホーチキ	600	1,292.00	775,200
星和電機	400	579.00	231,600
エレコム	1,000	4,470.00	4,470,000
パナソニック	101,300	793.10	80,341,030
シャープ	10,300	1,120.00	11,536,000
アンリツ	5,700	2,184.00	12,448,800
富士通ゼネラル	2,400	1,927.00	4,624,800

ソニー	55,500	6,865.00	381,007,500
T D K	4,300	9,440.00	40,592,000
帝国通信工業	400	1,199.00	479,600
タムラ製作所	3,000	433.00	1,299,000
アルプスアルパイン	7,800	1,149.00	8,962,200
池上通信機	300	849.00	254,700
日本電波工業	800	403.00	322,400
鈴木	400	748.00	299,200
日本トリム	100	3,015.00	301,500
ローランド ディー・ジー・	500	1,135.00	567,500
フォスター電機	900	1,137.00	1,023,300
S M K	200	2,452.00	490,400
ヨコオ	600	2,735.00	1,641,000
ティアック	600	149.00	89,400
ホシデン	2,400	868.00	2,083,200
ヒロセ電機	1,400	12,070.00	16,898,000
日本航空電子工業	2,000	1,375.00	2,750,000
T O A	1,000	680.00	680,000
マクセルホールディングス	1,900	990.00	1,881,000
古野電気	1,100	781.00	859,100
ユニデンホールディングス	200	1,867.00	373,400
スミダコーポレーション	700	663.00	464,100
アイコム	500	2,663.00	1,331,500
リオン	400	2,317.00	926,800
本多通信工業	800	408.00	326,400
船井電機	900	465.00	418,500
横河電機	8,100	1,413.00	11,445,300
新電元工業	300	2,481.00	744,300
アズビル	5,600	2,728.00	15,276,800
東亜ディーケーケー	400	870.00	348,000
日本光電工業	3,700	3,365.00	12,450,500
チノー	300	1,291.00	387,300
共和電業	900	361.00	324,900
日本電子材料	400	969.00	387,600
堀場製作所	1,800	5,850.00	10,530,000
アドバンテスト	6,600	5,330.00	35,178,000
小野測器	400	492.00	196,800
エスベック	800	1,739.00	1,391,200
キーエンス	8,000	38,870.00	310,960,000
日置電機	500	3,095.00	1,547,500
シスメックス	6,300	7,977.00	50,255,100
日本マイクロニクス	1,500	867.00	1,300,500

メガチップス	800	1,803.00	1,442,400
OBARA GROUP	500	2,888.00	1,444,000
澤藤電機	100	1,617.00	161,700
原田工業	400	842.00	336,800
コーセル	1,200	879.00	1,054,800
イリソ電子工業	700	3,225.00	2,257,500
オブテックスグループ	1,500	1,237.00	1,855,500
千代田インテグレ	400	1,703.00	681,200
アイ・オー・データ機器	300	931.00	279,300
レーザーテック	3,900	7,650.00	29,835,000
スタンレー電気	6,200	2,374.00	14,718,800
岩崎電気	300	1,718.00	515,400
ウシオ電機	4,900	1,057.00	5,179,300
岡谷電機産業	700	315.00	220,500
ハリオス テクノ ホールディング	800	339.00	271,200
エノモト	300	1,001.00	300,300
日本セラミック	900	2,005.00	1,804,500
遠藤照明	400	553.00	221,200
古河電池	600	547.00	328,200
双信電機	400	330.00	132,000
山一電機	600	1,505.00	903,000
図研	600	2,494.00	1,496,400
日本電子	1,700	3,365.00	5,720,500
カシオ計算機	7,800	1,613.00	12,581,400
ファナック	8,400	17,420.00	146,328,000
日本シイエムケイ	2,100	395.00	829,500
エンプラス	500	2,231.00	1,115,500
大真空	300	2,052.00	615,600
ローム	3,900	7,100.00	27,690,000
浜松ホトニクス	6,400	4,740.00	30,336,000
三井ハイテック	1,000	1,285.00	1,285,000
新光電気工業	3,000	1,353.00	4,059,000
京セラ	12,500	5,700.00	71,250,000
太陽誘電	3,900	3,085.00	12,031,500
村田製作所	26,000	6,122.00	159,172,000
双葉電子工業	1,400	1,000.00	1,400,000
北陸電気工業	400	920.00	368,000
ニチコン	3,000	683.00	2,049,000
日本ケミコン	700	1,188.00	831,600
KOA	1,300	888.00	1,154,400
市光工業	1,300	468.00	608,400
小糸製作所	5,300	4,050.00	21,465,000

ミツバ	1,600	420.00	672,000	
S C R E E Nホールディングス	1,500	5,540.00	8,310,000	
キヤノン電子	900	1,526.00	1,373,400	
キヤノン	47,700	2,150.50	102,578,850	
リコー	22,600	718.00	16,226,800	
象印マホービン	2,600	1,550.00	4,030,000	
M U T O Hホールディングス	100	1,355.00	135,500	
東京エレクトロン	5,600	22,525.00	126,140,000	
トヨタ紡織	2,600	1,288.00	3,348,800	
芦森工業	200	814.00	162,800	
ユニプレス	1,700	962.00	1,635,400	
豊田自動織機	7,200	5,150.00	37,080,000	
モリタホールディングス	1,500	1,662.00	2,493,000	
三櫻工業	1,100	683.00	751,300	
デンソー	19,500	3,726.00	72,657,000	
東海理化電機製作所	2,300	1,395.00	3,208,500	
三井E & Sホールディングス	3,200	497.00	1,590,400	
川崎重工業	6,900	1,509.00	10,412,100	
名村造船所	2,800	170.00	476,000	
サノヤスホールディングス	1,000	152.00	152,000	
日本車輛製造	300	2,718.00	815,400	
三菱ロジスネクスト	1,200	927.00	1,112,400	
近畿車輛	100	1,170.00	117,000	
日産自動車	104,600	369.50	38,649,700	
いすゞ自動車	25,700	858.80	22,071,160	
トヨタ自動車	98,900	6,249.00	618,026,100	
日野自動車	11,100	615.00	6,826,500	
三菱自動車工業	32,800	293.00	9,610,400	
エフテック	600	442.00	265,200	
レシップホールディングス	300	485.00	145,500	
G M B	200	678.00	135,600	
ファルテック	200	635.00	127,000	
武蔵精密工業	2,000	849.00	1,698,000	
日産車体	1,700	897.00	1,524,900	
新明和工業	2,400	1,053.00	2,527,200	
極東開発工業	1,600	1,209.00	1,934,400	
日信工業	1,700	2,224.00	3,780,800	
トピー工業	700	1,235.00	864,500	
ティラド	300	1,381.00	414,300	
曙ブレーキ工業	4,800	183.00	878,400	
タチエス	1,500	920.00	1,380,000	
N O K	4,800	1,221.00	5,860,800	

フタバ産業	2,500	449.00	1,122,500	
K Y B	1,000	2,143.00	2,143,000	
大同メタル工業	1,700	544.00	924,800	
プレス工業	4,400	243.00	1,069,200	
ミクニ	1,100	257.00	282,700	
太平洋工業	1,900	911.00	1,730,900	
ケーヒン	1,900	2,548.00	4,841,200	
河西工業	1,200	482.00	578,400	
アイシン精機	7,300	3,080.00	22,484,000	
マツダ	26,100	617.00	16,103,700	
今仙電機製作所	800	754.00	603,200	
本田技研工業	69,800	2,453.00	171,219,400	
スズキ	17,600	3,506.00	61,705,600	
S U B A R U	27,500	2,121.50	58,341,250	
安永	400	982.00	392,800	
ヤマハ発動機	11,600	1,368.00	15,868,800	
ショーワ	1,900	2,257.00	4,288,300	
T B K	1,100	434.00	477,400	
エクセディ	1,200	1,562.00	1,874,400	
豊田合成	2,900	1,982.00	5,747,800	
愛三工業	1,400	519.00	726,600	
盟和産業	100	933.00	93,300	
日本プラスト	700	434.00	303,800	
ヨロズ	800	1,076.00	860,800	
エフ・シー・シー	1,400	1,561.00	2,185,400	
シマノ	3,300	18,880.00	62,304,000	
テイ・エス テック	2,100	2,838.00	5,959,800	
ジャムコ	400	612.00	244,800	
テルモ	25,100	3,652.00	91,665,200	
クリエートメディック	300	962.00	288,600	
日機装	2,700	825.00	2,227,500	
日本エム・ディ・エム	500	1,560.00	780,000	
島津製作所	10,600	2,747.00	29,118,200	
J M S	700	811.00	567,700	
クボテック	200	327.00	65,400	
長野計器	600	952.00	571,200	
ブイ・テクノロジー	400	3,780.00	1,512,000	
東京計器	600	755.00	453,000	
愛知時計電機	100	4,350.00	435,000	
インターアクション	500	2,388.00	1,194,000	
オーバル	800	221.00	176,800	
東京精密	1,600	3,665.00	5,864,000	

マニー	3,500	2,507.00	8,774,500
ニコン	13,500	931.00	12,568,500
トプコン	4,500	812.00	3,654,000
オリンパス	49,100	1,628.00	79,934,800
理研計器	800	2,127.00	1,701,600
タムロン	700	1,748.00	1,223,600
H O Y A	17,700	9,678.00	171,300,600
シード	400	791.00	316,400
ノーリツ鋼機	600	1,289.00	773,400
エー・アンド・デイ	800	683.00	546,400
朝日インテック	10,000	2,977.00	29,770,000
シチズン時計	10,400	342.00	3,556,800
リズム時計工業	300	581.00	174,300
大研医器	600	644.00	386,400
メニコン	1,300	4,535.00	5,895,500
シンシア	100	384.00	38,400
松風	400	1,488.00	595,200
セイコーホールディングス	1,300	1,617.00	2,102,100
ニプロ	6,100	1,224.00	7,466,400
中本パックス	200	1,487.00	297,400
スノーピーク	500	879.00	439,500
パラマウントベッドホールディングス	900	4,255.00	3,829,500
トランザクション	500	956.00	478,000
粧美堂	300	351.00	105,300
ニホンフラッシュ	800	1,258.00	1,006,400
前田工織	1,000	2,069.00	2,069,000
永大産業	1,100	287.00	315,700
アートネイチャー	900	650.00	585,000
バンダイナムコホールディングス	9,200	5,507.00	50,664,400
アイフィスジャパン	200	681.00	136,200
共立印刷	1,400	140.00	196,000
S H O E I	800	2,217.00	1,773,600
フランスベッドホールディングス	1,300	872.00	1,133,600
パイロットコーポレーション	1,400	3,525.00	4,935,000
萩原工業	500	1,324.00	662,000
トッパン・フォームズ	1,900	933.00	1,772,700
フジシールインターナショナル	2,000	2,080.00	4,160,000
タカラトミー	4,000	910.00	3,640,000
廣済堂	600	786.00	471,600
エステールホールディングス	200	603.00	120,600
アーク	3,200	96.00	307,200
タカノ	300	694.00	208,200

プロネクサス	800	1,038.00	830,400
ホクシン	500	117.00	58,500
ウッドワン	300	1,104.00	331,200
大建工業	600	1,650.00	990,000
凸版印刷	12,500	1,455.00	18,187,500
大日本印刷	11,600	2,079.00	24,116,400
共同印刷	300	2,707.00	812,100
N I S S H A	1,800	979.00	1,762,200
光村印刷	100	1,504.00	150,400
TAKARA & COMPANY	400	1,823.00	729,200
アシックス	7,300	1,001.00	7,307,300
ツツミ	300	1,723.00	516,900
小松ウオール工業	300	1,836.00	550,800
ヤマハ	5,300	4,665.00	24,724,500
河合楽器製作所	300	2,632.00	789,600
クリナップ	800	519.00	415,200
ピジョン	5,400	4,185.00	22,599,000
オリバー	200	2,591.00	518,200
兼松サステック	100	1,450.00	145,000
キングジム	700	875.00	612,500
リンテック	2,100	2,409.00	5,058,900
イトーキ	1,900	326.00	619,400
任天堂	5,400	45,010.00	243,054,000
三菱鉛筆	1,500	1,394.00	2,091,000
タカラスタANDARD	1,800	1,532.00	2,757,600
コクヨ	4,300	1,278.00	5,495,400
ナカバヤシ	900	543.00	488,700
グローブライド	400	2,040.00	816,000
オカムラ	3,100	811.00	2,514,100
美津濃	800	1,781.00	1,424,800
東京電力ホールディングス	70,800	349.00	24,709,200
中部電力	27,100	1,443.00	39,105,300
関西電力	33,600	1,003.50	33,717,600
中国電力	12,800	1,476.00	18,892,800
北陸電力	8,100	706.00	5,718,600
東北電力	22,100	1,038.00	22,939,800
四国電力	8,000	804.00	6,432,000
九州電力	18,300	860.00	15,738,000
北海道電力	8,300	413.00	3,427,900
沖縄電力	1,600	2,077.00	3,323,200
電源開発	7,100	1,915.00	13,596,500
エフオン	500	595.00	297,500

イーレックス	1,300	1,350.00	1,755,000
レノバ	1,500	865.00	1,297,500
東京瓦斯	17,100	2,471.50	42,262,650
大阪瓦斯	17,200	2,091.00	35,965,200
東邦瓦斯	4,400	5,820.00	25,608,000
北海道瓦斯	500	1,553.00	776,500
広島ガス	1,800	359.00	646,200
西部瓦斯	1,000	2,552.00	2,552,000
静岡ガス	2,500	952.00	2,380,000
メタウォーター	400	4,575.00	1,830,000
SBSホールディングス	800	1,815.00	1,452,000
東武鉄道	9,200	3,640.00	33,488,000
相鉄ホールディングス	2,800	2,889.00	8,089,200
東急	22,400	1,572.00	35,212,800
京浜急行電鉄	11,400	1,683.00	19,186,200
小田急電鉄	13,200	2,431.00	32,089,200
京王電鉄	4,600	5,910.00	27,186,000
京成電鉄	6,200	3,195.00	19,809,000
富士急行	1,200	3,030.00	3,636,000
新京成電鉄	200	2,090.00	418,000
東日本旅客鉄道	15,600	7,857.00	122,569,200
西日本旅客鉄道	7,900	6,369.00	50,315,100
東海旅客鉄道	7,400	17,550.00	129,870,000
西武ホールディングス	11,900	1,264.00	15,041,600
鴻池運輸	1,400	1,142.00	1,598,800
西日本鉄道	2,500	2,685.00	6,712,500
ハマキョウレックス	700	2,978.00	2,084,600
サカイ引越センター	500	5,840.00	2,920,000
近鉄グループホールディングス	8,400	5,120.00	43,008,000
阪急阪神ホールディングス	11,200	3,705.00	41,496,000
南海電気鉄道	4,000	2,501.00	10,004,000
京阪ホールディングス	3,700	4,850.00	17,945,000
神戸電鉄	200	3,810.00	762,000
名古屋鉄道	6,900	3,165.00	21,838,500
山陽電気鉄道	600	2,161.00	1,296,600
日本通運	2,900	4,870.00	14,123,000
ヤマトホールディングス	14,700	1,890.00	27,783,000
山九	2,300	3,950.00	9,085,000
丸運	500	228.00	114,000
丸全昭和運輸	700	2,783.00	1,948,100
センコーグループホールディングス	4,600	848.00	3,900,800
トナミホールディングス	200	5,320.00	1,064,000

ニッコンホールディングス	3,000	2,004.00	6,012,000
日本石油輸送	100	3,145.00	314,500
福山通運	1,100	3,265.00	3,591,500
セイノーホールディングス	6,300	1,307.00	8,234,100
エスライン	300	995.00	298,500
神奈川中央交通	200	4,090.00	818,000
日立物流	1,500	2,576.00	3,864,000
丸和運輸機関	900	2,771.00	2,493,900
C & F ロジホールディングス	800	1,383.00	1,106,400
九州旅客鉄道	7,400	2,913.00	21,556,200
S Gホールディングス	8,800	3,085.00	27,148,000
日本郵船	7,000	1,391.00	9,737,000
商船三井	5,300	1,746.00	9,253,800
川崎汽船	2,600	1,016.00	2,641,600
N S ユナイテッド海運	500	1,337.00	668,500
明治海運	900	317.00	285,300
飯野海運	4,000	311.00	1,244,000
共栄タンカー	100	871.00	87,100
乾汽船	500	1,222.00	611,000
日本航空	14,800	1,806.50	26,736,200
A N Aホールディングス	15,300	2,314.00	35,404,200
パスコ	200	1,396.00	279,200
トランコム	200	6,530.00	1,306,000
日新	700	1,611.00	1,127,700
三菱倉庫	2,700	2,411.00	6,509,700
三井倉庫ホールディングス	1,000	1,398.00	1,398,000
住友倉庫	3,000	1,242.00	3,726,000
澁澤倉庫	500	2,186.00	1,093,000
東陽倉庫	1,500	318.00	477,000
日本トランスシティ	1,800	484.00	871,200
ケイヒン	200	1,286.00	257,200
中央倉庫	500	1,039.00	519,500
川西倉庫	200	1,015.00	203,000
安田倉庫	700	830.00	581,000
ファイズホールディングス	200	1,001.00	200,200
東洋埠頭	300	1,297.00	389,100
宇徳	700	448.00	313,600
上組	4,700	1,945.00	9,141,500
サンリツ	200	563.00	112,600
キムラユニティー	200	1,010.00	202,000
キューソー流通システム	200	1,702.00	340,400
近鉄エクスプレス	1,800	1,533.00	2,759,400

東海運	500	258.00	129,000
エーアイティー	600	734.00	440,400
内外トランスライン	300	1,049.00	314,700
日本コンセプト	300	1,400.00	420,000
N E C ネットズエスアイ	800	5,240.00	4,192,000
クロスキャット	200	997.00	199,400
システナ	3,100	1,435.00	4,448,500
デジタルアーツ	400	7,990.00	3,196,000
日鉄ソリューションズ	1,300	2,686.00	3,491,800
キューブシステム	500	731.00	365,500
エイジア	200	1,278.00	255,600
コア	400	1,134.00	453,600
ラクーンホールディングス	400	678.00	271,200
ソリトンシステムズ	400	1,283.00	513,200
ソフトクリエイイトホールディングス	400	1,813.00	725,200
T I S	8,700	2,200.00	19,140,000
ネオス	300	635.00	190,500
電算システム	300	2,953.00	885,900
グリー	5,300	447.00	2,369,100
コーエーテクモホールディングス	1,800	3,080.00	5,544,000
三菱総合研究所	400	3,895.00	1,558,000
ボルテージ	200	398.00	79,600
電算	100	2,045.00	204,500
A G S	500	723.00	361,500
ファインデックス	700	1,004.00	702,800
ブレインパッド	200	4,750.00	950,000
K L a b	1,700	707.00	1,201,900
ポルトトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,000	923.00	923,000
イーブックイニシアティブジャパン	100	2,147.00	214,700
ネクソン	24,300	2,152.00	52,293,600
アイスタイル	2,400	275.00	660,000
エムアップホールディングス	300	2,338.00	701,400
エイチーム	600	692.00	415,200
エニグモ	800	949.00	759,200
テクノスジャパン	700	498.00	348,600
e n i s h	400	402.00	160,800
コロブラ	2,900	1,076.00	3,120,400
オルトプラス	500	425.00	212,500
ブロードリーフ	4,300	568.00	2,442,400
クロス・マーケティンググループ	400	299.00	119,600
デジタルハーツホールディングス	500	740.00	370,000
システム情報	700	987.00	690,900

メディアドゥホールディングス	300	4,080.00	1,224,000	
じげん	2,100	324.00	680,400	
ブイキューブ	500	1,112.00	556,000	
エンカレッジ・テクノロジー	200	863.00	172,600	
サイバーリンクス	100	1,475.00	147,500	
ディー・エル・イー	700	121.00	84,700	
フィックスターズ	900	1,225.00	1,102,500	
CARTA HOLDINGS	400	887.00	354,800	
オブティム	500	2,311.00	1,155,500	
セレス	300	959.00	287,700	
SHIFT	400	8,900.00	3,560,000	
ティーガイア	800	2,148.00	1,718,400	
セック	100	3,610.00	361,000	
日本アジアグループ	900	234.00	210,600	
テクマトリックス	600	3,050.00	1,830,000	
プロシップ	300	1,210.00	363,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,100	1,702.00	3,574,200	
GMOペイメントゲートウェイ	1,800	11,060.00	19,908,000	
ザッパラス	400	343.00	137,200	
システムリサーチ	200	1,745.00	349,000	
インターネットイニシアティブ	1,300	3,970.00	5,161,000	
さくらインターネット	900	565.00	508,500	
ヴィンクス	200	1,065.00	213,000	
GMOクラウド	200	3,990.00	798,000	
SRAホールディングス	500	2,187.00	1,093,500	
システムインテグレータ	300	739.00	221,700	
朝日ネット	600	1,019.00	611,400	
eBASE	1,000	1,047.00	1,047,000	
アバント	800	979.00	783,200	
アドソル日進	300	2,480.00	744,000	
フリービット	500	788.00	394,000	
コムチュア	1,000	2,194.00	2,194,000	
サイバーコム	200	1,894.00	378,800	
アステリア	500	446.00	223,000	
アイル	500	1,686.00	843,000	
マークラインズ	400	1,833.00	733,200	
メディカル・データ・ビジョン	700	970.00	679,000	
gumi	1,100	798.00	877,800	
ショーケース	200	565.00	113,000	
モバイルファクトリー	200	1,106.00	221,200	
テラスカイ	300	2,805.00	841,500	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	300	1,396.00	418,800	

PCIホールディングス	300	805.00	241,500
パイプドHD	100	1,455.00	145,500
アイビーシー	100	975.00	97,500
ネオジャパン	200	1,252.00	250,400
PR TIMES	100	2,316.00	231,600
ランドコンピュータ	100	1,033.00	103,300
ダブルスタンダード	100	4,580.00	458,000
オープンドア	400	1,053.00	421,200
マイネット	300	920.00	276,000
アカツキ	300	4,090.00	1,227,000
ベネフィットジャパン	100	1,471.00	147,100
Ubicomホールディングス	200	1,305.00	261,000
LINE	1,900	5,330.00	10,127,000
カナミックネットワーク	800	749.00	599,200
ノムラシステムコーポレーション	200	472.00	94,400
チェンジ	300	3,990.00	1,197,000
シンクロ・フード	400	309.00	123,600
オークネット	500	1,038.00	519,000
セグエグループ	200	772.00	154,400
エイトレッド	100	1,780.00	178,000
AOI TYO Holdings	900	455.00	409,500
マクロミル	1,800	670.00	1,206,000
ビーグリー	200	1,527.00	305,400
オロ	200	3,030.00	606,000
ユーザーローカル	100	2,963.00	296,300
テモナ	200	697.00	139,400
ニーズウェル	200	660.00	132,000
サインポスト	200	1,364.00	272,800
ソルクシーズ	400	633.00	253,200
フェイス	300	610.00	183,000
プロトコーポレーション	800	1,020.00	816,000
ハイマックス	100	1,911.00	191,100
野村総合研究所	12,300	2,553.00	31,401,900
サイバネットシステム	600	682.00	409,200
CEホールディングス	500	433.00	216,500
日本システム技術	100	1,187.00	118,700
インテージホールディングス	1,100	792.00	871,200
東邦システムサイエンス	200	929.00	185,800
ソースネクスト	4,100	317.00	1,299,700
インフォコム	1,000	2,567.00	2,567,000
HEROZ	100	3,530.00	353,000
ラクスル	700	2,568.00	1,797,600

F I G	900	260.00	234,000
システムサポート	100	2,971.00	297,100
イーソル	400	1,319.00	527,600
アルテリア・ネットワークス	1,000	2,109.00	2,109,000
東海ソフト	100	1,342.00	134,200
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	100	915.00	91,500
フォーカスシステムズ	500	785.00	392,500
クレスコ	500	1,427.00	713,500
フジ・メディア・ホールディングス	8,400	982.00	8,248,800
オービック	3,000	17,210.00	51,630,000
ジャストシステム	1,400	7,100.00	9,940,000
T D C ソフト	800	850.00	680,000
Zホールディングス	119,500	435.00	51,982,500
トレンドマイクロ	3,900	5,570.00	21,723,000
I Dホールディングス	300	1,484.00	445,200
日本オラクル	1,800	12,750.00	22,950,000
アルファシステムズ	300	3,585.00	1,075,500
フューチャー	1,000	1,635.00	1,635,000
C A C H o l d i n g s	600	1,108.00	664,800
S Bテクノロジー	300	2,599.00	779,700
トーセ	200	833.00	166,600
オービックビジネスコンサルタント	900	4,985.00	4,486,500
伊藤忠テクノソリューションズ	4,000	3,490.00	13,960,000
アイティフォー	1,100	705.00	775,500
東計電算	100	3,805.00	380,500
エクスネット	100	962.00	96,200
大塚商会	4,700	4,825.00	22,677,500
サイボウズ	1,000	2,226.00	2,226,000
ソフトブレーン	500	482.00	241,000
電通国際情報サービス	500	4,530.00	2,265,000
A C C E S S	800	860.00	688,000
デジタルガレージ	1,600	4,015.00	6,424,000
E Mシステムズ	1,200	831.00	997,200
ウェザーニューズ	300	3,870.00	1,161,000
C I J	600	818.00	490,800
ビジネスエンジニアリング	100	2,470.00	247,000
日本エンタープライズ	900	230.00	207,000
WOWOW	400	2,371.00	948,400
スカラ	600	566.00	339,600
インテリジェント ウェイブ	500	623.00	311,500
I M A G I C A G R O U P	700	366.00	256,200
ネットワンシステムズ	3,300	3,175.00	10,477,500

システムソフト	1,800	78.00	140,400
アルゴグラフィックス	700	3,630.00	2,541,000
マーベラス	1,300	560.00	728,000
エイベックス	1,500	865.00	1,297,500
日本ユニシス	2,700	3,210.00	8,667,000
兼松エレクトロニクス	500	3,785.00	1,892,500
東京放送ホールディングス	5,300	1,520.00	8,056,000
日本テレビホールディングス	7,300	1,110.00	8,103,000
朝日放送グループホールディングス	900	708.00	637,200
テレビ朝日ホールディングス	2,400	1,557.00	3,736,800
スカパーJ S A Tホールディングス	5,700	408.00	2,325,600
テレビ東京ホールディングス	700	2,325.00	1,627,500
日本BS放送	300	1,024.00	307,200
ビジョン	800	764.00	611,200
スマートバリュー	200	854.00	170,800
USEN-NEXT HOLDINGS	300	1,283.00	384,900
ワイヤレスゲート	400	566.00	226,400
コネクシオ	500	1,535.00	767,500
日本通信	6,700	165.00	1,105,500
クロップス	200	689.00	137,800
日本電信電話	116,300	2,356.50	274,060,950
KDDI	64,800	3,165.00	205,092,000
ソフトバンク	79,100	1,422.00	112,480,200
光通信	900	21,700.00	19,530,000
NTTドコモ	64,300	3,053.00	196,307,900
エムティーアイ	800	610.00	488,000
GMOインターネット	3,400	2,531.00	8,605,400
ファイバーゲート	300	1,370.00	411,000
アйдママーケティングコミュニケーション	300	430.00	129,000
KADOKAWA	2,300	1,635.00	3,760,500
学研ホールディングス	1,200	1,671.00	2,005,200
ゼンリン	1,700	1,266.00	2,152,200
昭文社ホールディングス	400	398.00	159,200
インプレスホールディングス	700	143.00	100,100
アイネット	400	1,489.00	595,600
松竹	600	13,030.00	7,818,000
東宝	5,100	3,695.00	18,844,500
東映	300	13,580.00	4,074,000
エヌ・ティ・ティ・データ	23,200	1,117.00	25,914,400
ピー・シー・エー	100	3,975.00	397,500
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,839.00	283,900
DTS	1,900	2,220.00	4,218,000

スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,700	4,770.00	17,649,000
シーイーシー	900	1,703.00	1,532,700
カブコン	4,100	3,515.00	14,411,500
アイ・エス・ビー	200	1,715.00	343,000
ジャステック	600	1,145.00	687,000
S C S K	2,000	4,885.00	9,770,000
日本システムウエア	300	2,035.00	610,500
アイネス	900	1,273.00	1,145,700
T K C	700	5,060.00	3,542,000
富士ソフト	1,100	4,370.00	4,807,000
N S D	2,800	1,585.00	4,438,000
コナミホールディングス	3,200	3,390.00	10,848,000
福井コンピュータホールディングス	300	2,816.00	844,800
J B C Cホールディングス	600	1,522.00	913,200
ミロク情報サービス	800	2,266.00	1,812,800
ソフトバンクグループ	69,000	4,574.00	315,606,000
ハウスイ	100	899.00	89,900
高千穂交易	300	950.00	285,000
カワニシホールディングス	100	1,234.00	123,400
伊藤忠食品	200	4,670.00	934,000
エレマテック	800	789.00	631,200
J A L U X	200	1,594.00	318,800
あらた	700	4,310.00	3,017,000
トーメンデバイス	100	3,635.00	363,500
東京エレクトロン デバイス	300	2,782.00	834,600
フィールズ	700	320.00	224,000
双日	48,200	233.00	11,230,600
アルフレッサ ホールディングス	9,700	2,040.00	19,788,000
横浜冷凍	2,300	886.00	2,037,800
神栄	100	490.00	49,000
ラサ商事	500	838.00	419,000
アルコニックス	900	1,161.00	1,044,900
神戸物産	3,000	4,975.00	14,925,000
ハイパー	100	543.00	54,300
あい ホールディングス	1,200	1,296.00	1,555,200
ディーブイエックス	300	924.00	277,200
ダイワボウホールディングス	700	7,070.00	4,949,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,100	1,540.00	3,234,000
ラクト・ジャパン	300	3,690.00	1,107,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,600	1,062.00	1,699,200
八洲電機	700	839.00	587,300
メディアスホールディングス	500	910.00	455,000

レスターホールディングス	900	1,916.00	1,724,400
ジューテックホールディングス	200	992.00	198,400
大光	400	699.00	279,600
OCHIホールディングス	300	1,395.00	418,500
TOKAIホールディングス	4,600	967.00	4,448,200
黒谷	200	434.00	86,800
Cominix	200	738.00	147,600
三洋貿易	900	877.00	789,300
ビューティガレージ	100	1,661.00	166,100
ウイン・パートナーズ	600	886.00	531,600
ミタチ産業	300	616.00	184,800
シップヘルスケアホールディングス	1,400	4,660.00	6,524,000
明治電機工業	300	1,304.00	391,200
デリカフーズホールディングス	300	618.00	185,400
スターティアホールディングス	200	547.00	109,400
コメダホールディングス	1,900	1,767.00	3,357,300
ピーバンドットコム	100	947.00	94,700
アセンテック	100	2,980.00	298,000
富士興産	300	403.00	120,900
協栄産業	100	1,121.00	112,100
小野建	800	1,200.00	960,000
南陽	200	1,418.00	283,600
佐島電機	600	841.00	504,600
エコートレーディング	200	508.00	101,600
伯東	500	959.00	479,500
コンドーテック	700	1,007.00	704,900
中山福	500	464.00	232,000
ナガイレーベン	1,200	2,600.00	3,120,000
三菱食品	1,000	2,509.00	2,509,000
松田産業	600	1,377.00	826,200
第一興商	1,300	3,400.00	4,420,000
メディバルホールディングス	9,400	1,970.00	18,518,000
SPK	400	1,343.00	537,200
萩原電気ホールディングス	300	2,093.00	627,900
アズワン	600	10,790.00	6,474,000
スズデン	300	1,173.00	351,900
尾家産業	300	1,470.00	441,000
シモジマ	500	1,293.00	646,500
ドウシシャ	800	1,507.00	1,205,600
小津産業	200	1,937.00	387,400
高速	500	1,322.00	661,000
たけびし	300	1,378.00	413,400

リックス	200	1,404.00	280,800
丸文	800	499.00	399,200
ハビネット	700	1,025.00	717,500
橋本総業ホールディングス	200	1,884.00	376,800
日本ライフライン	2,600	1,280.00	3,328,000
タカショー	600	474.00	284,400
マルカ	300	1,835.00	550,500
I D O M	2,400	431.00	1,034,400
進和	500	1,715.00	857,500
エスケイジャパン	200	311.00	62,200
ダイترون	400	1,597.00	638,800
シークス	1,100	992.00	1,091,200
田中商事	300	677.00	203,100
オーハシテクニカ	500	1,430.00	715,000
白銅	300	1,305.00	391,500
伊藤忠商事	61,100	2,180.00	133,198,000
丸紅	90,900	465.00	42,268,500
高島	100	1,609.00	160,900
長瀬産業	4,900	1,292.00	6,330,800
蝶理	600	1,709.00	1,025,400
豊田通商	9,700	2,439.00	23,658,300
三共生興	1,300	423.00	549,900
兼松	3,300	1,178.00	3,887,400
ツカモトコーポレーション	200	1,117.00	223,400
三井物産	76,800	1,534.00	117,811,200
日本紙パルプ商事	500	3,610.00	1,805,000
カメイ	1,100	1,016.00	1,117,600
東都水産	100	2,971.00	297,100
O U Gホールディングス	100	2,561.00	256,100
スターゼン	300	4,335.00	1,300,500
山善	3,400	889.00	3,022,600
椿本興業	200	3,230.00	646,000
住友商事	55,100	1,230.50	67,800,550
内田洋行	300	5,280.00	1,584,000
三菱商事	61,300	2,322.00	142,338,600
第一実業	400	3,590.00	1,436,000
キャノンマーケティングジャパン	2,200	2,078.00	4,571,600
西華産業	500	1,133.00	566,500
佐藤商事	700	877.00	613,900
菱洋エレクトロ	900	2,595.00	2,335,500
東京産業	800	537.00	429,600
ユアサ商事	800	2,911.00	2,328,800

神鋼商事	200	1,838.00	367,600
トルク	500	288.00	144,000
阪和興業	1,600	1,733.00	2,772,800
正栄食品工業	600	3,990.00	2,394,000
カナデン	700	1,256.00	879,200
菱電商事	600	1,334.00	800,400
フルサト工業	500	1,346.00	673,000
岩谷産業	1,900	3,730.00	7,087,000
ナイス	400	800.00	320,000
昭光通商	300	590.00	177,000
ニチモウ	100	1,660.00	166,000
極東貿易	300	1,326.00	397,800
イワキ	1,100	442.00	486,200
三愛石油	2,100	1,007.00	2,114,700
稲畑産業	1,900	1,197.00	2,274,300
G S Iクレオス	200	1,051.00	210,200
明和産業	800	482.00	385,600
クワザワ	300	509.00	152,700
ヤマエ久野	600	1,233.00	739,800
ワキタ	1,900	959.00	1,822,100
東邦ホールディングス	2,800	2,013.00	5,636,400
サンゲツ	2,400	1,533.00	3,679,200
ミツウロコグループホールディングス	1,300	1,192.00	1,549,600
シナネンホールディングス	400	2,768.00	1,107,200
伊藤忠エネクス	1,900	801.00	1,521,900
サンリオ	2,500	1,663.00	4,157,500
サンワテクノス	600	815.00	489,000
リョーサン	1,000	2,315.00	2,315,000
新光商事	1,400	871.00	1,219,400
トーホー	400	1,798.00	719,200
三信電気	500	1,546.00	773,000
東陽テクニカ	900	1,039.00	935,100
モスフードサービス	1,100	2,892.00	3,181,200
加賀電子	900	2,045.00	1,840,500
ソーダニッカ	900	569.00	512,100
立花エレテック	600	1,615.00	969,000
フォーバル	400	1,150.00	460,000
P A L T A C	1,400	5,170.00	7,238,000
三谷産業	1,100	383.00	421,300
太平洋興発	300	610.00	183,000
西本W i s m e t t a cホールディングス	200	1,851.00	370,200
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,924.00	192,400

国際紙パルプ商事	2,100	292.00	613,200
ヤマタネ	400	1,244.00	497,600
丸紅建材リース	100	1,444.00	144,400
日鉄物産	600	3,220.00	1,932,000
泉州電業	300	2,348.00	704,400
トラスコ中山	1,800	2,433.00	4,379,400
オートバックスセブン	3,200	1,263.00	4,041,600
モリト	600	676.00	405,600
加藤産業	1,300	3,525.00	4,582,500
北恵	200	819.00	163,800
イノテック	500	921.00	460,500
イエローハット	1,600	1,446.00	2,313,600
J Kホールディングス	800	782.00	625,600
日伝	800	2,090.00	1,672,000
北沢産業	600	275.00	165,000
杉本商事	500	1,737.00	868,500
因幡電機産業	2,500	2,233.00	5,582,500
東テク	300	2,030.00	609,000
ミスミグループ本社	10,900	2,609.00	28,438,100
アルテック	700	209.00	146,300
タキヒヨー	300	1,721.00	516,300
蔵王産業	200	1,414.00	282,800
スズケン	3,700	3,670.00	13,579,000
ジェコス	600	905.00	543,000
グローセル	900	422.00	379,800
ローソン	2,200	5,460.00	12,012,000
サンエー	700	4,000.00	2,800,000
カワチ薬品	700	2,459.00	1,721,300
エービーシー・マート	1,400	5,930.00	8,302,000
ハードオフコーポレーション	300	647.00	194,100
アスクル	900	3,465.00	3,118,500
ゲオホールディングス	1,600	1,347.00	2,155,200
アダストリア	1,200	1,580.00	1,896,000
ジーフット	500	456.00	228,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	100	412.00	41,200
くら寿司	500	4,595.00	2,297,500
キャンドウ	400	1,910.00	764,000
パルグループホールディングス	900	1,275.00	1,147,500
エディオン	4,000	939.00	3,756,000
サーラコーポレーション	1,800	556.00	1,000,800
ワッツ	400	651.00	260,400
ハローズ	300	2,923.00	876,900

フジオフードシステム	700	1,372.00	960,400
あみやき亭	200	3,020.00	604,000
ひらまつ	1,500	155.00	232,500
大黒天物産	200	4,225.00	845,000
ハニーズホールディングス	800	1,165.00	932,000
ファーマライズホールディングス	200	666.00	133,200
アルペン	700	1,632.00	1,142,400
ハブ	200	682.00	136,400
クオールホールディングス	1,300	1,125.00	1,462,500
ジーンズホールディングス	500	6,460.00	3,230,000
ビックカメラ	5,200	1,017.00	5,288,400
D C Mホールディングス	4,800	1,073.00	5,150,400
ペッパーフードサービス	800	468.00	374,400
Monotaro	6,200	3,815.00	23,653,000
東京一番フーズ	200	475.00	95,000
D Dホールディングス	300	884.00	265,200
きちりホールディングス	200	609.00	121,800
アークランドサービスホールディングス	600	1,837.00	1,102,200
J . フロント リテイリング	10,400	860.00	8,944,000
ドトール・日レスホールディングス	1,400	1,730.00	2,422,000
マツモトキヨシホールディングス	3,600	3,825.00	13,770,000
ブロンコビリー	500	2,186.00	1,093,000
Z O Z O	6,000	1,993.00	11,958,000
トレジャー・ファクトリー	300	664.00	199,200
物語コーポレーション	200	7,530.00	1,506,000
ココカラファイン	900	5,250.00	4,725,000
三越伊勢丹ホールディングス	15,300	649.00	9,929,700
H a m e e	300	1,327.00	398,100
ウエルシアホールディングス	2,600	7,760.00	20,176,000
クリエイトSDホールディングス	1,500	3,095.00	4,642,500
丸善C H Iホールディングス	1,000	380.00	380,000
ミサワ	200	520.00	104,000
ティーライフ	100	937.00	93,700
エー・ピーカンパニー	200	417.00	83,400
チムニー	300	1,768.00	530,400
シュッピン	600	748.00	448,800
ネクステージ	1,300	786.00	1,021,800
ジョイフル本田	2,600	1,214.00	3,156,400
鳥貴族	300	1,710.00	513,000
キリン堂ホールディングス	300	1,993.00	597,900
ホットランド	600	1,147.00	688,200
すかいらーくホールディングス	9,800	1,650.00	16,170,000

S F Pホールディングス	500	1,499.00	749,500
綿半ホールディングス	300	1,729.00	518,700
ヨシックス	100	1,988.00	198,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	2,500	1,043.00	2,607,500
ゴルフダイジェスト・オンライン	400	509.00	203,600
B E E N O S	400	1,016.00	406,400
あさひ	700	1,402.00	981,400
日本調剤	500	1,644.00	822,000
コスモス薬品	400	28,600.00	11,440,000
トーエル	400	666.00	266,400
オンリー	100	577.00	57,700
セブン&アイ・ホールディングス	34,200	3,476.00	118,879,200
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,700	722.00	3,393,400
ツルハホールディングス	1,900	14,280.00	27,132,000
サンマルクホールディングス	700	1,782.00	1,247,400
フェリシモ	200	983.00	196,600
トリドールホールディングス	2,200	1,329.00	2,923,800
T O K Y O B A S E	800	324.00	259,200
ウイルプラスホールディングス	100	719.00	71,900
J Mホールディングス	700	2,456.00	1,719,200
サツドラホールディングス	100	2,030.00	203,000
アレンザホールディングス	400	851.00	340,400
串カツ田中ホールディングス	200	1,625.00	325,000
パロックジャパンリミテッド	600	594.00	356,400
クスリのアオキホールディングス	800	8,440.00	6,752,000
力の源ホールディングス	400	683.00	273,200
スシローグローバルホールディングス	4,800	1,988.00	9,542,400
L I X I L ビバ	900	1,997.00	1,797,300
メディカルシステムネットワーク	800	459.00	367,200
はるやまホールディングス	400	748.00	299,200
ノジマ	1,600	1,986.00	3,177,600
カッパ・クリエイト	1,200	1,433.00	1,719,600
ライトオン	700	523.00	366,100
ジーンズメイト	300	239.00	71,700
良品計画	11,600	1,440.00	16,704,000
三城ホールディングス	900	262.00	235,800
アドヴァン	1,300	1,119.00	1,454,700
アルビス	300	1,999.00	599,700
コナカ	1,000	313.00	313,000
ハウス オブ ローゼ	100	1,550.00	155,000
G - 7ホールディングス	500	2,139.00	1,069,500

イオン北海道	1,200	779.00	934,800
コジマ	1,500	414.00	621,000
ヒマラヤ	300	757.00	227,100
コーナン商事	1,200	2,709.00	3,250,800
エコス	300	1,857.00	557,100
ワタミ	1,000	1,106.00	1,106,000
マルシェ	200	610.00	122,000
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	19,200	2,020.00	38,784,000
西松屋チェーン	1,900	864.00	1,641,600
ゼンショーホールディングス	4,200	2,206.00	9,265,200
幸楽苑ホールディングス	600	1,620.00	972,000
ハークスレイ	200	953.00	190,600
サイゼリヤ	1,300	2,276.00	2,958,800
V Tホールディングス	3,600	292.00	1,051,200
魚力	200	1,511.00	302,200
ポプラ	200	441.00	88,200
フジ・コーポレーション	200	1,840.00	368,000
ユナイテッドアローズ	900	1,669.00	1,502,100
ハイデイ日高	1,300	1,786.00	2,321,800
京都きもの友禅	500	225.00	112,500
コロワイド	2,900	1,558.00	4,518,200
ピーシーデポコーポレーション	1,200	605.00	726,000
壱番屋	600	4,870.00	2,922,000
トップカルチャー	300	303.00	90,900
P L A N T	200	556.00	111,200
スギホールディングス	1,700	6,700.00	11,390,000
薬王堂ホールディングス	400	2,611.00	1,044,400
ヴィア・ホールディングス	1,100	464.00	510,400
スクロール	1,300	348.00	452,400
ヨンドシーホールディングス	900	1,756.00	1,580,400
ファミリーマート	7,000	1,795.00	12,565,000
木曽路	1,100	2,361.00	2,597,100
S R Sホールディングス	1,000	897.00	897,000
千趣会	1,600	352.00	563,200
タカキュー	600	137.00	82,200
ケーヨー	1,800	569.00	1,024,200
上新電機	1,000	2,102.00	2,102,000
日本瓦斯	1,400	4,180.00	5,852,000
ロイヤルホールディングス	1,500	1,702.00	2,553,000
東天紅	100	975.00	97,500
いなげや	1,100	1,653.00	1,818,300
島忠	1,600	2,746.00	4,393,600

チヨダ	900	1,028.00	925,200
ライフコーポレーション	700	3,280.00	2,296,000
リンガーハット	1,100	2,337.00	2,570,700
MrMaxHD	1,200	412.00	494,400
テンアライド	800	377.00	301,600
AOKIホールディングス	1,700	635.00	1,079,500
オークワ	1,400	1,391.00	1,947,400
コメリ	1,300	2,398.00	3,117,400
青山商事	1,800	884.00	1,591,200
しまむら	1,000	6,810.00	6,810,000
はせがわ	500	396.00	198,000
高島屋	6,400	948.00	6,067,200
松屋	1,800	590.00	1,062,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,100	799.00	3,275,900
近鉄百貨店	300	2,775.00	832,500
丸井グループ	8,000	1,670.00	13,360,000
アクシアル リテイリング	700	3,800.00	2,660,000
井筒屋	500	172.00	86,000
イオン	33,600	2,210.50	74,272,800
イズミ	1,800	3,195.00	5,751,000
平和堂	1,800	1,794.00	3,229,200
フジ	1,100	1,797.00	1,976,700
ヤオコー	1,000	6,710.00	6,710,000
ゼビオホールディングス	1,100	899.00	988,900
ケーズホールディングス	8,400	1,255.00	10,542,000
Olympicグループ	500	670.00	335,000
日産東京販売ホールディングス	1,200	224.00	268,800
シルバーライフ	100	2,090.00	209,000
一家ダイニングプロジェクト	100	589.00	58,900
Genky DrugStores	400	2,471.00	988,400
ナルミヤ・インターナショナル	200	594.00	118,800
ブックオフグループホールディングス	500	780.00	390,000
アインホールディングス	1,100	6,470.00	7,117,000
元気寿司	200	2,348.00	469,600
ヤマダ電機	26,600	467.00	12,422,200
アーランドサカモト	1,400	1,077.00	1,507,800
ニトリホールディングス	3,800	17,290.00	65,702,000
グルメ杵屋	600	966.00	579,600
愛眼	700	214.00	149,800
ケーユーホールディングス	500	812.00	406,000
吉野家ホールディングス	2,900	2,314.00	6,710,600
松屋フーズホールディングス	400	3,945.00	1,578,000

サガミホールディングス	1,200	1,269.00	1,522,800
関西スーパーマーケット	700	1,099.00	769,300
王将フードサービス	600	5,940.00	3,564,000
プレナス	1,000	1,848.00	1,848,000
ミニストップ	600	1,458.00	874,800
アークス	1,800	2,005.00	3,609,000
パローホールディングス	1,900	1,968.00	3,739,200
藤久	100	872.00	87,200
ベルク	400	6,170.00	2,468,000
大庄	500	1,300.00	650,000
ファーストリテイリング	1,200	51,050.00	61,260,000
サンドラッグ	3,300	3,705.00	12,226,500
サックスパー ホールディングス	700	524.00	366,800
ヤマザワ	200	1,712.00	342,400
やまや	200	2,219.00	443,800
ペルーナ	1,900	471.00	894,900
島根銀行	200	507.00	101,400
じもとホールディングス	5,700	94.00	535,800
めぶきフィナンシャルグループ	45,400	222.00	10,078,800
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,200	1,037.00	1,244,400
九州フィナンシャルグループ	19,100	420.00	8,022,000
ゆうちょ銀行	24,800	1,044.00	25,891,200
富山第一銀行	2,100	258.00	541,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	49,900	312.00	15,568,800
西日本フィナンシャルホールディングス	5,800	622.00	3,607,600
関西みらいフィナンシャルグループ	4,900	335.00	1,641,500
三十三フィナンシャルグループ	800	1,529.00	1,223,200
第四北越フィナンシャルグループ	1,500	2,166.00	3,249,000
新生銀行	6,400	1,288.00	8,243,200
あおぞら銀行	5,200	1,780.00	9,256,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	598,200	403.90	241,612,980
りそなホールディングス	95,300	334.20	31,849,260
三井住友トラスト・ホールディングス	16,500	2,947.50	48,633,750
三井住友フィナンシャルグループ	60,500	2,709.50	163,924,750
千葉銀行	29,200	444.00	12,964,800
群馬銀行	16,800	315.00	5,292,000
武蔵野銀行	1,300	1,314.00	1,708,200
千葉興業銀行	2,400	226.00	542,400
千葉興業銀行(新)	2,300	0.00	0
筑波銀行	3,600	172.00	619,200
七十七銀行	3,000	1,426.00	4,278,000
青森銀行	700	2,194.00	1,535,800

秋田銀行	600	1,413.00	847,800
山形銀行	1,000	1,255.00	1,255,000
岩手銀行	600	2,287.00	1,372,200
東邦銀行	7,800	226.00	1,762,800
東北銀行	400	897.00	358,800
みちのく銀行	600	1,122.00	673,200
ふくおかフィナンシャルグループ	7,400	1,546.00	11,440,400
静岡銀行	21,700	621.00	13,475,700
十六銀行	1,100	1,937.00	2,130,700
スルガ銀行	8,900	346.00	3,079,400
八十二銀行	21,100	347.00	7,321,700
山梨中央銀行	1,000	807.00	807,000
大垣共立銀行	1,700	2,037.00	3,462,900
福井銀行	700	1,577.00	1,103,900
北國銀行	900	2,938.00	2,644,200
清水銀行	400	1,807.00	722,800
富山銀行	200	2,164.00	432,800
滋賀銀行	1,800	2,242.00	4,035,600
南都銀行	1,500	2,209.00	3,313,500
百五銀行	7,900	294.00	2,322,600
京都銀行	3,100	3,510.00	10,881,000
紀陽銀行	3,100	1,527.00	4,733,700
ほくほくフィナンシャルグループ	5,800	822.00	4,767,600
広島銀行	12,900	446.00	5,753,400
山陰合同銀行	5,200	486.00	2,527,200
中国銀行	7,500	914.00	6,855,000
鳥取銀行	300	1,170.00	351,000
伊予銀行	12,500	569.00	7,112,500
百十四銀行	900	1,901.00	1,710,900
四国銀行	1,300	862.00	1,120,600
阿波銀行	1,400	2,212.00	3,096,800
大分銀行	500	2,375.00	1,187,500
宮崎銀行	600	2,330.00	1,398,000
佐賀銀行	500	1,162.00	581,000
沖縄銀行	800	3,020.00	2,416,000
琉球銀行	2,000	925.00	1,850,000
セブン銀行	29,200	285.00	8,322,000
みずほフィナンシャルグループ	1,188,200	120.20	142,821,640
高知銀行	300	710.00	213,000
山口フィナンシャルグループ	10,900	564.00	6,147,600
長野銀行	300	1,044.00	313,200
名古屋銀行	700	2,082.00	1,457,400

北洋銀行	13,100	187.00	2,449,700
愛知銀行	300	3,025.00	907,500
中京銀行	400	1,993.00	797,200
大光銀行	300	1,493.00	447,900
愛媛銀行	1,200	1,130.00	1,356,000
トマト銀行	300	1,018.00	305,400
京葉銀行	3,700	478.00	1,768,600
栃木銀行	4,200	161.00	676,200
北日本銀行	300	1,754.00	526,200
東和銀行	1,500	663.00	994,500
福島銀行	800	167.00	133,600
大東銀行	500	571.00	285,500
トモニホールディングス	6,800	348.00	2,366,400
フィデアホールディングス	8,400	107.00	898,800
池田泉州ホールディングス	10,000	169.00	1,690,000
F P G	2,700	527.00	1,422,900
マーキュリアインベストメント	400	524.00	209,600
S B Iホールディングス	9,800	2,141.00	20,981,800
日本アジア投資	700	223.00	156,100
ジャフコ	1,300	3,335.00	4,335,500
大和証券グループ本社	70,200	405.60	28,473,120
野村ホールディングス	153,900	405.50	62,406,450
岡三証券グループ	7,400	303.00	2,242,200
丸三証券	2,600	410.00	1,066,000
東洋証券	3,000	123.00	369,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	10,000	216.00	2,160,000
光世証券	200	498.00	99,600
水戸証券	2,500	188.00	470,000
いちよし証券	1,600	428.00	684,800
松井証券	5,000	749.00	3,745,000
だいこう証券ビジネス	400	920.00	368,000
マネックスグループ	6,400	218.00	1,395,200
極東証券	1,200	486.00	583,200
岩井コスモホールディングス	800	898.00	718,400
藍澤證券	1,600	676.00	1,081,600
マネーパートナーズグループ	900	193.00	173,700
スパークス・グループ	4,000	183.00	732,000
小林洋行	200	242.00	48,400
かんぽ生命保険	3,100	1,283.00	3,977,300
S O M P Oホールディングス	16,400	3,111.00	51,020,400
アニコム ホールディングス	700	4,555.00	3,188,500
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	22,900	2,865.00	65,608,500

ソニーフィナンシャルホールディングス	7,200	2,004.00	14,428,800
第一生命ホールディングス	49,500	1,289.50	63,830,250
東京海上ホールディングス	30,900	4,422.00	136,639,800
T & Dホールディングス	26,100	830.00	21,663,000
アドバンスクリエイト	200	2,295.00	459,000
全国保証	2,500	3,450.00	8,625,000
ジェイリース	200	224.00	44,800
イントラスト	300	717.00	215,100
日本モーゲージサービス	200	1,725.00	345,000
C a s a	300	1,120.00	336,000
アルヒ	1,400	1,338.00	1,873,200
プレミアグループ	500	1,701.00	850,500
クレディセゾン	6,100	1,122.00	6,844,200
芙蓉総合リース	900	5,630.00	5,067,000
みずほリース	1,300	2,129.00	2,767,700
東京センチュリー	1,800	3,840.00	6,912,000
日本証券金融	3,900	486.00	1,895,400
アイフル	13,300	258.00	3,431,400
リコーリース	700	2,846.00	1,992,200
イオンフィナンシャルサービス	5,400	1,032.00	5,572,800
アコム	17,600	415.00	7,304,000
ジャックス	1,000	1,744.00	1,744,000
オリエントコーポレーション	23,500	117.00	2,749,500
日立キャピタル	2,100	1,951.00	4,097,100
アプラスフィナンシャル	4,000	65.00	260,000
オリックス	54,700	1,241.50	67,910,050
三菱UFJリース	22,200	491.00	10,900,200
九州リースサービス	400	442.00	176,800
日本取引所グループ	25,100	2,096.00	52,609,600
イー・ギャランティ	900	2,128.00	1,915,200
アサックス	500	640.00	320,000
NECキャピタルソリューション	400	1,912.00	764,800
いちご	11,100	277.00	3,074,700
日本駐車場開発	8,600	131.00	1,126,600
スター・マイカ・ホールディングス	500	1,495.00	747,500
ADワークスグループ	1,600	170.00	272,000
ヒューリック	18,700	994.00	18,587,800
三栄建築設計	400	1,173.00	469,200
野村不動産ホールディングス	5,300	1,740.00	9,222,000
三重交通グループホールディングス	1,800	453.00	815,400
サムティ	1,200	1,407.00	1,688,400
ディア・ライフ	1,200	441.00	529,200

コーセーアールイー	300	462.00	138,600
日本商業開発	600	1,480.00	888,000
プレサンスコーポレーション	1,400	1,230.00	1,722,000
ユニゾホールディングス	300	5,980.00	1,794,000
THEグローバル社	400	335.00	134,000
ハウスコム	200	1,364.00	272,800
日本管理センター	600	1,023.00	613,800
サンセイランディック	300	720.00	216,000
エストラスト	100	602.00	60,200
フージャースホールディングス	1,700	604.00	1,026,800
オープンハウス	2,500	2,389.00	5,972,500
東急不動産ホールディングス	23,800	504.00	11,995,200
飯田グループホールディングス	7,300	1,389.00	10,139,700
イーランド	100	625.00	62,500
ムゲンエステート	600	477.00	286,200
ビーロット	400	647.00	258,800
ファーストブラザーズ	200	638.00	127,600
ハウストゥ	400	846.00	338,400
シーアールイー	200	1,143.00	228,600
プロパティエージェント	100	976.00	97,600
ケイアイスター不動産	300	1,073.00	321,900
アグレ都市デザイン	100	433.00	43,300
グッドコムアセット	200	1,493.00	298,600
ジェイ・エス・ビー	200	2,315.00	463,000
テンポイノベーション	200	704.00	140,800
グローバル・リンク・マネジメント	100	584.00	58,400
パーク24	4,700	1,894.00	8,901,800
パラカ	200	1,644.00	328,800
三井不動産	43,100	1,906.50	82,170,150
三菱地所	61,300	1,580.00	96,854,000
平和不動産	1,600	2,832.00	4,531,200
東京建物	9,200	1,181.00	10,865,200
ダイビル	2,300	993.00	2,283,900
京阪神ビルディング	1,400	1,426.00	1,996,400
住友不動産	19,700	2,771.00	54,588,700
テーオーシー	1,700	662.00	1,125,400
東京楽天地	100	4,195.00	419,500
レオパレス21	11,400	244.00	2,781,600
スターツコーポレーション	1,200	1,983.00	2,379,600
フジ住宅	1,000	467.00	467,000
空港施設	900	410.00	369,000
明和地所	500	401.00	200,500

ゴールドクレスト	700	1,554.00	1,087,800
エスリード	300	1,326.00	397,800
日神グループホールディングス	1,300	389.00	505,700
日本エスコン	1,600	745.00	1,192,000
タカラレーベン	4,000	348.00	1,392,000
A V A N T I A	500	720.00	360,000
イオンモール	4,400	1,486.00	6,538,400
毎日コムネット	200	808.00	161,600
ファースト住建	400	849.00	339,600
ランド	45,600	9.00	410,400
カチタス	2,200	2,248.00	4,945,600
トーセイ	1,200	960.00	1,152,000
穴吹興産	200	1,560.00	312,000
サンフロンティア不動産	1,200	869.00	1,042,800
エフ・ジェー・ネクスト	800	791.00	632,800
インテリックス	200	533.00	106,600
ランドビジネス	300	287.00	86,100
日本社宅サービス	300	989.00	296,700
グランディハウス	700	331.00	231,700
日本空港ビルデング	2,800	4,020.00	11,256,000
日本工営	600	3,085.00	1,851,000
L I F U L L	3,000	424.00	1,272,000
ジェイエイシーリクルートメント	600	1,141.00	684,600
日本M&Aセンター	6,400	3,680.00	23,552,000
メンバーズ	200	1,633.00	326,600
中広	100	505.00	50,500
UTグループ	1,300	1,672.00	2,173,600
アイティメディア	300	957.00	287,100
タケエイ	800	820.00	656,000
E・Jホールディングス	100	1,509.00	150,900
ビーネックスグループ	1,100	747.00	821,700
コシダカホールディングス	2,000	462.00	924,000
アルトナー	200	672.00	134,400
パソナグループ	900	1,135.00	1,021,500
C D S	200	1,272.00	254,400
リンクアンドモチベーション	1,900	355.00	674,500
G C A	1,000	607.00	607,000
エス・エム・エス	2,600	2,527.00	6,570,200
サニーサイドアップグループ	300	669.00	200,700
パーソルホールディングス	8,500	1,253.00	10,650,500
リニカル	400	945.00	378,000
クックパッド	2,900	279.00	809,100

エスクリ	300	386.00	115,800
アイ・ケイ・ケイ	400	612.00	244,800
学情	300	1,199.00	359,700
スタジオアリス	400	1,509.00	603,600
シミックホールディングス	400	1,458.00	583,200
エプロ	200	1,050.00	210,000
N J S	200	1,735.00	347,000
総合警備保障	3,400	5,410.00	18,394,000
カカクコム	6,300	2,416.00	15,220,800
アイロムグループ	300	1,939.00	581,700
セントケア・ホールディング	500	419.00	209,500
サイネックス	100	628.00	62,800
ルネサンス	500	1,011.00	505,500
ディップ	1,200	2,408.00	2,889,600
オプトホールディング	500	1,416.00	708,000
新日本科学	900	637.00	573,300
ツクイ	2,000	461.00	922,000
キャリアデザインセンター	200	815.00	163,000
ベネフィット・ワン	3,100	2,125.00	6,587,500
エムスリー	18,700	3,765.00	70,405,500
ツカダ・グローバルホールディング	500	351.00	175,500
プラス	100	428.00	42,800
アウトソーシング	4,800	553.00	2,654,400
ウェルネット	900	666.00	599,400
ワールドホールディングス	300	1,704.00	511,200
ディー・エヌ・エー	4,200	1,402.00	5,888,400
博報堂D Yホールディングス	11,800	1,112.00	13,121,600
ぐるなび	1,500	591.00	886,500
タカミヤ	900	459.00	413,100
ジャパンベストレスキューシステム	700	633.00	443,100
ファンコミュニケーションズ	2,300	451.00	1,037,300
ライク	300	1,736.00	520,800
ビジネス・ブレークスルー	400	372.00	148,800
エスプール	2,200	692.00	1,522,400
W D Bホールディングス	400	2,441.00	976,400
手間いらず	100	4,455.00	445,500
ティア	500	510.00	255,000
C D G	100	1,462.00	146,200
バリューコマース	500	2,350.00	1,175,000
インフォマート	9,300	831.00	7,728,300
J Pホールディングス	2,600	270.00	702,000
エコナックホールディングス	1,500	89.00	133,500

E P S ホールディングス	1,100	1,092.00	1,201,200
レグス	200	935.00	187,000
プレステージ・インターナショナル	3,200	855.00	2,736,000
アミューズ	500	2,138.00	1,069,000
ドリームインキュベータ	300	1,447.00	434,100
クイック	500	1,109.00	554,500
T A C	500	189.00	94,500
ケネディクス	7,900	486.00	3,839,400
電通グループ	8,700	2,250.00	19,575,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	614.00	184,200
ぴあ	200	3,260.00	652,000
イオンファンタジー	300	1,779.00	533,700
シーティーエス	1,000	689.00	689,000
ネクシィーズグループ	300	961.00	288,300
みらかホールディングス	2,400	2,528.00	6,067,200
アルプス技研	700	1,788.00	1,251,600
サニックス	1,500	303.00	454,500
ダイオーズ	200	1,052.00	210,400
日本空調サービス	900	700.00	630,000
オリエンタルランド	9,000	14,255.00	128,295,000
ダスキン	2,100	2,839.00	5,961,900
明光ネットワークジャパン	1,100	809.00	889,900
ファルコホールディングス	500	1,604.00	802,000
秀英予備校	200	416.00	83,200
田谷	200	514.00	102,800
ラウンドワン	2,400	873.00	2,095,200
リゾートトラスト	3,900	1,142.00	4,453,800
ビー・エム・エル	1,100	2,674.00	2,941,400
ワタベウェディング	100	370.00	37,000
りらいあコミュニケーションズ	1,500	1,206.00	1,809,000
リソー教育	3,800	264.00	1,003,200
早稲田アカデミー	400	933.00	373,200
ユー・エス・エス	9,500	1,707.00	16,216,500
東京個別指導学院	300	586.00	175,800
サイバーエージェント	5,200	4,885.00	25,402,000
楽天	39,500	997.00	39,381,500
クリーク・アンド・リバー社	400	967.00	386,800
テー・オー・ダブリュー	1,300	300.00	390,000
山田コンサルティンググループ	500	1,162.00	581,000
セントラルスポーツ	300	2,324.00	697,200
フルキャストホールディングス	800	1,421.00	1,136,800
エン・ジャパン	1,500	2,542.00	3,813,000

リソルホールディングス	100	3,350.00	335,000
テクノプロ・ホールディングス	1,700	6,140.00	10,438,000
アトラ	200	255.00	51,000
インターワークス	200	368.00	73,600
アイ・アールジャパンホールディングス	300	6,620.00	1,986,000
K e e P e r 技研	300	1,582.00	474,600
ファーストロジック	200	610.00	122,000
三機サービス	200	1,144.00	228,800
G u n o s y	500	899.00	449,500
デザインワン・ジャパン	200	207.00	41,400
イー・ガーディアン	400	1,984.00	793,600
リブセンス	500	283.00	141,500
ジャパンマテリアル	2,600	1,700.00	4,420,000
ベクトル	1,100	692.00	761,200
ウチヤマホールディングス	400	329.00	131,600
チャーム・ケア・コーポレーション	700	937.00	655,900
ライクキッズ	100	675.00	67,500
キャリアリンク	300	482.00	144,600
I B J	600	780.00	468,000
アサンテ	300	1,453.00	435,900
N・フィールド	600	484.00	290,400
バリューHR	300	1,393.00	417,900
M&Aキャピタルパートナーズ	700	3,335.00	2,334,500
ライドオンエクスプレスホールディングス	300	1,462.00	438,600
E R Iホールディングス	200	667.00	133,400
アビスト	100	2,135.00	213,500
シグマクシス	600	1,627.00	976,200
ウィルグループ	600	629.00	377,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,100	197.00	216,700
リクルートホールディングス	60,700	3,308.00	200,795,600
エラン	500	1,711.00	855,500
土木管理総合試験所	400	332.00	132,800
ネットマーケティング	300	605.00	181,500
日本郵政	69,400	836.80	58,073,920
ベルシステム24ホールディングス	1,400	1,257.00	1,759,800
鎌倉新書	600	1,136.00	681,600
S M N	200	896.00	179,200
一蔵	100	370.00	37,000
L I T A L I C O	300	2,632.00	789,600
グローバルキッズCOMPANY	200	601.00	120,200
エアトリ	400	967.00	386,800
アトラエ	300	2,980.00	894,000

ストライク	300	4,185.00	1,255,500
ソラスト	2,300	1,159.00	2,665,700
セラク	300	887.00	266,100
インソース	400	2,408.00	963,200
ベイカレント・コンサルティング	500	6,450.00	3,225,000
Orchestra Holdings	200	912.00	182,400
アイモバイル	300	627.00	188,100
キャリアインデックス	300	290.00	87,000
MS - Japan	300	813.00	243,900
船場	100	941.00	94,100
グレイステクノロジー	400	3,850.00	1,540,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	900	2,964.00	2,667,600
フルテック	100	1,277.00	127,700
グリーンズ	200	449.00	89,800
ツナググループ・ホールディングス	100	455.00	45,500
GameWith	300	708.00	212,400
ソウルドアウト	200	2,154.00	430,800
MS&Consulting	200	556.00	111,200
ミダック	100	1,190.00	119,000
日総工産	600	643.00	385,800
キュービーネットホールディングス	300	1,912.00	573,600
RPAホールディングス	600	771.00	462,600
スプリックス	200	861.00	172,200
マネジメントソリューションズ	400	984.00	393,600
and factory	100	1,111.00	111,100
カーブスホールディングス	2,300	577.00	1,327,100
フォーラムエンジニアリング	400	779.00	311,600
アドバンテッジリスクマネジメント	400	823.00	329,200
リログループ	4,600	2,428.00	11,168,800
東祥	500	1,326.00	663,000
エイチ・アイ・エス	1,300	1,621.00	2,107,300
ラックランド	200	2,006.00	401,200
共立メンテナンス	1,400	2,903.00	4,064,200
イチネンホールディングス	900	1,138.00	1,024,200
建設技術研究所	600	1,651.00	990,600
スペース	500	1,012.00	506,000
長大	300	988.00	296,400
燦ホールディングス	400	1,076.00	430,400
スバル興業	100	7,910.00	791,000
東京テアトル	300	1,212.00	363,600
タナベ経営	200	1,240.00	248,000
ナガワ	300	7,440.00	2,232,000

よみうりランド	200	3,470.00	694,000	
東京都競馬	600	3,655.00	2,193,000	
常磐興産	300	1,410.00	423,000	
カナモト	1,400	2,103.00	2,944,200	
東京ドーム	3,400	797.00	2,709,800	
西尾レントオール	800	2,182.00	1,745,600	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	5,200	21.00	109,200	
トランス・コスモス	800	2,168.00	1,734,400	
乃村工藝社	3,600	861.00	3,099,600	
藤田観光	400	1,755.00	702,000	
KNT-CTホールディングス	500	945.00	472,500	
日本管財	900	1,825.00	1,642,500	
トーカイ	800	2,649.00	2,119,200	
白洋舎	100	2,770.00	277,000	
セコム	9,000	8,954.00	80,586,000	
セントラル警備保障	400	4,570.00	1,828,000	
丹青社	1,600	683.00	1,092,800	
メイテック	1,000	5,010.00	5,010,000	
応用地質	900	1,269.00	1,142,100	
船井総研ホールディングス	1,800	2,508.00	4,514,400	
進学会ホールディングス	300	509.00	152,700	
オオバ	600	641.00	384,600	
いであ	200	1,477.00	295,400	
学究社	200	1,119.00	223,800	
ベネッセホールディングス	2,800	3,055.00	8,554,000	
イオンディライト	1,000	2,879.00	2,879,000	
ナック	500	896.00	448,000	
ニチイ学館	1,200	1,568.00	1,881,600	
ダイセキ	1,400	2,505.00	3,507,000	
ステップ	300	1,381.00	414,300	
合 計	10,503,800		18,120,020,330	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2020年 5月15日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	9,628,034,929
コール・ローン	68,817,076
株式	26,664,488,233
投資証券	673,687,472
派生商品評価勘定	1,390,364,988
未収配当金	41,004,155
差入委託証拠金	2,521,569,860
流動資産合計	40,987,966,713
資産合計	
40,987,966,713	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,304,014
未払解約金	50,000,000
未払利息	186
その他未払費用	1,217
流動負債合計	70,305,417
負債合計	
70,305,417	
純資産の部	
元本等	
元本	34,904,199,583
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,013,461,713
元本等合計	40,917,661,296
純資産合計	40,917,661,296
負債純資産合計	40,987,966,713

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	<p>株式</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>為替予約取引</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	17,531,201,567円
期中追加設定元本額	55,415,773,179円
期中一部解約元本額	38,042,775,163円
期末元本額	34,904,199,583円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,104,048,743円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,128,114,362円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,116,555,283円
DCりそな グローバルバランス	41,336,577円
つみたてバランスファンド	1,045,601,748円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	613,440,836円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	290,164,291円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	166,835,111円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	12,344,706円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,046,386円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,626,158円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,607,060円
リスクコントロール・オープン	10,123,749円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	54,962,633円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	19,715,944円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	14,455,289,699円
Smart-i 先進国株式インデックス	2,481,657,333円
Smart-i 8資産バランス 安定型	84,012,732円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	199,766,197円
Smart-i 8資産バランス 成長型	224,182,161円

りそな・リスクコントロールファンド2019-06	427,805,843円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	385,833,835円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	217,275,693円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	156,844,098円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	780,907,369円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,574,366円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	374,313,091円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	474,580,050円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	15,633,529円
2. 計算日における受益権の総数	34,904,199,583口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1723円
(10,000口当たり純資産額)	(11,723円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	4,930,528,017	
投資証券	234,856,933	
合計	5,165,384,950	

（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）

（2020年 5月15日現在）

（単位：円）

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

	買建	12,280,966,707	-	13,651,017,878	1,370,051,171
	合計	12,280,966,707	-	13,651,017,878	1,370,051,171

(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)

(2020年 5月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	111,543,077	-	111,552,880	9,803
	ユーロ	111,543,077	-	111,552,880	9,803
	合計	111,543,077	-	111,552,880	9,803

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APACHE CORP	2,974	10.36	30,810.64	
	BAKER HUGHES COMPANY	4,558	14.00	63,812.00	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,861	18.65	53,357.65	
	CHENIERE ENERGY INC	1,608	41.78	67,182.24	
	CHEVRON CORP	13,811	90.05	1,243,680.55	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	54.85	98,565.45	
	CONOCOPHILLIPS	7,887	39.93	314,927.91	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	12.97	4,941.57	
	DEVON ENERGY CORP	3,284	11.66	38,291.44	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	38.18	63,264.26	
	EOG RESOURCES INC	4,143	47.56	197,041.08	
	EXXON MOBIL CORP	30,943	42.30	1,308,888.90	
	HALLIBURTON CO	7,683	9.95	76,445.85	
	HESS CORP	1,923	42.77	82,246.71	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	27.61	47,130.27	
	KINDER MORGAN INC	14,583	14.84	216,411.72	
	MARATHON OIL CORP	6,470	5.64	36,490.80	
	MARATHON PETROLEUM CORP	4,554	30.89	140,673.06	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	11.67	35,628.51	
	NOBLE ENERGY INC	5,029	8.45	42,520.19	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	6,265	13.76	86,206.40	
	ONEOK INC	2,897	30.71	88,966.87	
	PHILLIPS 66	3,173	71.75	227,662.75	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,162	82.21	95,528.02	
	SCHLUMBERGER LTD	9,847	16.10	158,536.70	
	TARGA RESOURCES CORP	1,839	14.19	26,095.41	
	TECHNIPFMC PLC	3,213	6.65	21,366.45	
	VALERO ENERGY CORP	2,906	59.41	172,645.46	
	WILLIAMS COS INC	8,501	18.49	157,183.49	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,597	225.62	360,315.14	
ALBEMARLE CORP	740	59.71	44,185.40		
AMCOR PLC	11,306	9.09	102,771.54		
AVERY DENNISON CORP	583	102.22	59,594.26		

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	19.55	32,961.30
BALL CORP	2,216	62.04	137,480.64
CELANESE CORP	844	76.13	64,253.72
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	24.63	38,299.65
CORTEVA INC	5,299	23.32	123,572.68
CROWN HOLDINGS INC	946	60.12	56,873.52
DOW INC	5,284	33.51	177,066.84
DUPONT DE NEMOURS INC	5,307	45.25	240,141.75
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	60.22	74,853.46
ECOLAB INC	1,877	192.44	361,209.88
FMC CORP	905	88.61	80,192.05
FREEMPORT-MCMORAN INC	13,013	8.29	107,877.77
INTERNATIONAL PAPER CO	2,600	31.57	82,082.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	708	126.05	89,243.40
LINDE PLC	3,916	179.25	701,943.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,861	53.29	99,172.69
MARTIN MARIETTA MATERIALS	436	169.01	73,688.36
MOSAIC CO/THE	3,288	10.40	34,195.20
NEWMONT CORP	5,917	66.64	394,308.88
NUCOR CORP	2,116	37.49	79,328.84
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	93.34	79,152.32
PPG INDUSTRIES INC	1,678	85.97	144,257.66
RPM INTERNATIONAL INC	905	66.47	60,155.35
SEALED AIR CORP	1,397	29.37	41,029.89
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	599	545.55	326,784.45
STEEL DYNAMICS INC	2,352	22.25	52,332.00
VULCAN MATERIALS CO	924	96.86	89,498.64
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	39.65	6,502.60
WESTROCK CO	2,274	25.23	57,373.02
3M CO	4,198	135.99	570,886.02
ACUITY BRANDS INC	445	76.25	33,931.25
AERCAP HOLDINGS NV	853	25.85	22,050.05
ALLEGION PLC	656	93.57	61,381.92
AMETEK INC	1,629	78.75	128,283.75
BOEING CO/THE	3,893	122.52	476,970.36

CARRIER GLOBAL CORP	5,978	16.55	98,935.90
CATERPILLAR INC	4,025	106.19	427,414.75
CUMMINS INC	1,042	155.51	162,041.42
DEERE & CO	2,168	126.80	274,902.40
DOVER CORP	1,026	85.49	87,712.74
EATON CORP PLC	2,988	74.91	223,831.08
EMERSON ELECTRIC CO	4,394	53.38	234,551.72
FASTENAL CO	4,114	38.68	159,129.52
FLOWSERVE CORP	1,171	22.98	26,909.58
FORTIVE CORP	2,147	55.76	119,716.72
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	51.64	57,010.56
GENERAL DYNAMICS CORP	1,779	132.91	236,446.89
GENERAL ELECTRIC CO	63,622	5.70	362,645.40
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	26.73	40,736.52
HEICO CORP	242	85.95	20,799.90
HEICO CORP-CLASS A	819	69.11	56,601.09
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	5,218	127.05	662,946.90
HOWMET AEROSPACE INC	3,134	11.25	35,257.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	172.22	49,771.58
IDEX CORP	537	149.03	80,029.11
ILLINOIS TOOL WORKS	2,337	154.85	361,884.45
INGERSOLL-RAND INC	2,498	26.71	66,721.58
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	71.60	77,256.40
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,600	43.82	70,112.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	20.79	47,817.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	5,541	28.59	158,417.19
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	1,604	177.84	285,255.36
LENNOX INTERNATIONAL INC	245	184.49	45,200.05
LOCKHEED MARTIN CORP	1,854	356.28	660,543.12
MASCO CORP	2,007	41.39	83,069.73
MIDDLEBY CORP	299	59.57	17,811.43
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,165	311.93	363,398.45
OTIS WORLDWIDE CORP	2,989	48.00	143,472.00
OWENS CORNING	860	40.61	34,924.60
PACCAR INC	2,481	66.61	165,259.41

PARKER HANNIFIN CORP	912	151.07	137,775.84
PENTAIR PLC	1,289	33.41	43,065.49
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	11,104	53.86	598,061.44
ROCKWELL AUTOMATION INC	823	191.01	157,201.23
ROPER TECHNOLOGIES INC	753	357.49	269,189.97
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	33.18	55,808.76
SMITH (A.O.) CORP	762	40.28	30,693.36
SNAP-ON INC	437	123.89	54,139.93
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,077	17.95	19,332.15
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,075	104.45	112,283.75
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	258	314.73	81,200.34
TEXTRON INC	1,613	23.97	38,663.61
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,720	78.32	134,710.40
TRANSDIGM GROUP INC	341	330.44	112,680.04
UNITED RENTALS INC	621	116.06	72,073.26
WABCO HOLDINGS INC	362	135.09	48,902.58
WABTEC CORP	1,287	52.14	67,104.18
WW GRAINGER INC	323	277.02	89,477.46
XYLEM INC	1,273	58.95	75,043.35
CINTAS CORP	633	228.71	144,773.43
COPART INC	1,501	80.32	120,560.32
COSTAR GROUP INC	265	647.46	171,576.90
EQUIFAX INC	870	145.04	126,184.80
IHS MARKIT LTD	2,754	65.68	180,882.72
MANPOWERGROUP INC	288	64.90	18,691.20
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	12.85	35,119.05
REPUBLIC SERVICES INC	1,609	79.99	128,703.91
ROBERT HALF INTL INC	673	44.61	30,022.53
ROLLINS INC	1,190	40.26	47,909.40
TRANSUNION	1,344	74.34	99,912.96
VERISK ANALYTICS INC	1,125	153.90	173,137.50
WASTE CONNECTIONS INC	1,908	91.40	174,391.20
WASTE MANAGEMENT INC	3,091	97.18	300,383.38
AMERCO	106	290.23	30,764.38
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	9.15	1,811.70

C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	973	72.18	70,231.14
CSX CORP	5,322	62.97	335,126.34
DELTA AIR LINES INC	1,316	19.38	25,504.08
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,175	72.98	85,751.50
FEDEX CORP	1,768	109.11	192,906.48
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	98.69	72,438.46
KANSAS CITY SOUTHERN	684	134.11	91,731.24
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	37.66	39,317.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,875	166.59	312,356.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	781	148.15	115,705.15
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	24.78	22,500.24
UBER TECHNOLOGIES INC	3,921	32.79	128,569.59
UNION PACIFIC CORP	5,051	152.44	769,974.44
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	364	20.30	7,389.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	5,092	91.69	466,885.48
XPO LOGISTICS INC	977	64.39	62,909.03
APTIV PLC	2,242	63.15	141,582.30
AUTOLIV INC	743	57.40	42,648.20
BORGWARNER INC	2,199	27.81	61,154.19
FORD MOTOR CO	27,285	4.89	133,423.65
GENERAL MOTORS CO	9,091	22.31	202,820.21
HARLEY-DAVIDSON INC	1,270	19.55	24,828.50
LEAR CORP	352	94.96	33,425.92
TESLA INC	976	803.33	784,050.08
CAPRI HOLDINGS LTD	1,619	13.01	21,063.19
DR HORTON INC	2,408	46.16	111,153.28
GARMIN LTD	915	77.30	70,729.50
HANESBRANDS INC	4,021	8.53	34,299.13
HASBRO INC	1,095	64.62	70,758.90
LEGGETT & PLATT INC	1,466	27.03	39,625.98
LENNAR CORP-A	1,925	48.75	93,843.75
LULULEMON ATHLETICA INC	775	237.57	184,116.75
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	75.96	42,841.44
NEWELL RUBBERMAID INC	2,767	11.62	32,152.54
NIKE INC -CL B	9,068	86.55	784,835.40

NVR INC	24	2,800.06	67,201.44
POLARIS INC	641	70.98	45,498.18
PULTEGROUP INC	2,237	27.59	61,718.83
PVH CORP	792	41.23	32,654.16
RALPH LAUREN CORP	478	65.87	31,485.86
TAPESTRY INC	2,976	12.41	36,932.16
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	7.71	3,153.39
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,055	6.91	7,290.05
VF CORP	2,398	55.44	132,945.12
WHIRLPOOL CORP	435	107.96	46,962.60
ARAMARK	2,216	23.38	51,810.08
CARNIVAL CORP	3,704	12.27	45,448.08
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	182	932.18	169,656.76
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	66.66	73,525.98
DOMINO'S PIZZA INC	267	376.01	100,394.67
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,871	68.17	127,546.07
LAS VEGAS SANDS CORP	2,391	45.68	109,220.88
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,954	79.25	154,854.50
MCDONALD'S CORP	5,488	175.41	962,650.08
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	15.36	16,896.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	13.52	62,029.76
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	1,591	10.76	17,119.16
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	35.15	55,115.20
STARBUCKS CORP	8,572	74.19	635,956.68
VAIL RESORTS INC	293	164.57	48,219.01
WYNN RESORTS LTD	1,017	78.30	79,631.10
YUM! BRANDS INC	2,130	83.29	177,407.70
ACTIVISION BLIZZARD INC	5,507	72.96	401,790.72
ALPHABET INC-CL A	2,193	1,356.86	2,975,593.98
ALPHABET INC-CL C	2,263	1,356.13	3,068,922.19
ALTICE USA INC- A	872	23.01	20,064.72
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,084	497.44	539,224.96
COMCAST CORP-CLASS A	33,118	35.76	1,184,299.68
DISCOVERY INC - A	1,722	20.54	35,369.88
DISCOVERY INC-C	3,336	18.50	61,716.00

DISH NETWORK CORP-A	2,183	24.62	53,745.46
ELECTRONIC ARTS INC	2,062	117.12	241,501.44
FACEBOOK INC-A	17,614	206.81	3,642,751.34
FOX CORP - CLASS A	2,378	25.77	61,281.06
FOX CORP- CLASS B	1,836	25.12	46,120.32
IAC/INTERACTIVECORP	529	236.22	124,960.38
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	15.36	56,663.04
LIBERTY BROADBAND-C	717	122.72	87,990.24
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	21.76	28,418.56
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	21.30	74,613.90
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	30.15	64,912.95
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	30.57	53,711.49
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	30.71	29,051.66
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	39.19	61,293.16
MATCH GROUP INC	610	77.37	47,195.70
NETFLIX INC	3,194	441.95	1,411,588.30
NEWS CORP - CLASS A	2,810	10.73	30,151.30
OMNICOM GROUP	1,467	50.24	73,702.08
PINTEREST INC- CLASS A	1,570	17.06	26,784.20
ROKU INC	751	116.60	87,566.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.28	54,895.29
SNAP INC - A	6,244	16.93	105,710.92
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	763	131.53	100,357.39
TRIPADVISOR INC	467	15.61	7,289.87
TWITTER INC	5,080	28.56	145,084.80
VIACOMCBS INC - CLASS B	4,599	17.16	78,918.84
WALT DISNEY CO/THE	13,148	105.91	1,392,504.68
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	47.46	66,823.68
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	121.13	71,103.31
AMAZON.COM INC	3,092	2,388.85	7,386,324.20
AUTOZONE INC	171	1,055.58	180,504.18
BEST BUY CO INC	1,687	77.19	130,219.53
BOOKING HOLDINGS INC	305	1,382.51	421,665.55
BURLINGTON STORES INC	580	166.28	96,442.40
CARMAX INC	1,166	75.17	87,648.22

DOLLAR GENERAL CORP	1,867	181.50	338,860.50
DOLLAR TREE INC	1,693	75.53	127,872.29
EBAY INC	5,580	42.03	234,555.30
EXPEDIA GROUP INC	988	64.37	63,597.56
GAP INC/THE	2,396	7.17	17,179.32
GENUINE PARTS CO	1,255	71.00	89,105.00
GRUBHUB INC	988	54.72	54,063.36
HOME DEPOT INC	7,988	234.48	1,873,026.24
KOHL'S CORP	1,564	16.69	26,103.16
LKQ CORP	2,845	23.54	66,971.30
LOWE'S COS INC	5,593	110.39	617,411.27
MERCADOLIBRE INC	322	777.27	250,280.94
NORDSTROM INC	1,281	15.61	19,996.41
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	545	398.60	217,237.00
ROSS STORES INC	2,607	84.52	220,343.64
TARGET CORP	3,691	119.94	442,698.54
TIFFANY & CO	766	127.28	97,496.48
TJX COMPANIES INC	8,803	44.74	393,846.22
TRACTOR SUPPLY COMPANY	839	106.83	89,630.37
ULTA BEAUTY INC	498	200.96	100,080.57
WAYFAIR INC- CLASS A	341	172.94	58,972.54
COSTCO WHOLESALE CORP	3,241	299.74	971,457.34
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	4.85	485.00
KROGER CO	5,869	32.78	192,385.82
SYSCO CORP	3,541	47.98	169,897.18
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,559	38.85	215,967.15
WALMART INC	10,435	123.42	1,287,887.70
ALTRIA GROUP INC	13,627	36.25	493,978.75
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,987	34.16	136,195.92
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,204	65.56	144,494.24
BUNGE LTD	1,423	34.77	49,477.71
CAMPBELL SOUP CO	1,169	52.97	61,921.93
COCA-COLA CO/THE	29,804	43.70	1,302,434.80
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,555	35.95	55,902.25
CONAGRA BRANDS INC	3,745	33.83	126,693.35

CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,202	157.96	189,867.92
GENERAL MILLS INC	4,380	62.21	272,479.80
HERSHEY CO/THE	1,060	131.03	138,891.80
HORMEL FOODS CORP	2,088	47.58	99,347.04
INGREDION INC	744	78.15	58,143.60
JM SMUCKER CO/THE	810	114.07	92,396.70
KELLOGG CO	1,830	63.65	116,479.50
KRAFT HEINZ CO/THE	4,792	28.80	138,009.60
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	54.51	70,863.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	884	175.52	155,159.68
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	36.29	53,092.27
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	10,498	49.52	519,860.96
MONSTER BEVERAGE CORP	2,901	64.99	188,535.99
PEPSICO INC	10,209	133.08	1,358,613.72
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	11,370	67.96	772,705.20
TYSON FOODS INC-CL A	2,093	59.16	123,821.88
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,785	72.80	129,948.00
CLOROX COMPANY	915	206.21	188,682.15
COLGATE-PALMOLIVE CO	5,960	67.06	399,677.60
COTY INC-CL A	2,506	3.36	8,420.16
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,626	164.19	266,972.94
KIMBERLY-CLARK CORP	2,508	136.59	342,567.72
PROCTER & GAMBLE CO/THE	18,296	113.81	2,082,267.76
ABBOTT LABORATORIES	12,959	91.78	1,189,377.02
ABIOMED INC	325	184.27	59,887.75
ALIGN TECHNOLOGY INC	539	206.09	111,082.51
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,113	84.03	93,525.39
ANTHEM INC	1,853	273.28	506,387.84
BAXTER INTERNATIONAL INC	3,540	86.92	307,696.80
BECTON DICKINSON AND CO	1,978	258.70	511,708.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	10,168	35.50	360,964.00
CARDINAL HEALTH INC	2,109	47.30	99,755.70
CENTENE CORP	4,253	65.84	280,017.52
CERNER CORP	2,277	65.59	149,348.43
CIGNA CORP	2,729	184.46	503,391.34

COOPER COS INC/THE	357	296.54	105,864.78
CVS HEALTH CORP	9,520	62.31	593,191.20
DANAHER CORP	4,581	161.66	740,564.46
DAVITA INC	653	78.14	51,025.42
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	37.88	77,578.24
DEXCOM INC	663	403.05	267,222.15
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,521	217.45	330,741.45
HCA HEALTHCARE INC	1,967	99.17	195,067.39
HENRY SCHEIN INC	1,305	52.00	67,860.00
HOLOGIC INC	1,929	51.41	99,169.89
HUMANA INC	965	385.81	372,306.65
IDEXX LABORATORIES INC	621	294.99	183,188.79
INSULET CORP	445	201.56	89,694.20
INTUITIVE SURGICAL INC	844	517.27	436,575.88
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	698	163.75	114,297.50
MCKESSON CORP	1,174	129.42	151,939.08
MEDTRONIC PLC	9,816	93.82	920,937.12
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,176	110.47	129,912.72
RESMED INC	1,044	162.96	170,130.24
STERIS PLC	740	150.89	111,658.60
STRYKER CORP	2,461	179.38	441,454.18
TELEFLEX INC	333	334.35	111,338.55
UNITEDHEALTH GROUP INC	6,946	290.61	2,018,577.06
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	91.48	59,736.44
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	716	114.04	81,652.64
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	953	196.03	186,816.59
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	532	210.35	111,906.20
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,489	112.10	166,916.90
ABBVIE INC	12,904	89.94	1,160,585.76
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,243	81.64	183,118.52
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,601	100.92	161,572.92
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	800	136.20	108,960.00
AMGEN INC	4,352	237.98	1,035,688.96
BEIGENE LTD-ADR	300	163.24	48,972.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	160	457.76	73,241.60

BIOGEN INC	1,318	315.82	416,250.76
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,292	91.79	118,592.68
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	17,168	63.77	1,094,803.36
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,830	19.38	74,225.40
ELI LILLY & CO	6,329	158.38	1,002,387.02
EXACT SCIENCES CORP	1,138	85.43	97,219.34
GILEAD SCIENCES INC	9,262	77.23	715,304.26
ILLUMINA INC	1,070	322.99	345,599.30
INCYTE CORP	1,315	94.83	124,701.45
IONIS PHARMACEUTICALS INC	958	52.33	50,132.14
IQVIA HOLDINGS INC	1,189	132.37	157,387.93
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	406	108.80	44,172.80
JOHNSON & JOHNSON	19,304	147.64	2,850,042.56
MERCK & CO. INC.	18,661	80.05	1,493,813.05
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	176	689.53	121,357.28
MYLAN NV	4,542	15.22	69,129.24
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	628	111.65	70,116.20
PERKINELMER INC	797	91.97	73,300.09
PERRIGO CO PLC	998	51.99	51,886.02
PFIZER INC	40,562	37.92	1,538,111.04
REGENERON PHARMACEUTICALS	590	570.86	336,807.40
SAREPTA THERAPEUTICS INC	535	127.05	67,971.75
SEATTLE GENETICS INC	860	160.09	137,677.40
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,561	10.97	104,884.17
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2,937	337.29	990,620.73
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,878	277.00	520,206.00
WATERS CORP	535	180.28	96,449.80
ZOETIS INC	3,495	126.03	440,474.85
BANK OF AMERICA CORP	62,549	21.71	1,357,938.79
CITIGROUP INC	15,925	42.06	669,805.50
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	20.15	72,943.00
COMERICA INC	1,325	31.56	41,817.00
EAST WEST BANCORP INC	1,540	31.77	48,925.80
FIFTH THIRD BANCORP	4,985	16.33	81,405.05
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,192	96.18	114,646.56

HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	7.71	69,328.32
JPMORGAN CHASE & CO	22,979	87.52	2,011,122.08
KEYCORP	8,597	9.92	85,282.24
M & T BANK CORP	886	92.38	81,848.68
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	10.91	37,344.93
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3,174	97.84	310,544.16
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	9.34	81,024.50
SIGNATURE BANK	590	91.01	53,695.90
SVB FINANCIAL GROUP	416	173.28	72,084.48
TRUIST FINANCIAL CORP	9,715	32.06	311,462.90
US BANCORP	10,780	31.17	336,012.60
WELLS FARGO & CO	29,362	24.06	706,449.72
ZIONS BANCORPORATION	1,197	27.54	32,965.38
ALLY FINANCIAL INC	3,571	15.11	53,957.81
AMERICAN EXPRESS CO	5,054	83.81	423,575.74
AMERIPRISE FINANCIAL INC	890	122.60	109,114.00
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	5,961	32.44	193,374.84
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	9,625	170.93	1,645,201.25
BLACKROCK INC	840	498.20	418,488.00
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	4,747	50.60	240,198.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,334	59.16	197,239.44
CBOE GLOBAL MARKETS INC	778	99.34	77,286.52
CME GROUP INC	2,604	180.52	470,074.08
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	39.23	109,844.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	38.80	75,388.40
EATON VANCE CORP	1,192	34.33	40,921.36
EQUITABLE HOLDINGS INC	2,938	16.35	48,036.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	279.10	96,010.40
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	18.03	49,366.14
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,312	174.45	403,328.40
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	4,034	93.25	376,170.50
INVESCO LTD	2,612	6.99	18,257.88
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,716	12.82	34,819.12
KKR & CO INC -A	4,300	24.85	106,855.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	266	493.60	131,297.60

MOODY'S CORP	1,226	253.87	311,244.62
MORGAN STANLEY	8,788	37.81	332,274.28
MSCI INC	605	342.05	206,940.25
NASDAQ INC	805	109.48	88,131.40
NORTHERN TRUST CORP	1,421	72.26	102,681.46
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	62.02	65,307.06
S&P GLOBAL INC	1,774	300.12	532,412.88
SCHWAB (CHARLES) CORP	8,355	33.40	279,057.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	896	50.64	45,373.44
STATE STREET CORP	2,586	54.70	141,454.20
SYNCHRONY FINANCIAL	4,080	17.07	69,645.60
T ROWE PRICE GROUP INC	1,681	112.57	189,230.17
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,896	34.42	65,260.32
VOYA FINANCIAL INC	845	40.41	34,146.45
AFLAC INC	5,251	32.76	172,022.76
ALLEGHANY CORP	101	460.77	46,537.77
ALLSTATE CORP	2,332	93.92	219,021.44
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	55.30	42,912.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	6,201	25.76	159,737.76
AON PLC	1,696	193.93	328,905.28
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,854	22.85	65,213.90
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,321	86.49	114,253.29
ASSURANT INC	506	89.05	45,059.30
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	24.49	31,102.30
BROWN & BROWN INC	1,686	36.91	62,230.26
CHUBB LTD	3,292	98.85	325,414.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,099	50.48	55,477.52
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	162.35	23,703.10
EVEREST RE GROUP LTD	313	161.72	50,618.36
FNF GROUP	1,937	25.18	48,773.66
GLOBE LIFE INC	921	67.37	62,047.77
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,122	33.30	103,962.60
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	32.50	66,950.00
LOEWS CORP	1,885	29.09	54,834.65
MARKEL CORP	97	813.18	78,878.46

MARSH & MCLENNAN COS	3,662	106.10	388,538.20
METLIFE INC	5,615	31.83	178,725.45
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	33.62	82,335.38
PROGRESSIVE CORP	4,243	73.74	312,878.82
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,876	53.38	153,520.88
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	85.44	40,156.80
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	357	154.46	55,142.22
TRAVELERS COS INC/THE	1,852	90.22	167,087.44
UNUM GROUP	1,141	13.82	15,768.62
WILLIS TOWERS WATSON PLC	922	201.66	185,930.52
WR BERKLEY CORP	1,291	47.40	61,193.40
CBRE GROUP INC - A	2,186	35.85	78,368.10
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	8,400	3.92	32,928.00
JONES LANG LASALLE INC	468	85.76	40,135.68
ACCENTURE PLC-CL A	4,639	179.99	834,973.61
ADOBE INC	3,542	355.39	1,258,791.38
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,152	97.23	112,008.96
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	259	39.38	10,199.42
ANSYS INC	603	252.15	152,046.45
AUTODESK INC	1,588	177.87	282,457.56
AUTOMATIC DATA PROCESSING	3,148	134.95	424,822.60
BLACK KNIGHT INC	1,055	72.96	76,972.80
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	990	69.92	69,220.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	809	114.87	92,929.83
CADENCE DESIGN SYS INC	1,998	81.85	163,536.30
CDK GLOBAL INC	1,236	36.67	45,324.12
CHECK POINT SOFTWARE TECH	807	104.85	84,613.95
CITRIX SYSTEMS INC	930	146.06	135,835.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,949	50.74	200,372.26
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	279	97.76	27,275.04
DOCUSIGN INC	745	122.01	90,897.45
DROPBOX INC-CLASS A	1,047	21.50	22,510.50
DXC TECHNOLOGY CO	2,725	15.15	41,283.75
EPAM SYSTEMS INC	480	209.03	100,334.40
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	4,479	129.77	581,239.83

FISERV INC	4,201	99.32	417,243.32
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	620	221.52	137,342.40
FORTINET INC	1,025	138.06	141,511.50
GARTNER INC	792	110.64	87,626.88
GLOBAL PAYMENTS INC	2,181	164.31	358,360.11
GODADDY INC - CLASS A	1,543	76.21	117,592.03
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	582	92.17	53,642.94
INTL BUSINESS MACHINES CORP	6,469	116.95	756,549.55
INTUIT INC	1,896	280.27	531,391.92
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	544	185.23	100,765.12
LEIDOS HOLDINGS INC	948	95.83	90,846.84
MASTERCARD INC-CLASS A	6,575	277.31	1,823,313.25
MICROSOFT CORP	53,174	180.53	9,599,502.22
MONGODB INC	444	194.32	86,278.08
NORTONLIFELOCK INC	4,396	20.93	92,008.28
OKTA INC	752	177.32	133,344.64
ORACLE CORP	16,796	52.91	888,676.36
PALO ALTO NETWORKS INC	694	219.57	152,381.58
PAYCHEX INC	2,312	63.13	145,956.56
PAYCOM SOFTWARE INC	437	252.81	110,477.97
PAYPAL HOLDINGS INC	8,151	144.41	1,177,085.91
PTC INC	1,110	64.96	72,105.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	530	271.55	143,921.50
SABRE CORP	2,780	5.69	15,818.20
SALESFORCE.COM INC	6,090	167.00	1,017,030.00
SERVICENOW INC	1,372	367.83	504,662.76
SPLUNK INC	1,101	151.54	166,845.54
SQUARE INC - A	2,464	78.20	192,684.80
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	54.57	109,194.57
SYNOPSIS INC	1,074	157.83	169,509.42
TWILIO INC - A	835	191.86	160,203.10
TYLER TECHNOLOGIES INC	275	334.04	91,861.00
VERISIGN INC	755	214.96	162,294.80
VISA INC-CLASS A SHARES	12,549	180.90	2,270,114.10
VMWARE INC-CLASS A	730	133.82	97,688.60

WESTERN UNION CO	2,957	18.38	54,349.66
WIX.COM LTD	437	189.59	82,850.83
WORKDAY INC-CLASS A	1,174	155.23	182,240.02
AMPHENOL CORP-CL A	2,116	83.28	176,220.48
APPLE INC	32,598	309.54	10,090,384.92
ARISTA NETWORKS INC	373	205.59	76,685.07
ARROW ELECTRONICS INC	902	61.43	55,409.86
CDW CORP/DE	1,006	99.70	100,298.20
CISCO SYSTEMS INC	31,028	43.85	1,360,577.80
COGNEX CORP	1,193	56.23	67,082.39
CORNING INC	5,453	19.94	108,732.82
DELL TECHNOLOGIES -C	1,389	41.86	58,143.54
F5 NETWORKS INC	613	137.12	84,054.56
FLEX LTD	4,584	9.29	42,585.36
FLIR SYSTEMS INC	1,041	44.52	46,345.32
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	9,037	9.17	82,869.29
HP INC	10,561	14.51	153,240.11
IPG PHOTONICS CORP	259	146.02	37,819.18
JUNIPER NETWORKS INC	2,337	22.92	53,564.04
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1,329	98.70	131,172.30
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,230	127.32	156,603.60
NETAPP INC	1,594	41.84	66,692.96
SEAGATE TECHNOLOGY	2,020	48.07	97,101.40
TE CONNECTIVITY LTD	2,377	69.85	166,033.45
TRIMBLE INC	2,244	34.88	78,270.72
WESTERN DIGITAL CORP	2,541	40.34	102,503.94
XEROX HOLDINGS CORP	2,113	15.39	32,519.07
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	377	221.77	83,607.29
AT&T INC	53,610	28.58	1,532,173.80
CENTURYLINK INC	7,172	9.19	65,910.68
T-MOBILE US INC	3,296	94.91	312,823.36
VERIZON COMMUNICATIONS INC	30,352	54.91	1,666,628.32
AES CORP	4,924	11.82	58,201.68
ALLIANT ENERGY CORP	1,752	45.94	80,486.88
AMEREN CORPORATION	1,778	68.72	122,184.16

AMERICAN ELECTRIC POWER	3,601	78.10	281,238.10
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,310	116.27	152,313.70
ATMOS ENERGY CORP	921	94.89	87,393.69
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	17.28	68,290.56
CMS ENERGY CORP	2,048	54.37	111,349.76
CONSOLIDATED EDISON INC	2,417	71.64	173,153.88
DOMINION ENERGY INC	6,015	79.63	478,974.45
DTE ENERGY COMPANY	1,382	98.00	135,436.00
DUKE ENERGY CORP	5,352	82.30	440,469.60
EDISON INTERNATIONAL	2,589	57.52	148,919.28
ENERGY CORP	1,437	94.94	136,428.78
ESSENTIAL UTILITIES INC	1,545	39.32	60,749.40
EVERGY INC	1,636	56.68	92,728.48
EVERSOURCE ENERGY	2,352	77.27	181,739.04
EXELON CORP	7,071	36.10	255,263.10
FIRSTENERGY CORP	3,908	39.96	156,163.68
NEXTERA ENERGY INC	3,578	232.23	830,918.94
NISOURCE INC	2,749	22.49	61,825.01
NRG ENERGY INC	1,800	32.65	58,770.00
OGE ENERGY CORP	1,432	29.34	42,014.88
PINNACLE WEST CAPITAL	828	72.02	59,632.56
PPL CORP	5,213	25.24	131,576.12
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	3,656	46.58	170,296.48
SEMPRA ENERGY	2,048	120.34	246,456.32
SOUTHERN CO/THE	7,660	54.75	419,385.00
UGI CORP	1,566	28.53	44,677.98
VISTRA ENERGY CORP	2,849	18.71	53,304.79
WEC ENERGY GROUP INC	2,295	84.71	194,409.45
XCEL ENERGY INC	3,814	58.20	221,974.80
ADVANCED MICRO DEVICES	7,725	54.51	421,089.75
ANALOG DEVICES INC	2,684	105.49	283,135.16
APPLIED MATERIALS INC	6,740	54.43	366,858.20
BROADCOM INC	2,902	266.60	773,673.20
INTEL CORP	31,897	59.08	1,884,474.76
KLA CORP	1,146	176.75	202,555.50

	LAM RESEARCH CORP	1,057	269.00	284,333.00	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	5,363	26.27	140,912.82	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,332	53.37	124,458.84	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,727	85.80	148,176.60	
	MICRON TECHNOLOGY INC	8,080	45.73	369,498.40	
	NVIDIA CORP	4,260	321.22	1,368,397.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,007	93.59	187,835.13	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	14.71	47,073.28	
	QORVO INC	837	98.81	82,703.97	
	QUALCOMM INC	8,355	79.87	667,313.85	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,228	108.35	133,053.80	
	TERADYNE INC	1,207	61.39	74,097.73	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	6,846	110.35	755,456.10	
	XILINX INC	1,824	84.49	154,109.76	
	米ドル 小計	2,230,422		178,757,348.14	(19,203,901,910)
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	13.78	33,953.92	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	8,172	23.14	189,100.08	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	4.94	51,064.78	
	ENBRIDGE INC	14,691	43.00	631,713.00	
	HUSKY ENERGY INC	1,391	3.62	5,035.42	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	19.70	56,676.90	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	11.31	39,257.01	
	KEYERA CORP	2,259	20.31	45,880.29	
	OVINTIV INC	1,701	8.51	14,475.51	
	PARKLAND FUEL CORP	1,790	33.26	59,535.40	
	PEMBINA PIPELINE CORP	3,677	31.38	115,384.26	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	9.20	4,756.40	
	SUNCOR ENERGY INC	10,908	22.30	243,248.40	
	TC ENERGY CORP	6,741	61.81	416,661.21	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,032	92.72	188,407.04	
	BARRICK GOLD CORP	12,772	38.11	486,740.92	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	40.36	67,522.28	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	7.40	31,723.80	
	FRANCO-NEVADA CORP	1,343	205.53	276,026.79	

KINROSS GOLD CORP	10,281	10.12	104,043.72
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,324	56.27	130,771.48
LUNDIN MINING CORP	7,300	5.83	42,559.00
METHANEX CORP	131	19.70	2,580.70
NUTRIEN LTD	4,033	44.30	178,661.90
TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,246	11.95	38,789.70
WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	34.79	11,654.65
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	3,116	61.74	192,381.84
BOMBARDIER INC-B	8,071	0.43	3,470.53
CAE INC	3,196	19.47	62,226.12
WSP GLOBAL INC	718	84.15	60,419.70
THOMSON REUTERS CORP	1,425	93.05	132,596.25
AIR CANADA	840	15.22	12,784.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	5,175	110.20	570,285.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	979	311.67	305,124.93
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,534	51.72	131,058.48
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	18.07	32,526.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	1,880	71.54	134,495.20
STARS GROUP INC/THE	2,811	37.49	105,384.39
QUEBECOR INC -CL B	1,274	28.69	36,551.06
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,882	22.01	63,432.82
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	94.82	47,410.00
DOLLARAMA INC	2,070	41.97	86,877.90
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	6,356	40.40	256,782.40
EMPIRE CO LTD 'A'	864	30.21	26,101.44
LOBLAW COMPANIES LTD	1,439	68.14	98,053.46
METRO INC	1,851	57.90	107,172.90
WESTON (GEORGE) LTD	817	97.49	79,649.33
SAPUTO INC	1,654	34.37	56,847.98
AURORA CANNABIS INC	365	9.20	3,358.00
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	22.38	73,339.26
CANOPY GROWTH CORP	1,137	19.47	22,137.39
CRONOS GROUP INC	1,000	6.93	6,930.00
BANK OF MONTREAL	4,597	63.13	290,208.61
BANK OF NOVA SCOTIA	8,835	50.55	446,609.25

	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	3,194	79.76	254,753.44	
	NATIONAL BANK OF CANADA	2,887	51.82	149,604.34	
	ROYAL BANK OF CANADA	10,458	83.14	869,478.12	
	TORONTO-DOMINION BANK	13,196	55.23	728,815.08	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	9,658	43.06	415,873.48	
	CI FINANCIAL CORP	775	14.75	11,431.25	
	IGM FINANCIAL INC	81	28.10	2,276.10	
	ONEX CORPORATION	908	60.19	54,652.52	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	185	343.00	63,455.00	
	GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	20.00	36,920.00	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,254	39.02	48,931.08	
	INTACT FINANCIAL CORP	974	132.22	128,782.28	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	13,911	16.10	223,967.10	
	POWER CORP OF CANADA	4,873	19.48	94,926.04	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	4,184	45.23	189,242.32	
	BLACKBERRY LTD	1,407	6.27	8,821.89	
	CGI INC	1,689	84.57	142,838.73	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	143	1,449.03	207,211.29	
	OPEN TEXT CORP	1,878	53.32	100,134.96	
	SHOPIFY INC - CLASS A	751	1,059.50	795,684.50	
	BCE INC	1,116	55.14	61,536.24	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	2,631	55.54	146,125.74	
	TELUS CORP	640	22.46	14,374.40	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	4,426	18.64	82,500.64	
	ALTAGAS LTD	2,930	15.53	45,502.90	
	ATCO LTD -CLASS I	863	36.13	31,180.19	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	30.82	30,419.34	
	EMERA INC	1,699	53.45	90,811.55	
	FORTIS INC	3,685	51.53	189,888.05	
	HYDRO ONE LTD	2,283	25.62	58,490.46	
	カナダドル 小計	287,728		12,189,068.63 (932,463,750)	
ユーロ	ENI SPA	18,047	8.51	153,652.15	
	GALP ENERGIA SGPS SA	4,618	9.57	44,231.20	
	NESTE OYJ	2,948	31.20	91,977.60	

OMV AG	1,475	30.20	44,545.00
REPSOL SA	10,083	8.17	82,418.44
TENARIS SA	5,062	5.74	29,096.37
TOTAL SA	17,481	30.81	538,589.61
VOPAK	762	48.05	36,614.10
AIR LIQUIDE SA	3,439	112.10	385,511.90
AKZO NOBEL	1,654	67.20	111,148.80
ARCELORMITTAL	4,462	7.59	33,888.89
ARKEMA	463	72.26	33,456.38
BASF SE	6,680	42.68	285,102.40
COVESTRO AG	1,223	28.69	35,087.87
CRH PLC	5,629	25.74	144,890.46
EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	20.60	36,935.80
FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	31.86	1,784.16
HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	40.52	55,998.64
KONINKLIJKE DSM NV	1,277	110.60	141,236.20
LANXESS AG	745	42.91	31,967.95
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	26.96	61,630.56
SOLVAY SA	516	68.48	35,335.68
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	9.83	55,185.62
SYMRISE AG	911	94.38	85,980.18
THYSSENKRUPP AG	2,040	4.28	8,743.44
UMICORE	1,389	37.33	51,851.37
UPM-KYMMENE OYJ	3,744	23.80	89,107.20
VOESTALPINE AG	712	17.56	12,502.72
(Right)FERROVIAL SA-RTS	3,504	0.32	1,121.28
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	22.30	64,112.50
AIRBUS SE	4,235	49.88	211,241.80
ALSTOM	1,324	38.20	50,576.80
ANDRITZ AG	352	30.06	10,581.12
BOUYGUES SA	1,779	24.75	44,030.25
BRENTAG AG	1,535	42.41	65,099.35
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	5.05	48,467.86
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	3,477	23.39	81,327.03
DASSAULT AVIATION SA	11	643.00	7,073.00

EIFFAGE	782	71.96	56,272.72
FERROVIAL SA	3,504	22.59	79,155.36
GEA GROUP AG	1,676	21.51	36,050.76
HOCHTIEF AG	17	66.10	1,123.70
KINGSPAN GROUP PLC	1,226	47.88	58,700.88
KION GROUP AG	740	42.00	31,080.00
KNORR-BREMSE AG	297	79.50	23,611.50
KONE OYJ-B	2,439	55.92	136,388.88
LEGRAND SA	1,912	57.10	109,175.20
LEONARDO SPA	3,148	5.47	17,219.56
METSO OYJ	751	23.72	17,813.72
MTU AERO ENGINES AG	373	117.15	43,696.95
PRYSMIAN SPA	1,283	17.62	22,612.87
SAFRAN SA	2,357	73.66	173,616.62
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,023	77.46	311,621.58
SIEMENS AG-REG	5,590	84.81	474,087.90
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	13.64	31,301.63
THALES SA	738	61.96	45,726.48
VINCI SA	3,734	72.80	271,835.20
WARTSILA OYJ ABP	2,705	6.43	17,393.15
BUREAU VERITAS SA	2,067	17.65	36,482.55
RANDSTAD NV	825	34.11	28,140.75
TELEPERFORMANCE	517	211.50	109,345.50
WOLTERS KLUWER	1,945	64.04	124,557.80
ADP	314	73.15	22,969.10
AENA SME SA	466	102.80	47,904.80
ATLANTIA SPA	3,792	13.27	50,338.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	7.73	10,881.73
DEUTSCHE POST AG-REG	7,088	26.20	185,705.60
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	35.12	13,521.20
GETLINK	4,655	10.92	50,832.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,329	47.48	110,580.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	39.68	24,561.92
CONTINENTAL AG	753	71.40	53,764.20
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	6,495	27.96	181,600.20

FAURECIA	800	28.84	23,072.00
FERRARI NV	837	142.20	119,021.40
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	7,060	7.16	50,606.08
MICHELIN (CGDE)	1,187	81.40	96,621.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	16.91	7,152.93
PEUGEOT SA	5,130	11.42	58,584.60
PIRELLI & C SPA	1,734	3.58	6,219.85
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,049	41.68	43,722.32
RENAULT SA	1,817	16.98	30,863.56
VALEO SA	2,418	16.90	40,876.29
VOLKSWAGEN AG	194	128.30	24,890.20
VOLKSWAGEN AG-PREF	1,317	117.58	154,852.86
ADIDAS AG	1,303	196.90	256,560.70
ESSILORLUXOTTICA	2,039	107.50	219,192.50
HERMES INTERNATIONAL	224	667.00	149,408.00
KERING	544	415.35	225,950.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,025	331.00	670,275.00
MONCLER SPA	1,414	31.12	44,003.68
PUMA SE	750	57.26	42,945.00
SEB SA	151	106.00	16,006.00
ACCOR SA	1,140	20.72	23,620.80
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	542	113.00	61,246.00
SODEXO	575	58.30	33,522.50
ALTICE EUROPE NV	7,300	3.46	25,301.80
BOLLORE	3,240	2.46	7,996.32
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	9.00	3,681.00
JC DECAUX SA	60	18.60	1,116.00
PUBLICIS GROUPE	1,962	24.14	47,362.68
SES	2,232	6.02	13,436.64
TELENET GROUP HOLDING NV	192	35.04	6,727.68
UBISOFT ENTERTAINMENT	562	69.18	38,879.16
VIVENDI	5,750	18.97	109,077.50
DELIVERY HERO SE	814	83.30	67,806.20
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	7,953	22.58	179,578.74
JUST EAT TAKEAWAY	791	95.98	75,920.18

PROSUS NV	3,498	80.58	281,868.84
ZALANDO SE	800	53.00	42,400.00
CARREFOUR SA	4,448	12.80	56,934.40
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	32.52	20,325.00
COLRUYT SA	290	53.86	15,619.40
JERONIMO MARTINS	2,258	13.99	31,589.42
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	7,998	22.42	179,315.16
METRO AG	1,970	7.85	15,464.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	5,555	35.80	198,869.00
DANONE	4,491	60.44	271,436.04
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,500	6.94	24,304.00
HEINEKEN HOLDING NV	785	65.25	51,221.25
HEINEKEN NV	1,844	71.64	132,104.16
KERRY GROUP PLC-A	1,144	100.50	114,972.00
PERNOD RICARD SA	1,538	125.70	193,326.60
REMY COINTREAU	18	100.30	1,805.40
BEIERSDORF AG	744	91.32	67,942.08
HENKEL AG & CO KGAA	966	69.10	66,750.60
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,314	76.48	100,494.72
L'OREAL	1,841	241.40	444,417.40
UNILEVER NV	10,720	44.35	475,432.00
BIOMERIEUX	110	124.00	13,640.00
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	82.65	20,249.25
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	1,562	73.24	114,400.88
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,062	39.20	120,030.40
KONINKLIJKE PHILIPS NV	6,556	37.78	247,718.46
SARTORIUS AG-VORZUG	339	293.20	99,394.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	41.40	64,708.20
BAYER AG-REG	7,204	56.23	405,080.92
EUROFINS SCIENTIFIC	82	549.20	45,034.40
GALAPAGOS NV	333	194.90	64,901.70
GRIFOLS SA	2,182	29.40	64,150.80
IPSEN	158	65.50	10,349.00
MERCK KGAA	944	103.65	97,845.60
ORION OYJ-CLASS B	739	45.16	33,373.24

QIAGEN N.V.	1,652	38.89	64,246.28
RECORDATI SPA	830	42.30	35,109.00
SANOFI	8,261	88.18	728,454.98
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	224.20	66,811.60
UCB SA	1,046	82.90	86,713.40
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	6.04	23,018.68
AIB GROUP PLC	2,000	0.97	1,948.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	48,276	2.60	125,952.08
BANCO DE SABADELL SA	55,157	0.29	16,480.91
BANCO SANTANDER SA	121,095	1.87	226,592.96
BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,400	1.42	14,809.60
BANKIA SA	1,600	0.86	1,386.56
BANKINTER SA	2,829	3.47	9,819.45
BNP PARIBAS	8,149	26.23	213,748.27
CAIXABANK S.A	25,249	1.56	39,539.93
COMMERZBANK AG	5,632	3.01	16,963.58
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	6.69	68,004.57
ERSTE GROUP BANK AG	1,624	17.85	28,988.40
FINECOBANK SPA	4,007	9.92	39,757.45
ING GROEP NV-CVA	27,532	4.89	134,851.73
INTESA SANPAOLO	106,353	1.38	147,150.01
KBC GROEP NV	1,795	40.80	73,236.00
MEDIOBANCA SPA	6,857	4.90	33,661.01
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	15.26	18,556.16
SOCIETE GENERALE SA	5,750	11.84	68,103.00
UNICREDIT SPA	14,172	6.28	89,056.84
AMUNDI SA	618	58.40	36,091.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	14,014	6.09	85,471.38
DEUTSCHE BOERSE AG	1,374	146.10	200,741.40
EURAZEO	403	38.96	15,700.88
EXOR NV	712	41.88	29,818.56
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	568	67.22	38,180.96
NATIXIS	3,105	1.99	6,192.92
WENDEL	294	70.30	20,668.20
AEGON NV	16,557	2.07	34,422.00

AGEAS	1,697	30.28	51,385.16
ALLIANZ SE-REG	3,047	144.88	441,449.36
ASSICURAZIONI GENERALI	7,691	12.40	95,406.85
AXA SA	13,978	15.17	212,046.26
CNP ASSURANCES	1,015	8.54	8,673.17
HANNOVER RUECK SE	485	131.80	63,923.00
MAPFRE SA	942	1.52	1,437.49
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,047	179.00	187,413.00
NN GROUP NV	2,804	23.82	66,791.28
POSTE ITALIANE SPA	5,374	7.31	39,283.94
SAMPO OYJ-A SHS	3,127	27.10	84,741.70
SCOR SE	1,565	22.50	35,212.50
AROUNDTOWN SA	10,475	4.53	47,483.17
DEUTSCHE WOHNEN SE	2,514	37.85	95,154.90
VONOVIA SE	3,689	47.92	176,776.88
ADYEN NV	71	984.00	69,864.00
AMADEUS IT GROUP SA	3,127	37.12	116,074.24
ATOS SE	1,004	61.64	61,886.56
CAPGEMINI SA	1,122	81.66	91,622.52
DASSAULT SYSTEMES SA	943	133.90	126,267.70
EDENRED	1,709	35.05	59,900.45
SAP SE	7,196	104.80	754,140.80
WIRECARD AG	842	84.05	70,770.10
WORLDLINE SA	1,066	62.84	66,987.44
INGENICO GROUP	414	114.45	47,382.30
NOKIA OYJ	39,856	3.15	125,665.96
CELLNEX TELECOM SA	2,194	50.64	111,104.16
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	24,567	13.72	337,182.07
ELISA OYJ	1,241	54.66	67,833.06
ILIAD SA	98	143.70	14,082.60
KONINKLIJKE KPN NV	25,539	2.09	53,453.12
ORANGE	14,664	10.23	150,012.72
PROXIMUS	918	18.82	17,276.76
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.35	25,791.79
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.35	25,510.86

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	2.74	1,703.14	
	TELEFONICA SA	34,589	4.23	146,553.59	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	34.72	26,595.52	
	E.ON SE	16,417	9.04	148,508.18	
	EDF	6,102	7.23	44,129.66	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	16,914	3.87	65,507.92	
	ENAGAS SA	1,292	21.36	27,597.12	
	ENDESA SA	3,177	20.12	63,921.24	
	ENEL SPA	59,248	5.88	348,615.23	
	ENGIE	13,267	9.24	122,666.68	
	FORTUM OYJ	3,981	15.25	60,730.15	
	IBERDROLA SA	45,140	8.54	385,766.44	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	16.50	35,403.22	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,151	16.14	50,857.14	
	RWE AG	4,262	27.24	116,096.88	
	SNAM SPA	14,268	3.91	55,887.75	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	10.22	22,955.12	
	TERNA SPA	9,835	5.64	55,508.74	
	UNIPER SE	1,464	24.38	35,692.32	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	3,872	18.11	70,141.28	
	VERBUND AG	797	40.72	32,453.84	
	ASML HOLDING NV	3,110	267.55	832,080.50	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	9,178	16.99	155,952.57	
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	22.27	135,045.28	
	ユーロ 小計	1,460,578		23,355,947.33 (2,711,158,366)	
英債券	BP PLC	146,763	2.96	435,078.91	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	30,198	12.04	363,583.92	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	26,893	11.58	311,528.51	
	ANGLO AMERICAN PLC	7,114	13.64	97,049.18	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	7.83	33,851.52	
	BHP GROUP PLC	15,030	13.55	203,686.56	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	858	48.71	41,793.18	
	EVRAZ PLC	3,072	2.41	7,412.73	
	GLENCORE PLC	74,422	1.36	101,586.03	

JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	18.45	33,274.36
MONDI PLC	3,232	12.82	41,434.24
RIO TINTO PLC	8,109	37.57	304,655.13
ASHTED GROUP PLC	3,084	21.66	66,799.44
BAE SYSTEMS PLC	22,640	4.92	111,547.28
BUNZL PLC	3,344	16.40	54,841.60
DCC PLC	823	56.20	46,252.60
FERGUSON PLC	1,569	58.18	91,284.42
MEGGITT PLC	7,023	2.37	16,707.71
MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	0.83	37,209.27
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	11,766	2.47	29,062.02
SMITHS GROUP PLC	3,824	11.72	44,817.28
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	499	88.36	44,091.64
WEIR GROUP PLC/THE	2,572	8.85	22,767.34
EXPERIAN PLC	6,495	23.57	153,087.15
G4S PLC	17,548	0.87	15,319.40
INTERTEK GROUP PLC	1,108	44.16	48,929.28
RELX PLC	13,998	17.80	249,234.39
RENTOKIL INITIAL PLC	12,702	4.60	58,518.11
EASYJET PLC	130	4.84	629.20
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	6,642	4.64	30,872.01
BERKELEY GROUP HOLDINGS	780	39.15	30,537.00
BURBERRY GROUP PLC	3,298	12.98	42,808.04
PERSIMMON PLC	2,079	20.49	42,598.71
TAYLOR WIMPEY PLC	21,395	1.37	29,353.94
CARNIVAL PLC	1,722	8.30	14,299.48
COMPASS GROUP PLC	11,037	11.06	122,124.40
GVC HOLDINGS PLC	6,950	7.46	51,847.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	31.58	52,738.60
TUI AG-DI	4,120	2.54	10,464.80
WHITBREAD PLC	983	25.58	25,145.14
AUTO TRADER GROUP PLC	5,811	4.89	28,450.65
INFORMA PLC	11,550	4.20	48,510.00
ITV PLC	42,960	0.69	30,029.04
PEARSON PLC	7,332	4.23	31,051.02

WPP PLC	7,944	5.58	44,343.40
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	5.22	25,901.12
KINGFISHER PLC	12,732	1.69	21,523.44
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,143	0.88	8,108.01
NEXT PLC	1,278	45.72	58,430.16
OCADO GROUP PLC	2,823	19.56	55,217.88
SAINSBURY (J) PLC	9,573	1.86	17,848.85
TESCO PLC	71,038	2.38	169,638.74
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.90	43,887.76
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	16.64	54,612.24
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	16,679	29.89	498,618.70
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	17.86	32,790.96
DIAGEO PLC	17,032	26.95	459,097.56
IMPERIAL BRANDS PLC	6,624	15.82	104,791.68
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	5,166	69.80	360,586.80
UNILEVER PLC	8,082	41.09	332,089.38
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	6,166	15.14	93,384.07
ASTRAZENECA PLC	9,583	87.65	839,949.95
GLAXOSMITHKLINE PLC	36,401	16.41	597,631.61
BARCLAYS PLC	121,223	0.97	117,756.02
HSBC HOLDINGS PLC	148,160	3.98	590,417.60
LLOYDS BANKING GROUP PLC	500,406	0.28	143,191.17
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	42,392	1.05	44,596.38
STANDARD CHARTERED PLC	18,922	3.88	73,436.28
3I GROUP PLC	8,862	7.97	70,630.14
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	15.70	48,167.60
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	2,229	79.24	176,625.96
M&G PLC	21,579	1.13	24,470.58
SCHRODERS PLC	1,161	27.00	31,347.00
ST JAMES'S PLACE PLC	3,582	7.95	28,476.90
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	2.10	39,439.28
ADMIRAL GROUP PLC	1,104	22.69	25,049.76
AVIVA PLC	26,862	2.31	62,212.39
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	2.63	19,632.52

	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	41,023	1.87	77,000.17	
	PRUDENTIAL PLC	18,459	10.33	190,681.47	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	3.62	34,069.89	
	AVEVA GROUP PLC	700	36.61	25,627.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1,601	4.02	6,436.02	
	SAGE GROUP PLC/THE	9,110	6.18	56,336.24	
	HALMA PLC	2,529	21.15	53,488.35	
	BT GROUP PLC	60,238	1.02	61,533.11	
	VODAFONE GROUP PLC	194,812	1.19	232,839.30	
	CENTRICA PLC	60,998	0.35	21,501.79	
	NATIONAL GRID PLC	25,199	9.06	228,353.33	
	SEVERN TRENT PLC	1,640	23.75	38,950.00	
	SSE PLC	7,312	12.30	89,937.60	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,711	8.75	41,230.67	
	英ポンド 小計	2,221,093		10,128,749.06 (1,330,208,614)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	16.42	9,526.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	626.00	48,828.00	
	GIVAUDAN-REG	67	3,321.00	222,507.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	3,506	37.50	131,475.00	
	SIKA AG-REG	913	161.20	147,175.60	
	ABB LTD-REG	13,379	16.82	225,034.78	
	GEBERIT AG-REG	266	423.00	112,518.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	205.00	44,075.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	288	207.50	59,760.00	
	ADECCO SA-REG	1,516	38.65	58,593.40	
	SGS SA-REG	44	2,065.00	90,860.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	370	130.35	48,229.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	3,747	52.34	196,117.98	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	198	173.25	34,303.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	33.70	8,458.70	
	DUFREY AG-REG	465	24.24	11,271.60	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	21	1,861.00	39,081.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	7,765.00	62,120.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	80,600.00	80,600.00	

	NESTLE SA-REG	21,820	103.14	2,250,514.80	
	ALCON INC	3,031	54.38	164,825.78	
	SONOVA HOLDING AG-REG	419	180.25	75,524.75	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	75	661.60	49,620.00	
	LONZA GROUP AG-REG	544	443.10	241,046.40	
	NOVARTIS AG-REG	15,755	81.00	1,276,155.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	5,154	347.80	1,792,561.20	
	VIFOR PHARMA AG	329	147.30	48,461.70	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	18,341	7.46	136,897.22	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,813	34.04	61,714.52	
	PARGESA HOLDING SA-BR	29	64.60	1,873.40	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	132	721.00	95,172.00	
	UBS GROUP AG-REG	27,968	9.02	252,271.36	
	BALOISE HOLDING AG - REG	344	126.70	43,584.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	238	307.20	73,113.60	
	SWISS RE AG	2,117	60.26	127,570.42	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,089	277.30	301,979.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	620	87.00	53,940.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	462	123.05	56,849.10	
	SWISSCOM AG-REG	191	493.90	94,334.90	
	スイスフラン 小計	126,384		8,828,546.21 (974,230,074)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	218.60	240,241.40	
	BOLIDEN AB	1,948	185.10	360,574.80	
	ALFA LAVAL AB	2,277	174.60	397,564.20	
	ASSA ABLOY AB-B	7,306	175.20	1,280,011.20	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,898	334.90	1,640,340.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,827	303.30	857,429.10	
	EPIROC AB-A	5,706	94.92	541,613.52	
	EPIROC AB-B	1,290	94.60	122,034.00	
	SANDVIK AB	8,212	137.30	1,127,507.60	
	SKANSKA AB-B SHS	2,462	167.00	411,154.00	
	SKF AB-B SHARES	2,513	143.25	359,987.25	
	VOLVO AB-B SHS	10,813	116.95	1,264,580.35	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	111.55	427,571.15	

	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	133.15	203,985.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	55.66	157,907.42	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	5,841	119.60	698,583.60	
	ICA GRUPPEN AB	510	416.70	212,517.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,229	621.60	763,946.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	4,496	300.30	1,350,148.80	
	NORDEA BANK ABP	23,511	55.32	1,300,628.52	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	11,730	70.56	827,668.80	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	11,234	82.30	924,558.20	
	SWEDBANK AB - A SHARES	7,947	101.18	804,077.46	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	186.90	118,307.70	
	INVESTOR AB-B SHS	3,305	447.80	1,479,979.00	
	KINNEVIK AB - B	2,331	211.50	493,006.50	
	LUNDBERGS AB-B SHS	90	402.40	36,216.00	
	ERICSSON LM-B SHS	22,283	79.54	1,772,389.82	
	HEXAGON AB-B SHS	1,886	447.70	844,362.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	842	202.90	170,841.80	
	TELE2 AB-B SHS	3,777	119.75	452,295.75	
	TELIA CO AB	20,672	31.12	643,312.64	
	スウェーデンクローナ 小計	181,870		22,285,342.18	(244,470,203)
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	242	154.85	37,473.70	
	EQUINOR ASA	7,303	135.50	989,556.50	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	21.94	177,845.64	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	309.80	528,828.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	205.00	113,160.00	
	MOWI ASA	3,230	178.90	577,847.00	
	ORKLA ASA	6,749	85.76	578,794.24	
	DNB ASA	6,924	110.65	766,140.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	173.70	114,989.40	
	TELENOR ASA	6,751	142.75	963,705.25	
	ノルウェークローネ 小計	42,226		4,848,340.93	(51,343,930)
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	881	633.60	558,201.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,498	348.00	521,304.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,359	592.80	805,615.20	
	ISS A/S	982	91.56	89,911.92	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	5,825.00	227,175.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	45	6,208.00	279,360.00	
	DSV PANALPINA A S	1,493	684.20	1,021,510.60	
	PANDORA A/S	1,082	268.00	289,976.00	
	CARLSBERG AS-B	763	807.00	615,741.00	
	COLOPLAST-B	868	1,060.00	920,080.00	
	DEMANT A/S	550	160.50	88,275.00	
	GENMAB A/S	473	1,937.50	916,437.50	
	H LUNDBECK A/S	120	239.70	28,764.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	12,974	439.15	5,697,532.10	
	DANSKE BANK A/S	6,042	71.40	431,398.80	
	TRYG A/S	694	174.90	121,380.60	
	ORSTED A/S	1,377	716.00	985,932.00	
	デンマーククローネ 小計	31,240		13,598,595.32	(211,730,129)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	3,012	24.24	73,010.88	
	OIL SEARCH LTD	14,702	2.75	40,430.50	
	ORIGIN ENERGY LTD	14,373	5.23	75,170.79	
	SANTOS LTD	14,669	4.56	66,890.64	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	17.79	6,351.03	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	6,396	21.07	134,763.72	
	WORLEY LTD	1,064	7.82	8,320.48	
	ALUMINA LTD	25,748	1.42	36,562.16	
	BHP GROUP LTD	21,267	30.61	650,982.87	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	9.80	61,308.80	
	BORAL LTD	12,991	2.57	33,386.87	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	11,408	12.05	137,466.40	
	INCITEC PIVOT LTD	5,342	1.95	10,416.90	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	21.25	82,896.25	
	NEWCREST MINING LTD	5,247	29.00	152,163.00	
	ORICA LTD	2,575	16.06	41,354.50	
RIO TINTO LTD	2,604	83.26	216,809.04		
	SOUTH32 LTD	38,772	1.78	69,208.02	

CIMIC GROUP LTD	682	22.16	15,113.12
BRAMBLES LTD	10,716	11.00	117,876.00
SEEK LTD	3,309	17.14	56,716.26
AURIZON HOLDINGS LTD	12,197	4.52	55,130.44
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	3.33	28,971.00
SYDNEY AIRPORT	12,027	5.49	66,028.23
TRANSURBAN GROUP	18,973	13.64	258,791.72
ARISTOCRAT LEISURE LTD	3,594	25.47	91,539.18
CROWN RESORTS LTD	773	9.03	6,980.19
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	10.04	441.76
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	3.07	65,185.31
REA GROUP LTD	563	90.51	50,957.13
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	2.79	1,233.18
WESFARMERS LTD	8,105	37.55	304,342.75
COLES GROUP LTD	8,126	15.02	122,052.52
WOOLWORTHS GROUP LTD	9,174	35.02	321,273.48
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	8.61	44,505.09
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	9.72	68,526.00
COCHLEAR LTD	393	186.75	73,392.75
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	62.12	88,272.52
SONIC HEALTHCARE LTD	3,109	26.41	82,108.69
CSL LTD	3,310	301.63	998,395.30
AUST AND NZ BANKING GROUP	20,280	15.15	307,242.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,272	5.64	18,454.08
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	12,857	58.90	757,277.30
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	20,617	15.24	314,203.08
WESTPAC BANKING CORP	25,647	14.95	383,422.65
AMP LTD	36,656	1.39	50,951.84
ASX LTD	1,467	82.51	121,042.17
CHALLENGER LTD	1,796	4.27	7,668.92
MACQUARIE GROUP LTD	2,373	103.16	244,798.68
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	800	53.39	42,712.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,356	5.38	104,135.28
MEDIBANK PRIVATE LTD	16,184	2.84	45,962.56
QBE INSURANCE GROUP LTD	8,615	7.40	63,751.00

	SUNCORP GROUP LTD	11,553	8.49	98,084.97	
	LENDLEASE GROUP	3,479	11.02	38,338.58	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	11.73	65,734.92	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	18.90	30,240.00	
	TELSTRA CORP LTD	32,785	3.12	102,289.20	
	TPG TELECOM LTD	287	7.17	2,057.79	
	AGL ENERGY LTD	4,361	16.20	70,648.20	
	APA GROUP	7,991	11.20	89,499.20	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.87	2,694.37	
	オーストラリアドル 小計	568,811		7,776,534.26	(540,080,304)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	10,115	3.39	34,289.85	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	5.69	46,157.28	
	A2 MILK CO LTD	4,552	19.25	87,626.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	4,554	31.08	141,538.32	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	12.23	19,531.31	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	11,467	4.56	52,289.52	
	MERCURY NZ LTD	7,200	4.70	33,840.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	4.71	44,283.42	
	ニュージーランドドル 小計	56,999		459,555.70	(29,664,320)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	20,000	55.95	1,119,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	7.38	73,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	12,500	63.80	797,500.00	
	MTR CORP	11,000	41.05	451,550.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	13.10	6,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	16,000	51.60	825,600.00	
	SANDS CHINA LTD	17,400	30.15	524,610.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	7.94	15,880.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	13.60	70,720.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	10,000	22.90	229,000.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	6,000	31.90	191,400.00	
	WH GROUP LTD	91,500	7.12	651,480.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	16.08	57,888.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	27,500	23.80	654,500.00		

	HANG SENG BANK LTD	5,700	131.10	747,270.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	8,800	249.60	2,196,480.00	
	AIA GROUP LTD	88,800	67.15	5,962,920.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	19,000	47.15	895,850.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	16.42	213,460.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	29.85	415,392.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	20.90	10,450.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	60,000	8.91	534,600.00	
	SINO LAND CO	18,000	10.36	186,480.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	11,700	96.70	1,131,390.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	47.90	201,180.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	20.85	104,250.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	31.95	287,550.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	5,400	55.40	299,160.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	11.88	392,040.00	
	PCCW LTD	4,000	4.45	17,800.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	47.00	206,800.00	
	CLP HOLDINGS LTD	12,500	79.50	993,750.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.98	247,380.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	75,880	13.58	1,030,450.40	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	10,500	50.15	526,575.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	78.50	125,600.00	
	香港ドル 小計	669,096		22,396,306.00	(310,412,801)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	10,700	5.97	63,879.00	
	SEBACORP INDUSTRIES LTD	800	1.53	1,224.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.31	39,720.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	0.93	1,402.50	
	(Right)SINGAPORE AIRLINE-MCB RIGHTS	10,620	0.00	21.24	
	(Right)SINGAPORE AIRLINES LT-RIGHTS	5,400	0.76	4,104.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	19,100	1.50	28,650.00	
	SATS LTD	1,200	2.74	3,288.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,600	3.81	13,716.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.73	58,984.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,200	1.48	19,536.00	

	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	20.02	2,002.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	14,100	3.87	54,567.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	13,100	18.96	248,376.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	24,200	8.70	210,540.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	9,200	19.40	178,480.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	5,800	9.84	57,072.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	2.82	59,784.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.53	22,590.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.60	13,860.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	15.58	20,254.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	61,700	2.66	164,122.00	
	シンガポールドル 小計	314,720		1,266,171.74	(95,557,981)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	4,122	10.88	44,847.36	
	ELBIT SYSTEMS LTD	113	465.10	52,556.30	
	BANK HAPOALIM BM	9,996	20.06	200,519.76	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	8,833	17.11	151,132.63	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	10.35	77,821.65	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	65.32	92,362.48	
	AZRIELI GROUP	234	179.40	41,979.60	
	NICE SYSTEMS LTD	522	582.40	304,012.80	
	イスラエルシュケル 小計	32,753		965,232.58	(29,265,851)
	合 計	8,223,920		26,664,488,233	(26,664,488,233)

(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	AGNC INVESTMENT CORP	4,823	59,853.43	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	805	113,126.65	
		AMERICAN TOWER CORP	3,226	740,754.12	

ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	10,034	59,501.62	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	990	150,341.40	
BOSTON PROPERTIES INC	1,074	82,375.80	
CAMDEN PROPERTY TRUST	666	55,424.52	
CROWN CASTLE INTL CORP	3,013	458,096.52	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1,890	250,840.80	
DUKE REALTY CORP	2,527	77,048.23	
EQUINIX INC	617	406,763.42	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	86,889.24	
EQUITY RESIDENTIAL	2,637	151,680.24	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	459	103,279.59	
EXTRA SPACE STORAGE INC	890	74,938.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	43,202.34	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,403	75,648.69	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	65,340.32	
INVITATION HOMES INC	3,696	88,777.92	
IRON MOUNTAIN INC	2,044	46,276.16	
KIMCO REALTY CORP	3,824	35,257.28	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3,557	57,730.11	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	784	82,727.68	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	41,227.78	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	60,836.30	
PROLOGIS INC	5,332	448,314.56	
PUBLIC STORAGE	1,125	201,375.00	
REALTY INCOME CORP	2,265	114,110.70	
REGENCY CENTERS CORP	1,514	55,276.14	
SBA COMMUNICATIONS CORP	806	228,041.58	
SIMON PROPERTY GROUP INC	2,132	109,904.60	
SL GREEN REALTY CORP	468	18,434.52	
SUN COMMUNITIES INC	788	96,695.48	
UDR INC	2,015	70,323.50	
VENTAS INC	2,562	71,300.46	
VEREIT INC	11,100	51,726.00	
VICI PROPERTIES INC	3,169	48,137.11	
VORNADO REALTY TRUST	1,259	44,077.59	

	WELLTOWER INC	2,815	113,557.10
	WEYERHAEUSER CO	5,136	89,263.68
	WP CAREY INC	1,458	80,831.52
	米ドル 小計	107,380	5,309,307.70 (570,378,926)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	44,384.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	23,534.38
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	973.56
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	21,404.70
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,017.60
	カナダドル 小計	4,548	91,314.24 (6,985,539)
ユーロ	COVIVIO	522	26,622.00
	GECINA SA	298	30,753.60
	ICADE	30	1,785.00
	KLEPIERRE	1,289	19,947.27
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	53,078.48
	ユーロ 小計	3,335	132,186.35 (15,344,191)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	18,949.31
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	34,636.08
	SEGRO PLC	9,145	72,190.63
	英ポンド 小計	21,530	125,776.02 (16,518,164)
オーストラリアドル	DEXUS	6,879	61,429.47
	GOODMAN GROUP	11,045	156,286.75
	GPT GROUP	15,542	62,012.58
	MIRVAC GROUP	32,387	67,041.09
	SCENTRE GROUP	32,385	65,417.70
	STOCKLAND	14,697	39,828.87
	VICINITY CENTRES	42,168	57,348.48
	オーストラリアドル 小計	155,103	509,364.94 (35,375,395)
香港ドル	LINK REIT	15,300	1,015,155.00
	香港ドル 小計	15,300	1,015,155.00 (14,070,048)

シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	24,200	69,696.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	38,250.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	22,000	38,280.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	41,170.00	
	SUNTEC REIT	8,500	11,560.00	
シンガポールドル 小計		103,200	198,956.00	(15,015,209)
合計			673,687,472	(673,687,472)

(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 607銘柄	97.1%		70.1%
	投資証券 41銘柄		2.9%	2.1%
カナダドル	株式 84銘柄	99.3%		3.4%
	投資証券 5銘柄		0.7%	0.0%
ユーロ	株式 237銘柄	99.4%		9.9%
	投資証券 5銘柄		0.6%	0.1%
英ポンド	株式 93銘柄	98.8%		4.9%
	投資証券 3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.6%
スウェーデンクローナ	株式 32銘柄	100.0%		0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式 62銘柄	93.9%		2.0%
	投資証券 7銘柄		6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 36銘柄	95.7%		1.1%
	投資証券 1銘柄		4.3%	0.1%
シンガポールドル	株式 22銘柄	86.4%		0.3%
	投資証券 5銘柄		13.6%	0.1%

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,361,256,105
コール・ローン	139,495,916
株式	4,180,001,412
投資証券	4,631,205
派生商品評価勘定	225,779,032
未収入金	80,913
未収配当金	3,677,506
差入委託証拠金	476,238,157
流動資産合計	6,391,160,246
資産合計	6,391,160,246
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,484
未払解約金	142,000
未払利息	378
その他未払費用	209
流動負債合計	190,071
負債合計	190,071
純資産の部	
元本等	
元本	5,820,011,151
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	570,959,024
元本等合計	6,390,970,175
純資産合計	6,390,970,175
負債純資産合計	6,391,160,246

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

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>投資証券</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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。</p> <p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>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。</p>
4.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	5,008,923,822円
期中追加設定元本額	8,976,854,595円
期中一部解約元本額	8,165,767,266円
期末元本額	5,820,011,151円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	534,252,367円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	749,576,818円
りそなラップ型ファンド（成長型）	851,237,203円
DCりそな グローバルバランス	10,102,477円
つみたてバランスファンド	277,619,041円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	232,392,819円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	112,224,841円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	64,499,160円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,715,525円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,813,560円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,401,095円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,365,262円
リスクコントロール・オープン	1,690,995円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	32,543,917円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,650,029,553円
Smart-i 新興国株式インデックス	750,351,601円
Smart-i 8資産バランス 安定型	25,953,291円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	72,318,131円
Smart-i 8資産バランス 成長型	87,090,648円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	77,409,694円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	69,815,368円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	39,315,419円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	28,380,400円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	141,342,833円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	569,133円
2. 計算日における受益権の総数	5,820,011,151口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0981円
(10,000口当たり純資産額)	(10,981円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお

ります。当該価額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）

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		705,265,297
投資証券		4,531,348
合計		709,796,645

(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)

(2020年 5月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,984,020,463	-	2,209,405,380	225,384,917
	合計	1,984,020,463	-	2,209,405,380	225,384,917

(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)

(2020年 5月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	136,955,490	-	137,302,133	346,643
	米ドル	88,713,859	-	88,947,613	233,754
	メキシコペソ	3,877,368	-	3,942,400	65,032
	ハンガリーフォリント	728,618	-	720,720	7,898
	ポーランドズロチ	892,745	-	890,750	1,995
	香港ドル	36,978,130	-	37,048,750	70,620
	南アフリカランド	5,764,770	-	5,751,900	12,870
	売建	3,844	-	3,856	12
	オフショア人民元	3,844	-	3,856	12
	合計	136,959,334	-	137,305,989	346,631

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	42,102	4.90	206,468.20	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.57	4,715.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	3,156	65.74	207,475.44	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	717	136.00	97,512.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	10,217	4.67	47,723.60	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	8,010	5.21	41,772.15	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,078	42.30	87,899.40	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	4.07	7,733.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	1,390	7.99	11,106.10	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	6.50	20,475.00	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	5,074	27.15	137,759.10	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,251	15.75	19,703.25	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,201	12.28	14,748.28	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	493	84.00	41,412.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	1,901	11.08	21,063.08	
	SOUTHERN COPPER CORP	585	32.94	19,269.90	
	51JOB INC-ADR	200	58.36	11,672.00	
	BEST INC - ADR	1,500	5.25	7,875.00	
	DP WORLD PLC	1,203	16.10	19,368.30	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,400	33.10	79,440.00	
NIO INC - ADR	5,000	3.45	17,250.00		

HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,000	32.86	32,860.00	
LUCKIN COFFEE INC - ADR	600	4.39	2,634.00	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,050	119.92	125,916.00	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,900	53.77	155,933.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	2,750	48.81	134,227.50	
58.COM INC-ADR	760	51.26	38,957.60	
AUTOHOME INC-ADR	420	75.49	31,705.80	
BAIDU INC - SPON ADR	2,050	96.02	196,841.00	
HUYA INC-ADR	500	16.34	8,170.00	
IQIYI INC-ADR	1,000	17.48	17,480.00	
JOYY INC	420	53.35	22,407.00	
MOMO INC-SPON ADR	1,150	20.95	24,092.50	
NETEASE INC-ADR	582	372.03	216,521.46	
SINA CORP	430	32.77	14,091.10	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,000	11.89	11,890.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	430	34.55	14,856.50	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	13,330	201.30	2,683,329.00	
BAOZUN INC-SPN ADR	300	27.13	8,139.00	
JD.COM INC-ADR	5,620	48.96	275,155.20	
PINDUODUO INC-ADR	1,500	60.84	91,260.00	
TRIP.COM GROUP LTD	3,550	23.66	83,993.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	3,300	16.70	55,110.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	3,188	10.40	33,155.20	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,056	29.76	31,426.56	
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	22.50	13,500.00	
ZAI LAB LTD-ADR	300	64.49	19,347.00	
BANCO MACRO SA-ADR	450	19.14	8,613.00	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	12,261	4.05	49,657.05	
CREDICORP LTD	544	135.99	73,978.56	
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	1,210	8.46	10,236.60	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	21,206	9.91	210,151.46	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.90	20,013.36	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	200	25.78	5,156.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.82	8,356.32	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	500	60.88	30,440.00	

	GLOBANT SA	240	111.37	26,728.80	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	4,200	8.65	36,330.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	7.42	6,455.40	
	米ドル 小計	225,377		5,951,555.77 (639,375,636)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	115,100	4.57	526,007.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	25,800	48.52	1,251,816.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	186.50	256,437.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	7,800	31.22	243,516.00	
	ALFA S.A.B. -A	22,600	10.18	230,068.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	49.26	167,484.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	2,700	139.51	376,677.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,570	239.66	376,266.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,750	165.58	289,765.00	
	ALSEA SAB DE CV	6,000	18.88	113,280.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	18,200	23.43	426,426.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	66.90	147,180.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	2,100	53.49	112,329.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	40,100	56.72	2,274,472.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	3,200	98.42	314,944.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	3,900	91.78	357,942.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	14,800	149.28	2,209,344.00	
	GRUMA S.A.B. -B	1,505	237.89	358,024.45	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	11,900	35.67	424,473.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	11,400	34.80	396,720.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	19,900	70.08	1,394,592.00		
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	17,800	14.52	258,456.00		
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	257,100	14.94	3,841,074.00		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	4,100	72.94	299,054.00		
	メキシコペソ 小計	596,300		16,646,347.15 (74,742,098)	
ブラジルリアル	COSAN SA	1,200	59.07	70,884.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	28,400	17.69	502,396.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	32,100	17.40	558,540.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,600	15.00	84,000.00	

BRASKEM SA-PREF A	2,300	22.17	50,991.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	8.39	61,247.00
GERDAU SA-PREF	8,300	11.74	97,442.00
KLABIN SA - UNIT	5,300	22.40	118,720.00
SUZANO SA	4,107	47.54	195,246.78
VALE SA	24,000	48.09	1,154,160.00
EMBRAER SA	5,300	6.57	34,821.00
WEG SA	6,450	37.35	240,907.50
CCR SA	9,200	11.46	105,432.00
LOCALIZA RENT A CAR	4,610	29.29	135,026.90
RUMO SA	8,300	20.54	170,482.00
COGNA EDUCACAO	13,300	4.20	55,860.00
B2W CIA DIGITAL	1,600	88.85	142,160.00
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	5,700	27.17	154,869.00
LOJAS RENNER S.A.	6,100	33.30	203,130.00
MAGAZINE LUIZA SA	5,600	55.50	310,800.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	5,300	18.55	98,315.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	17.90	53,700.00
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,200	59.90	71,880.00
RAIA DROGASIL SA	1,800	105.54	189,972.00
AMBEV SA	35,900	11.74	421,466.00
BRF SA	4,100	23.06	94,546.00
JBS SA	8,200	24.45	200,490.00
(Right)NATURA &CO HOLDING SA-RIGHTS	257	1.86	478.02
NATURA &CO HOLDING SA	4,900	33.24	162,876.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,700	47.41	80,597.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	3,700	52.59	194,583.00
HYPERA SA	2,800	28.60	80,080.00
BANCO BRADESCO S.A.	10,120	16.38	165,765.60
BANCO BRADESCO SA-PREF	33,990	17.88	607,741.20
BANCO DO BRASIL S.A.	6,600	26.65	175,890.00
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	3,000	23.94	71,820.00
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	37,100	22.55	836,605.00
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	33,900	8.52	288,828.00
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	15,800	37.82	597,556.00

	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,800	38.12	68,616.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	5,300	23.71	125,663.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,200	7.04	36,608.00	
	PORTO SEGURO SA	700	41.60	29,120.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	2,200	37.87	83,314.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,000	8.61	51,660.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	18.67	41,074.00	
	CIELO SA	11,700	3.55	41,535.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	3,400	46.98	159,732.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	6,400	12.82	82,048.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,000	25.17	50,340.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	2,000	22.72	45,440.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	7,100	8.59	60,989.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,600	40.14	104,364.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,300	41.50	53,950.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,575	38.35	60,401.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	6,600	17.64	116,424.00	
	ブラジルリアル 小計	466,209		10,051,582.25	(185,652,724)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,843	4,902.00	13,936,386.00	
	EMPRESAS CMPC SA	7,941	1,720.00	13,658,520.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	817	18,300.00	14,951,100.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	2,300.10	6,810,596.10	
	FALABELLA SA	5,224	2,200.00	11,492,800.00	
	CENCOSUD SA	13,424	971.00	13,034,704.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	893	5,252.00	4,690,036.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,900.00	5,415,000.00	
	BANCO DE CHILE	335,470	67.90	22,778,413.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	353	27,300.00	9,636,900.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	481,249	31.89	15,347,030.61	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	2.08	3,910,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	4,899.00	4,903,899.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	247.00	4,447,482.00	
	COLBUN SA	83,944	111.07	9,323,660.08	
	ENEL AMERICAS SA	284,519	120.00	34,142,280.00	

	ENEL CHILE SA	200,172	61.39	12,288,559.08	
	チリペソ 小計	3,321,667		200,767,765.87	(26,260,423)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	37,116	1,930.00	71,633,880.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	8,250.00	23,925,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,642	21,480.00	35,270,160.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	3,341	22,100.00	73,836,100.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	43,000	754.00	32,422,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	19,200.00	49,689,600.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	3,390	18,400.00	62,376,000.00	
	コロンビアペソ 小計	93,977		349,152,740.00	(9,496,954)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	13.28	10,411.52	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	370	10.84	4,010.80	
	OPAP SA	1,335	7.80	10,413.00	
	JUMBO SA	765	14.68	11,230.20	
	ALPHA BANK AE	9,838	0.52	5,115.76	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	18,422	0.28	5,213.42	
	NATIONAL BANK OF GREECE	6,654	0.96	6,398.48	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,834	11.91	21,842.94	
	ユーロ 小計	40,002		74,636.12	(8,663,760)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	917	82.50	75,652.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	10,581	8.00	84,648.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,580	29.22	75,387.60	
	KOC HOLDING AS	5,754	15.06	86,655.24	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	17.00	25,500.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	10.54	57,970.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	58.00	30,798.00	
	ARCELIK AS	1,000	15.01	15,010.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	3,240	54.20	175,608.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	16.99	32,620.80	
	AKBANK T.A.S.	21,653	5.42	117,359.26	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	16,862	7.69	129,668.78	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	4.83	58,443.00	

	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,059	8.19	57,813.21	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	8,232	13.44	110,638.08	
	トルコリラ 小計	99,429		1,133,772.47	(17,584,811)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	503.00	376,747.00	
	MONETA MONEY BANK AS	3,886	48.80	189,636.80	
	CEZ AS	1,247	468.00	583,596.00	
	チェココルナ 小計	5,882		1,149,979.80	(4,829,915)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,029	1,992.00	6,033,768.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,047	6,935.00	7,260,945.00	
	OTP BANK PLC	1,639	8,875.00	14,546,125.00	
	ハンガリーフォリント 小計	5,715		27,840,838.00	(9,123,442)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	682	59.50	40,579.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,260	61.38	138,718.80	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	12,790	3.71	47,450.90	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,025	72.00	73,800.00	
	CCC SA	371	42.00	15,582.00	
	LPP SA	9	6,025.00	54,225.00	
	AMREST HOLDINGS SE	830	25.85	21,455.50	
	CD PROJEKT SA	505	370.00	186,850.00	
	CYFROWY POLSAT SA	1,849	24.62	45,522.38	
	DINO POLSKA SA	360	153.80	55,368.00	
	BANK MILLENNIUM SA	8,345	2.61	21,813.83	
	BANK PEKAO SA	1,272	49.65	63,154.80	
	MBANK SA	165	183.60	30,294.00	
	PKO BANK POLSKI SA	6,626	20.75	137,489.50	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	151.40	40,121.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,529	28.53	129,212.37	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.64	31,201.36	
PGE SA	9,929	4.01	39,855.00		
	ポーランドズロチ 小計	56,511		1,172,693.44	(29,856,774)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	16,000	1.96	31,360.00	

CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	6.42	77,040.00
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	196,000	3.56	697,760.00
CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	26,000	13.16	342,160.00
CNOOC LTD	137,000	8.35	1,143,950.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	4.15	41,500.00
PETROCHINA CO LTD-H	162,000	2.58	417,960.00
YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	5.96	83,440.00
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	1.51	45,300.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	9,500	57.45	545,775.00
BBMG CORP-H	25,000	1.89	47,250.00
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	3.45	44,850.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	27,000	2.38	64,260.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	28,000	9.48	265,440.00
CHINA RESOURCES CEMENT	18,000	10.20	183,600.00
CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	1.74	29,928.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	7.07	63,630.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	4.35	43,500.00
MAANSHAN IRON & STEEL-H	6,000	2.22	13,320.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	12,000	7.02	84,240.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	2.02	68,680.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	8,000	8.87	70,960.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	44,000	3.17	139,480.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	3.06	79,560.00
BOC AVIATION LTD	2,200	45.80	100,760.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	34,000	4.79	162,860.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	18,000	5.27	94,860.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	12,500	34.40	430,000.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	8,000	10.82	86,560.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	15,000	7.68	115,200.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	29,000	4.44	128,760.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	16,000	5.84	93,440.00
CITIC LTD	44,000	7.28	320,320.00
CRRC CORP LTD - H	33,000	3.89	128,370.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	19,500	9.98	194,610.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	15.44	77,200.00

METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	1.29	41,280.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	2.30	46,000.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	13.00	52,000.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	3.14	54,950.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	5,000	18.44	92,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	15,000	14.78	221,700.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	7.21	43,260.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	4,100	24.05	98,605.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	10,400	6.81	70,824.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	3,250	42.40	137,800.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	27,000	4.50	121,500.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	9,000	36.45	328,050.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	11.00	110,000.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	4.85	87,300.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	12,000	4.96	59,520.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	2.67	37,380.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	10,000	9.99	99,900.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	12,000	3.23	38,760.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	18,500	2.08	38,480.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	3.94	70,920.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	9.31	111,720.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	8.23	32,920.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	7,500	15.00	112,500.00	
SINOTRANS LIMITED-H	15,000	1.69	25,350.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	10,000	6.03	60,300.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	3.47	43,375.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	24,000	7.01	168,240.00	
BYD CO LTD-H	5,000	44.05	220,250.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	20,000	5.33	106,600.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	17.50	91,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	38,000	12.60	478,800.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	23,500	5.25	123,375.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	22,000	7.03	154,660.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	4.28	47,080.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	8,000	67.60	540,800.00	

BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	2.29	54,960.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	10,000	20.55	205,500.00	
LI NING CO LTD	15,000	25.85	387,750.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	5,800	88.40	512,720.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	13.74	82,440.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	4,000	13.24	52,960.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	3,000	34.90	104,700.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.05	147,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	1,800	41.55	74,790.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	43,900	430.60	18,903,340.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	72,000	0.88	63,360.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	7,700	121.50	935,550.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	9,000	8.98	80,820.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	4,500	35.75	160,875.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	18,000	12.44	223,920.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	21,000	28.55	599,550.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	12,000	40.60	487,200.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	14,500	4.77	69,165.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	14,000	14.18	198,520.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	50.00	100,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	9,000	8.41	75,690.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	37,000	5.39	199,430.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	4,000	68.65	274,600.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	5,500	65.15	358,325.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	28,000	20.30	568,400.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	2,500	111.80	279,500.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,000	12.96	207,360.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,400	13.24	84,736.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	10,400	19.32	200,928.00	
3SBIO INC	13,000	8.80	114,400.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	10,000	9.89	98,900.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.40	48,400.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.31	79,440.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	36,000	15.44	555,840.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	15.72	94,320.00	

HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	31.70	126,800.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	7,000	39.60	277,200.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	8,000	3.90	31,200.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	4,000	26.95	107,800.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	52,500	11.94	626,850.00	
SSY GROUP LTD	10,000	5.22	52,200.00	
WUXI APPTTEC CO LTD-H	1,160	117.80	136,648.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	6,000	135.00	810,000.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	224,000	3.10	694,400.00	
BANK OF CHINA LTD-H	608,000	2.86	1,738,880.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	67,000	4.73	316,910.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	69,000	3.67	253,230.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	737,000	6.09	4,488,330.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	24,000	3.13	75,120.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	30,000	35.95	1,078,500.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	54,100	5.46	295,386.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.21	57,780.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	499,000	5.03	2,509,970.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	61,000	4.56	278,160.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	68,000	1.46	99,280.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	11.16	89,280.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	27,000	3.82	103,140.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.80	82,400.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	10,400	12.18	126,672.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	15,500	14.06	217,930.00	
FAR EAST HORIZON LTD	17,000	6.56	111,520.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	10,400	8.23	85,592.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	10.24	77,824.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	22,400	6.48	145,152.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	12,600	12.34	155,484.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	57,000	14.96	852,720.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	20,000	22.00	440,000.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.85	46,750.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	12,200	12.20	148,840.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,200	26.05	161,510.00	

PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	63,000	2.47	155,610.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	52,000	6.95	361,400.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	42,500	77.10	3,276,750.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	2,300	30.55	70,265.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	10,000	8.28	82,800.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	8.70	78,300.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	14,000	15.60	218,400.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	40,000	5.39	215,600.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	30,000	24.85	745,500.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	24,000	29.75	714,000.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	11,500	24.15	277,725.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	20,000	5.61	112,200.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	58,000	9.93	575,940.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	9,600	9.33	89,568.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	18,000	3.10	55,800.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	9,500	11.68	110,960.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	10,000	12.00	120,000.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	13,500	35.00	472,500.00	
SEAZEN GROUP LTD	16,000	7.20	115,200.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.37	56,880.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	9,000	30.50	274,500.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.33	37,240.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	1.92	44,160.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	2.92	35,040.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	19,000	32.90	625,100.00	
WHARF HOLDINGS LTD	8,000	13.82	110,560.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	52,000	1.43	74,360.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	14,000	3.48	48,720.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.75	57,000.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	18,000	12.58	226,440.00	
KINGSOFT CORP LTD	6,000	27.35	164,100.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	12.88	115,920.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	5,500	40.05	220,275.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,000	17.28	86,400.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	3.57	53,550.00	

	KINGBOARD HOLDINGS LTD	5,000	18.70	93,500.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	8,000	7.53	60,240.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	9.69	32,946.00	
	LENOVO GROUP LTD	54,000	4.25	229,500.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	5,400	118.70	640,980.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	79,800	11.96	954,408.00	
	ZTE CORP-H	5,800	22.50	130,500.00	
	CHINA MOBILE LTD	47,000	56.85	2,671,950.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	106,000	2.43	257,580.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	320,000	1.67	534,400.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	46,000	4.67	214,820.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,000	25.95	103,800.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	38,000	2.96	112,480.00	
	CGN POWER CO LTD-H	82,000	1.78	145,960.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	20,000	27.00	540,000.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	24,000	3.70	88,800.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.58	93,220.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,000	40.70	325,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	14,000	8.49	118,860.00	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	1.08	34,560.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	6,100	88.25	538,325.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	22,000	15.32	337,040.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	2.40	48,000.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	30,000	2.91	87,300.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	26,000	4.70	122,200.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	3.69	40,590.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	16.62	49,860.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	22,500	18.84	423,900.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	30,000	5.56	166,800.00	
	香港ドル 小計	7,036,810		73,587,011.00	(1,019,915,972)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	27,500	3.33	91,575.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	19.72	57,188.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	18,100	5.40	97,740.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	10,500	3.59	37,695.00	

GAMUDA BHD	12,900	3.18	41,022.00
HAP SENG CONSOLIDATED	4,600	7.10	32,660.00
IJM CORP BHD	20,200	1.63	32,926.00
SIME DARBY BERHAD	20,300	1.90	38,570.00
AIRASIA GROUP BHD	22,600	0.73	16,498.00
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	7,400	4.75	35,150.00
MISC BHD	10,100	7.80	78,780.00
WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.49	23,732.00
GENTING BHD	15,800	3.94	62,252.00
GENTING MALAYSIA BHD	21,900	2.25	49,275.00
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	27.02	27,020.00
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,000	31.58	31,580.00
GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.00	27,000.00
IOI CORP BHD	13,600	3.95	53,720.00
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,100	19.82	61,442.00
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	500	139.70	69,850.00
PPB GROUP BERHAD	4,220	16.34	68,954.80
QL RESOURCES BHD	4,600	8.15	37,490.00
SIME DARBY PLANTATION BHD	15,100	4.75	71,725.00
HARTALEGA HOLDINGS BHD	13,600	9.19	124,984.00
IHH HEALTHCARE BHD	16,800	5.47	91,896.00
TOP GLOVE CORP BHD	11,800	10.30	121,540.00
AMMB HOLDINGS BHD	12,700	2.90	36,830.00
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	38,000	3.41	129,580.00
HONG LEONG BANK BERHAD	5,000	13.44	67,200.00
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	12.62	22,716.00
MALAYAN BANKING BHD	30,100	7.40	222,740.00
PUBLIC BANK BERHAD	23,800	15.42	366,996.00
RHB BANK BHD	12,300	4.69	57,687.00
AXIATA GROUP BERHAD	20,500	3.94	80,770.00
DIGI.COM BHD	23,300	4.42	102,986.00
MAXIS BHD	17,600	5.32	93,632.00
TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	4.25	34,425.00
PETRONAS GAS BHD	6,100	15.04	91,744.00
TENAGA NASIONAL BHD	23,900	12.16	290,624.00

	YTL CORP BHD	19,380	0.73	14,147.40	
	マレーシアリングット 小計	532,500		3,094,342.20	(76,492,139)
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	53,000	6.50	344,500.00	
	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.80	385,560.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	10,300	81.75	842,025.00	
	PTT PCL-NVDR	84,600	35.50	3,003,300.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	8,200	41.25	338,250.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	28.00	462,000.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	16,300	40.25	656,075.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	6,000	341.00	2,046,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	32,300	59.75	1,929,925.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	55,500	9.50	527,250.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	52,200	11.60	605,520.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	20,100	18.50	371,850.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	13,225	36.00	476,100.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	44,000	14.00	616,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	8,800	37.25	327,800.00	
	CP ALL PCL-NVDR	44,700	70.25	3,140,175.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	28,900	28.75	830,875.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	41.25	268,125.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	12.60	304,920.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	71,900	19.70	1,416,430.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	3,300	112.50	371,250.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	95.00	389,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,300	84.25	1,120,525.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.00	250,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	6,300	67.25	423,675.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	0.93	199,950.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	4,400	49.25	216,700.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	5,400	53.75	290,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	16,800	47.75	802,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	66,300	6.60	437,580.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	9,000	190.00	1,710,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	60.00	1,104,000.00	

	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	3,100	41.00	127,100.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.16	268,916.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	5,800	44.25	256,650.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	2,200	262.00	576,400.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	12,500	38.00	475,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	5,200	71.50	371,800.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	20,500	38.25	784,125.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	3,200	64.75	207,200.00	
	タイパーツ 小計	1,259,825		29,275,501.00 (98,072,928)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	14,160	42.00	594,720.00	
	AYALA CORPORATION	2,100	690.00	1,449,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	404.00	282,800.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	21,320	49.00	1,044,680.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,805	810.00	1,462,050.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	7,270	82.00	596,140.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	136.60	614,700.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	6,300	132.00	831,600.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	61.00	404,430.00	
	BDO UNIBANK INC	14,910	96.80	1,443,288.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	36.00	479,232.00	
	SECURITY BANK CORP	1,400	92.00	128,800.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	2.75	398,750.00	
	AYALA LAND INC	55,400	32.50	1,800,500.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	2.63	257,740.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	14.98	367,010.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	76,400	30.60	2,337,840.00	
	GLOBE TELECOM INC	250	2,170.00	542,500.00	
	PLDT INC	640	1,201.00	768,640.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	26.50	424,000.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	1,660	275.00	456,500.00		
	フィリピンペソ 小計	512,257		16,684,920.00 (35,538,879)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	945.00	142,600,500.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	1,865.00	74,600,000.00	

	UNITED TRACTORS TBK PT	12,700	15,000.00	190,500,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	190,000	1,150.00	218,500,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	5,025.00	135,172,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	10,800.00	143,640,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	4,390.00	65,850,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	21,500	8,575.00	184,362,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	3,530.00	65,305,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	153,300	3,570.00	547,281,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,305.00	65,250,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	53,300	4,800.00	255,840,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	3,300	47,750.00	157,575,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,790.00	163,069,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	17,300	9,725.00	168,242,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	31,200	6,575.00	205,140,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	56,600	8,300.00	469,780,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	147,500	1,400.00	206,500,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	75,300	24,600.00	1,852,380,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	142,100	3,950.00	561,295,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	55,900	3,540.00	197,886,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	423,700	2,350.00	995,695,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	745.00	19,370,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	625.00	41,250,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	112,200	338.00	37,923,600.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	376,200	3,070.00	1,154,934,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	2,350.00	65,800,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	810.00	106,515,000.00	
	インドネシアルピア 小計	2,529,300		8,492,256,600.00 (61,993,473)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	36,800.00	18,032,000.00	
	S-OIL CORP	338	64,100.00	21,665,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	403	93,600.00	37,720,800.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	771	15,650.00	12,066,150.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	19,800.00	15,582,600.00	
	KCC CORP	54	144,000.00	7,776,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	60	369,500.00	22,170,000.00	

KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	71,600.00	15,608,800.00	
LG CHEM LTD	344	344,500.00	118,508,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	53	153,000.00	8,109,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	126	185,500.00	23,373,000.00	
OCI CO LTD	198	37,800.00	7,484,400.00	
POSCO	583	168,000.00	97,944,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	161	52,300.00	8,420,300.00	
CJ CORP	106	79,300.00	8,405,800.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	207	78,600.00	16,270,200.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	1,310	3,445.00	4,512,950.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	16,250.00	8,352,500.00	
DOOSAN BOBCAT INC	580	23,200.00	13,456,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	439	23,700.00	10,404,300.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	18,600.00	5,189,400.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	581	32,950.00	19,143,950.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	73	236,500.00	17,264,500.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	540	23,400.00	12,636,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	293	76,700.00	22,473,100.00	
LG CORP	720	61,400.00	44,208,000.00	
LOTTE CORP	242	35,950.00	8,699,900.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	500	13,650.00	6,825,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	649	98,500.00	63,926,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	10,800.00	17,323,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,282	4,125.00	13,538,250.00	
SK HOLDINGS CO LTD	266	181,000.00	48,146,000.00	
S-1 CORPORATION	120	91,500.00	10,980,000.00	
CJ LOGISTICS	65	144,500.00	9,392,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	139	99,900.00	13,886,100.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	341	18,900.00	6,444,900.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	3,320.00	10,879,640.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	552	20,500.00	11,316,000.00	
HANON SYSTEMS	1,394	8,990.00	12,532,060.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	509	169,500.00	86,275,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,141	92,300.00	105,314,300.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	273	57,000.00	15,561,000.00	

HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	54,700.00	9,299,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,005	28,700.00	57,543,500.00	
COWAY CO LTD	391	62,100.00	24,281,100.00	
FILA HOLDINGS CORP	364	30,950.00	11,265,800.00	
HLB INC	254	100,200.00	25,450,800.00	
LG ELECTRONICS INC	810	54,200.00	43,902,000.00	
KANGWON LAND INC	869	22,500.00	19,552,500.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	499	17,150.00	8,557,850.00	
KAKAO CORP	393	225,000.00	88,425,000.00	
NAVER CORP	1,070	219,000.00	234,330,000.00	
NCSOFT CORP	125	753,000.00	94,125,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	193	94,700.00	18,277,100.00	
PEARL ABYSS CORP	70	207,100.00	14,497,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	114,000.00	12,882,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	233	80,800.00	18,826,400.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	100	64,900.00	6,490,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	89,000.00	7,120,000.00	
SHINSEGAE INC	54	238,000.00	12,852,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	156,000.00	8,892,000.00	
E-MART INC	157	112,000.00	17,584,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	42,800.00	8,346,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	59	301,000.00	17,759,000.00	
KT&G CORP	881	77,100.00	67,925,100.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	173	133,500.00	23,095,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	534,000.00	6,942,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	242	176,000.00	42,592,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	209	55,000.00	11,495,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	71	1,455,000.00	103,305,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	711,000.00	10,665,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	403	94,300.00	38,002,900.00	
CELLTRION INC	716	217,000.00	155,372,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	46	252,500.00	11,615,000.00	
HELIXMITH CO LTD	165	66,000.00	10,890,000.00	
MEDY-TOX INC	47	141,700.00	6,659,900.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	124	612,000.00	75,888,000.00	

	YUHAN CORP	335	51,600.00	17,286,000.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	4,440.00	11,299,800.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	2,294	24,800.00	56,891,200.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	7,370.00	19,095,670.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	2,970	30,950.00	91,921,500.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,504	28,900.00	101,265,600.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,092	7,810.00	31,958,520.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	317	45,500.00	14,423,500.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,280.00	7,599,760.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	5,440.00	16,303,680.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	9,100.00	14,014,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	217	29,050.00	6,303,850.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	474	27,200.00	12,892,800.00	
	DB INSURANCE CO LTD	482	48,200.00	23,232,400.00	
	HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	1,685.00	6,947,255.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	26,150.00	11,793,650.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	232	197,000.00	45,704,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	521	44,550.00	23,210,550.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	266	174,500.00	46,417,000.00	
	KMW CO LTD	187	57,100.00	10,677,700.00	
	LG DISPLAY CO LTD	1,734	10,300.00	17,860,200.00	
	LG INNOTEK CO LTD	103	143,000.00	14,729,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	424	119,500.00	50,668,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	36,561	48,000.00	1,754,928,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	6,289	40,650.00	255,647,850.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	419	308,000.00	129,052,000.00	
	LG UPLUS CORP	1,577	14,000.00	22,078,000.00	
	SK TELECOM	151	207,000.00	31,257,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	1,961	23,150.00	45,397,150.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	27,100.00	6,097,500.00	
	SK HYNIX INC	4,168	80,600.00	335,940,800.00	
	韓国ウォン 小計	122,015		5,595,417,785.00 (490,158,597)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	10,000	86.70	867,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	17,000	43.80	744,600.00	

CHINA STEEL CORP	90,000	19.55	1,759,500.00	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	27,000	72.60	1,960,200.00	
FORMOSA PLASTICS CORP	34,000	83.50	2,839,000.00	
NAN YA PLASTICS CORP	39,000	62.70	2,445,300.00	
TAIWAN CEMENT	38,121	42.60	1,623,954.60	
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	523.00	523,000.00	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	25,000	26.65	666,250.00	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,111	286.50	604,801.50	
CHINA AIRLINES LTD	17,000	8.04	136,680.00	
EVA AIRWAYS CORP	26,023	11.00	286,253.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	10.35	326,542.50	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	15,000	33.60	504,000.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	15,000	32.00	480,000.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,020	263.00	268,260.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	154.00	523,600.00	
FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	33.60	336,000.00	
GIANT MANUFACTURING	3,000	187.00	561,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	236.00	236,000.00	
POU CHEN	17,000	26.95	458,150.00	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	66.10	158,640.00	
TATUNG CO LTD	15,000	20.50	307,500.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	515.00	1,030,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,000	302.50	1,210,000.00	
STANDARD FOODS CORP	3,120	67.80	211,536.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	37,000	70.00	2,590,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	40,554	18.80	762,415.20	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	141,000	19.55	2,756,550.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	78,425	26.90	2,109,632.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	75,551	21.90	1,654,566.90	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	59,778	19.05	1,138,770.90	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	83,000	30.25	2,510,750.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	81,995	11.70	959,341.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	73,785	12.30	907,555.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	42,545	10.70	455,231.50	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	67,626	20.05	1,355,901.30	

THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	25,000	42.55	1,063,750.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	9,536	113.00	1,077,568.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	77,000	16.30	1,255,100.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	60,000	39.15	2,349,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	97,000	8.99	872,030.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	20.00	526,400.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	51,000	40.55	2,068,050.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	81,835	8.16	667,773.60	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	43.05	258,300.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	43.65	275,868.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	4,000	211.00	844,000.00	
ACER INC	22,000	16.15	355,300.00	
ADVANTECH CO LTD	3,000	283.00	849,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	5,000	208.00	1,040,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	7.66	658,760.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	5,000	232.50	1,162,500.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	80.80	405,212.00	
COMPAL ELECTRONICS	32,000	18.60	595,200.00	
DELTA ELECTRONICS INC	15,000	140.00	2,100,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	55.50	388,500.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	95,800	78.20	7,491,560.00	
INNOLUX CORP	63,000	6.22	391,860.00	
INVENTEC CORP	19,000	23.55	447,450.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	500	4,110.00	2,055,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	16,000	46.85	749,600.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	5,000	102.50	512,500.00	
PEGATRON CORP	15,000	66.00	990,000.00	
QUANTA COMPUTER INC	21,000	65.00	1,365,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	41.40	414,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	189.00	567,000.00	
WISTRON CORP	21,951	27.95	613,530.45	
WIWYNN CORP	1,000	801.00	801,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	11,960	39.05	467,038.00	
YAGEO CORPORATION	2,198	385.50	847,329.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	113.50	454,000.00	

	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	29,000	110.00	3,190,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	12,000	65.90	790,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	13,000	107.00	1,391,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	26,000	66.50	1,729,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	372.50	745,000.00	
	MEDIATEK INC	12,000	411.00	4,932,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	9,000	60.00	540,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	4,000	203.50	814,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	278.50	278,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	104.00	624,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	246.00	984,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	188,000	293.00	55,084,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	85,000	15.35	1,304,750.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	7,000	71.70	501,900.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	267.00	801,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	12.80	281,600.00	
	新台湾ドル 小計	2,567,439		149,239,211.95 (535,768,770)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	4,846	309.70	1,500,806.20	
	COAL INDIA LTD	9,401	128.65	1,209,438.65	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,566	190.25	868,681.50	
	INDIAN OIL CORP LTD	14,264	75.15	1,071,939.60	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	19,149	76.15	1,458,196.35	
	PETRONET LNG LTD	4,527	231.45	1,047,774.15	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	21,730	1,435.95	31,203,193.50	
	AMBUJA CEMENTS LTD	4,499	182.50	821,067.50	
	ASIAN PAINTS LTD	2,148	1,522.40	3,270,115.20	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	1,709	454.95	777,509.55	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	2,182	511.40	1,115,874.80	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	8,818	117.20	1,033,469.60	
	JSW STEEL LTD	6,406	175.20	1,122,331.20	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	882	1,360.95	1,200,357.90	
	SHREE CEMENT LTD	62	19,310.80	1,197,269.60	
	TATA STEEL LTD	2,553	268.55	685,608.15	
	ULTRATECH CEMENT LTD	745	3,609.50	2,689,077.50	

UPL LTD	3,989	391.85	1,563,089.65
VEDANTA LTD	14,097	89.15	1,256,747.55
ASHOK LEYLAND LTD	8,912	49.30	439,361.60
HAVELLS INDIA LTD	1,908	500.95	955,812.60
LARSEN & TOUBRO LTD	3,649	871.65	3,180,650.85
SIEMENS LTD	766	1,049.15	803,648.90
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,572	308.40	1,410,004.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	378.45	591,138.90
INTERGLOBE AVIATION LTD	699	971.75	679,253.25
BAJAJ AUTO LTD	641	2,702.65	1,732,398.65
BHARAT FORGE LTD	1,595	276.30	440,698.50
BOSCH LTD	73	9,516.65	694,715.45
EICHER MOTORS LTD	102	14,031.85	1,431,248.70
HERO MOTOCORP LTD	747	2,241.35	1,674,288.45
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,702	400.45	2,283,365.90
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	809	5,114.05	4,137,266.45
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,207	79.95	576,199.65
TATA MOTORS LTD	12,966	83.80	1,086,550.80
PAGE INDUSTRIES LTD	54	17,612.90	951,096.60
TITAN CO LTD	2,382	846.00	2,015,172.00
INFO EDGE INDIA LTD	465	2,695.80	1,253,547.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	6,575	169.65	1,115,448.75
AVENUE SUPERMARTS LTD	959	2,324.40	2,229,099.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	426	3,118.70	1,328,566.20
ITC LTD	26,091	163.80	4,273,705.80
NESTLE INDIA LTD	174	16,242.50	2,826,195.00
UNITED SPIRITS LTD	2,148	539.80	1,159,490.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,349.55	944,685.00
DABUR INDIA LTD	4,007	458.60	1,837,610.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,699	564.45	1,523,450.55
HINDUSTAN UNILEVER LTD	6,302	2,006.05	12,642,127.10
MARICO LTD	3,373	318.25	1,073,457.25
AUROBINDO PHARMA LTD	1,910	665.60	1,271,296.00
CIPLA LTD	2,552	569.75	1,454,002.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	588	2,366.60	1,391,560.80

DR. REDDY'S LABORATORIES	861	3,732.00	3,213,252.00	
LUPIN LTD	1,634	863.05	1,410,223.70	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	728	874.40	636,563.20	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	6,321	455.95	2,882,059.95	
AXIS BANK LTD	15,990	401.95	6,427,180.50	
BANDHAN BANK LTD	3,094	251.80	779,069.20	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	12,523	1,632.40	20,442,545.20	
ICICI BANK LTD	36,030	327.40	11,796,222.00	
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	261.15	607,696.05	
STATE BANK OF INDIA	13,486	167.95	2,264,973.70	
BAJAJ FINANCE LTD	1,385	2,112.00	2,925,120.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	330	2,501.25	825,412.50	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,357	168.40	396,918.80	
REC LTD	7,000	99.85	698,950.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	648.20	423,922.80	
BAJAJ FINSERV LTD	290	4,790.25	1,389,172.50	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,828	495.00	1,894,860.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,377	1,243.50	1,712,299.50	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,589	384.20	994,693.80	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,655	746.75	1,982,621.25	
DLF LTD	4,542	137.05	622,481.10	
HCL TECHNOLOGIES LTD	8,336	517.45	4,313,463.20	
INFOSYS LTD	26,108	658.15	17,182,980.20	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	6,903	1,902.35	13,131,922.05	
TECH MAHINDRA LTD	3,566	515.70	1,838,986.20	
WIPRO LTD	8,812	186.00	1,639,032.00	
BHARTI AIRTEL LTD	19,132	539.85	10,328,410.20	
BHARTI INFRATEL LTD	2,400	209.65	503,160.00	
GAIL INDIA LTD	12,271	85.45	1,048,556.95	
NTPC LTD	18,398	89.35	1,643,861.30	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	14,117	160.80	2,270,013.60	
TATA POWER CO LTD	14,068	30.90	434,701.20	
インドルピー 小計	494,000		235,160,986.50 (336,280,210)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	3,800	15.96	60,648.00

	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	33,600	1.88	63,168.00	
	INDUSTRIES QATAR	13,913	7.70	107,130.10	
	COMMERCIAL BANK PQSC	15,400	3.83	58,982.00	
	MASRAF AL RAYAN	28,402	3.77	107,160.74	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	5,838	7.86	45,892.51	
	QATAR ISLAMIC BANK	8,916	14.97	133,472.52	
	QATAR NATIONAL BANK	34,767	17.15	596,254.05	
	QATAR INSURANCE CO	12,020	2.00	24,040.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	14,730	2.80	41,244.00	
	OOREDOO QPSC	5,987	6.25	37,418.75	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4,215	14.93	62,929.95	
	カタールリアル 小計	181,588		1,338,340.62	(39,320,447)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	1,800	101.34	182,412.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	400	935.55	374,220.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	3,079	487.95	1,502,398.05	
	GOLD FIELDS LTD	6,232	154.96	965,710.72	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	5,910	100.38	593,245.80	
	KUMBA IRON ORE LTD	471	366.96	172,838.16	
	NORTHAM PLATINUM LTD	2,585	82.01	211,995.85	
	SASOL LTD	4,129	73.87	305,009.23	
	SIBANYE STILLWATER LTD	17,009	33.48	569,461.32	
	BIDVEST GROUP LTD	2,176	138.20	300,723.20	
	MULTICHOICE GROUP LTD	3,305	83.08	274,579.40	
	MR PRICE GROUP LTD	1,902	117.63	223,732.26	
	NASPERS LTD-N SHS	3,401	3,145.65	10,698,355.65	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	9.85	98,017.35	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	61.93	145,659.36	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	7,365	27.75	204,378.75	
	BID CORP LTD	2,540	219.80	558,292.00	
	CLICKS GROUP LTD	1,983	220.00	436,260.00	
	PICK N PAY STORES LTD	2,743	48.10	131,938.30	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,572	101.00	360,772.00	
SPAR GROUP LIMITED/THE	1,441	168.30	242,520.30		
TIGER BRANDS LTD	1,150	179.10	205,965.00		

	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	16.68	212,886.84	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,814	129.30	363,850.20	
	ABSA GROUP LTD	5,491	74.43	408,695.13	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	351	793.68	278,581.68	
	NEDBANK GROUP LTD	2,832	80.69	228,514.08	
	STANDARD BANK GROUP LTD	9,828	84.41	829,581.48	
	FIRSTRAND LTD	25,693	34.22	879,214.46	
	INVESTEC LTD	3,650	33.27	121,435.50	
	PSG GROUP LTD	1,136	147.55	167,616.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,113	286.33	318,685.29	
	REMGRO LTD	4,030	127.20	512,616.00	
	RMB HOLDINGS LTD	5,881	45.48	267,467.88	
	DISCOVERY LTD	2,908	88.21	256,514.68	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	800	61.23	48,984.00	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	15.96	160,908.72	
	OLD MUTUAL LTD	35,316	11.98	423,085.68	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,580	22.98	128,228.40	
	SANLAM LTD	14,192	52.80	749,337.60	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	2,895	80.00	231,600.00	
	MTN GROUP LTD	12,732	44.82	570,648.24	
	TELKOM SA SOC LTD	2,500	18.35	45,875.00	
	VODACOM GROUP LTD	4,831	130.02	628,126.62	
	南アフリカランド 小計	252,914		26,590,938.98	(154,759,264)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	21,061	4.04	85,086.44	
	DUBAI ISLAMIC BANK	12,440	3.40	42,296.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	20,807	11.08	230,541.56	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	29,017	1.73	50,199.41	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.19	36,502.06	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	26,305	2.38	62,605.90	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	13,270	15.32	203,296.40	
	アラブディルハム 小計	153,574		710,527.77	(20,818,463)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.17	12,340.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.38	51,684.00	

CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	15.87	23,805.00
GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.43	2,673.00
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.94	2,470.00
PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.40	22,440.00
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	7.20	18,000.00
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	5.46	1,638.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.55	24,235.00
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	4.70	1,880.00
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	26.30	23,670.00
YANZHOU COAL MINING CO-A	991	8.22	8,146.02
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	2.76	5,796.00
ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.59	2,020.20
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,800	59.18	106,524.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	4.83	38,640.00
BBMG CORPORATION-A	900	3.31	2,979.00
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	37.20	44,640.00
BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	2,000	4.07	8,140.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	9.14	26,506.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	3.47	23,596.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	9.38	4,690.00
GEM CO LTD-A	3,500	4.52	15,820.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	6.40	8,960.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	13.46	48,725.20
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,500	12.06	18,090.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.04	3,060.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	27.88	30,668.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.08	14,280.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.10	19,690.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	2.83	9,905.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	83.30	24,990.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	12.72	3,816.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	49.05	9,810.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	5.97	2,388.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	16.98	28,866.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,200	8.08	9,696.00

MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.57	1,799.00
NANJING IRON & STEEL CO-A	3,700	2.82	10,434.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	1.99	14,328.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	11.73	4,692.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	7.06	14,826.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,120	36.02	40,342.40
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	17.44	24,416.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.07	20,700.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	23.89	19,112.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	8.68	19,096.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.49	16,752.00
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	3,800	3.01	11,438.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,500	7.12	10,680.00
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	3.59	1,795.00
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	7,400	1.37	10,138.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.86	2,316.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	20.92	23,012.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	18.08	3,616.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	11.52	17,280.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	1.92	2,880.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.91	7,683.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,400	46.01	64,414.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	58.10	23,240.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	11.61	13,932.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	1,800	4.63	8,334.00
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	3,300	3.38	11,154.00
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	2,700	4.11	11,097.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	16.00	27,200.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	53.80	32,280.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	1,400	8.28	11,592.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	35.48	9,224.80
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	1,200	8.62	10,344.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	6.55	15,065.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	12.22	4,888.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.32	3,328.00

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	8,800	3.83	33,704.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	13.27	13,270.00
AECC AVIATION POWER CO-A	200	24.31	4,862.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	17.83	7,132.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	8.21	24,630.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	35.12	3,512.00
AVICOPTER PLC-A	500	44.90	22,450.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	23.50	32,900.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	2.77	27,700.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	6.86	15,778.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	13.79	1,379.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	8.03	2,409.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.36	3,180.00
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	240	7.29	1,749.60
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	13.89	12,501.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.80	2,900.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	3,800	9.48	36,024.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.58	51,336.00
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	1,900	9.60	18,240.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	10,300	4.16	42,848.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	35.01	3,501.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	19,100	5.09	97,219.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,000	135.60	135,600.00
CRRC CORP LTD-A	11,000	6.10	67,100.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	9.20	5,520.00
EVE ENERGY CO LTD-A	800	65.72	52,576.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	298	8.85	2,637.30
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	23.70	23,700.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	44.69	26,814.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	31.31	9,393.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	10.50	14,700.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	700	73.85	51,695.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	12.36	32,136.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.60	4,680.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	1,439	19.99	28,765.61

POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.61	14,440.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,800	20.03	76,114.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.17	17,752.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	4.61	3,688.00	
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	700	14.14	9,898.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.55	1,665.00	
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	700	14.40	10,080.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	35.30	24,710.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	13.22	17,186.00	
SINOCHEM INTL CORP-A	2,300	4.87	11,201.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	15.44	20,072.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.16	3,264.00	
TBEA CO LTD-A	400	7.70	3,080.00	
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	3,500	2.96	10,360.00	
WEICHAO POWER CO LTD-A	2,700	13.95	37,665.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	6.37	7,007.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	8.67	2,601.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	10.04	4,016.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	24.93	4,986.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	300	92.79	27,837.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,300	22.58	51,934.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	12.59	16,367.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	13.31	2,662.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	6.87	6,183.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	9.57	24,882.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	18.28	25,592.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	52.90	42,320.00	
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	200	7.73	1,546.00	
AIR CHINA LTD-A	800	6.73	5,384.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.14	5,382.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	5.10	5,610.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	1.88	2,820.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	3.35	4,020.00	
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	3,400	1.73	5,882.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	5,100	6.93	35,343.00	

GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	2.30	2,300.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	13.67	10,936.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	9.21	6,447.00	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.36	18,480.00	
S F HOLDING CO LTD-A	700	45.78	32,046.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	67.09	20,127.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.04	4,040.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	7.70	14,630.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.27	6,540.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	34.37	3,437.00	
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	2,700	2.27	6,129.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	900	31.62	28,458.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	5.45	17,440.00	
BYD CO LTD -A	800	57.69	46,152.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	110.11	22,022.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	10.62	5,310.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	20.12	4,024.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	10.08	2,016.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	20.94	29,316.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	19.94	23,928.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	3,510	18.94	66,479.40	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	20.20	2,020.00	
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	4.93	1,972.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	21.20	2,120.00	
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	6.44	12,880.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	58.57	81,998.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,800	15.12	42,336.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	31.89	3,189.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	15.16	13,644.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	110.45	11,045.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	20.25	8,100.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	4.99	30,938.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.18	2,872.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	68.55	20,565.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	15.26	12,208.00	

SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	27.88	16,728.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.08	6,688.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	600	29.90	17,940.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	11.00	14,300.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	13.06	2,612.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.90	2,180.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.24	1,224.00
CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	3.20	1,600.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	4.90	59,290.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	17.42	3,484.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	510	48.55	24,760.50
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	15.91	17,501.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.06	2,718.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	45.70	4,570.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	17.03	15,327.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	36.85	33,165.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	19.69	7,876.00
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	3.39	1,695.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	900	88.85	79,965.00
HLA CORP LTD -A	200	6.06	1,212.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	17.75	3,550.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.74	38,700.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	8.51	28,083.00
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	300	18.40	5,520.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.56	27,360.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	78.00	15,600.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	300	94.91	28,473.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	9.88	30,628.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	40.39	28,273.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	150.78	45,234.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	45.82	22,910.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.29	4,645.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	53.66	32,196.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.29	15,096.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	58.35	23,340.00

CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	35.65	24,955.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,200	110.32	132,384.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	24.72	22,248.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	45.51	59,163.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	16.45	41,125.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	42.58	51,096.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,600	29.00	75,400.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	35.95	35,950.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	600	97.85	58,710.00
JIANGXI ZHENGHANG TECH -A	2,000	16.38	32,760.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	50.37	15,111.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	58.65	17,595.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	1,326.59	795,954.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	600	87.80	52,680.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	900	112.83	101,547.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	30.10	78,260.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	400	116.73	46,692.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	48.43	19,372.00
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	1,000	11.13	11,130.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	49.90	24,950.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	14.11	46,563.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	60.32	6,032.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	2,300	28.40	65,320.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	1,700	146.30	248,710.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	17.63	19,393.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	18.61	24,193.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	36.60	21,960.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	1,170	47.91	56,054.70
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	136.51	13,651.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	40.07	8,014.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	30.29	12,116.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	69.18	13,836.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	21.32	5,116.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	200	120.00	24,000.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	34.19	17,095.00

JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	18.43	3,686.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	39.98	27,986.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	12.54	6,019.20
OVCTEK CHINA INC-A	200	75.98	15,196.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	17.99	3,598.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	267.80	133,900.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	132.88	13,288.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	800	25.36	20,288.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	201.19	40,238.00
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	900	11.10	9,990.00
BEIJING Tiantan Biological-A	900	34.78	31,302.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	25.03	5,006.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	104.19	31,257.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	104.00	31,200.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	643.00	64,300.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	38.07	22,842.00
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	900	12.66	11,394.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	28.56	2,856.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	500	81.92	40,960.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	32.12	3,212.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	31.10	6,220.00
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	1,200	8.61	10,332.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	81.98	24,594.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	37.58	29,312.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	21.85	15,295.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	1,900	97.20	184,680.00
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.27	15,270.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	25.40	22,860.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	13.04	20,864.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	40.62	20,310.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	500	61.75	30,875.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	21.82	5,673.20
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	32.35	6,470.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	23.60	21,240.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	141.58	42,474.00

SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	19.24	1,924.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,000	32.00	32,000.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	20.74	4,148.00
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	14.56	2,912.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	14.30	2,860.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	42.58	25,548.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	600	110.22	66,132.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	21.06	21,060.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	88.98	44,490.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	300	148.31	44,493.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.28	11,616.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,100	26.93	29,623.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	25.92	46,137.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	58.55	23,420.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	34,400	3.39	116,616.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	4.89	36,675.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	7.76	11,640.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.45	56,235.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	18,100	5.12	92,672.00
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	280	7.68	2,150.40
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	8.52	4,260.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.92	18,944.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	7.64	18,336.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	24.75	84,150.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.03	70,744.30
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.07	3,042.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.32	18,960.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	18,400	3.65	67,160.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	9,000	33.93	305,370.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	16,400	5.77	94,628.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.40	28,160.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	24,900	5.10	126,990.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	9,600	16.02	153,792.00
PING AN BANK CO LTD-A	9,000	13.30	119,700.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	13,500	10.30	139,050.00

ANXIN TRUST CO LTD-A	500	2.50	1,250.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	3.89	3,501.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	9.56	14,340.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	6.31	5,048.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,600	17.49	45,474.00
CITIC SECURITIES CO-A	4,500	23.44	105,480.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	1,300	34.51	44,863.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.75	2,150.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	3,100	17.89	55,459.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	11.05	4,420.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.96	3,480.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	7.13	51,336.00
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	13.51	36,477.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	10.71	6,426.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,500	16.11	56,385.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.95	3,975.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	3,700	12.54	46,398.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	117.60	23,520.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	7.26	2,904.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	3,400	17.77	60,418.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	10.22	3,066.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	5.92	4,144.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	14.50	23,200.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.17	24,510.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	9.35	48,620.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.22	10,304.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	12.19	7,314.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.40	11,000.00
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A	800	7.76	6,208.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.02	2,808.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.48	68,096.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	10.11	3,033.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	7.73	2,319.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.48	17,024.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.03	4,015.00

ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	9.93	12,909.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,200	27.25	32,700.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	2,800	28.88	80,864.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.46	3,276.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	44.29	39,861.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4,900	72.23	353,927.00
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	6.28	13,816.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.11	13,974.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,100	22.50	24,750.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	16.30	58,680.00
CHINA VANKE CO LTD -A	4,400	25.49	112,156.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.56	2,624.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	31.40	25,120.00
GEMDALE CORP-A	600	12.74	7,644.00
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	5.18	13,986.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	5.58	6,696.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	8.00	24,800.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	8.15	5,705.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	3.39	4,068.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	5,400	15.35	82,890.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	7.82	4,692.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	13.01	11,709.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	5.40	13,500.00
TAHOE GROUP CO LTD-A	2,100	4.25	8,925.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.06	3,672.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.74	22,916.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	17.66	5,298.00
AISINO CORP-A	200	16.92	3,384.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	32.11	3,211.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	27.93	19,551.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	84.49	16,898.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	23.21	16,247.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	13.24	5,296.00
GLODON CO LTD-A	500	50.96	25,480.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	130	104.65	13,604.50

IFLYTEK CO LTD - A	1,000	33.89	33,890.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	16.81	8,405.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	184.36	18,436.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	2.99	2,332.20
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	54.00	21,600.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	16.85	6,740.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	40.27	16,108.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	8.20	7,380.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,160	48.15	55,854.00
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	30.84	18,504.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	35.72	32,148.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	3.86	79,130.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	21.22	14,854.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	12.95	33,670.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	38.98	43,657.60
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	35.01	38,511.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	1,200	13.69	16,428.00
GOERTEK INC -A	500	21.06	10,530.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	13.62	29,964.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	9.43	23,575.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	12.84	3,852.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	4,100	31.21	127,961.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	17.18	3,436.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	5.34	14,952.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	15.82	14,238.00
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	1,700	6.87	11,679.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	42.19	25,314.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	18.52	24,076.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	5.84	13,432.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	2,380	48.81	116,167.80
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	155.87	31,174.00
NINESTAR CORP-A	100	30.77	3,077.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	16.08	6,432.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	32.35	32,350.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	179.29	50,201.20

SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	44.04	39,636.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	26.81	18,767.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	14.07	4,221.00
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	2.84	2,272.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,340	43.08	57,727.20
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	18.47	24,011.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	22.88	18,304.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	111.24	77,868.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	800	43.84	35,072.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	26.95	43,120.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	38.95	15,580.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	200	93.50	18,700.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	16.87	6,748.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	65.00	32,500.00
ZTE CORP-A	1,600	40.68	65,088.00
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	5.13	70,794.00
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	4.77	11,925.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.24	18,232.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	10,100	17.15	173,215.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	1.90	5,320.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.65	4,745.00
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.34	3,472.00
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.52	2,112.00
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.58	12,642.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	7.61	8,371.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.35	16,170.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.27	3,689.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	5.37	2,685.00
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	700	8.93	6,251.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	2.51	10,793.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	214.73	30,062.20
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	14.91	29,820.00
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,200	30.53	36,636.00
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	24.21	38,736.00
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	234.00	58,500.00

	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	18.55	42,665.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	69.41	34,705.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	13.33	14,663.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	200	207.02	41,404.00	
	オフショア人民元 小計	950,248		13,178,220.33	(198,991,126)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	13.18	21,443.86	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	9,149	31.40	287,278.60	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	724	46.65	33,774.60	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	9.61	36,345.02	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	14.00	49,000.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	1,197	70.50	84,388.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	3,179	33.60	106,814.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	5,669	76.00	430,844.00	
	SAUDI CEMENT	565	44.25	25,001.25	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	1,544	18.74	28,934.56	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	5,300	8.14	43,142.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	1,676	48.00	80,448.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	75.30	31,776.60	
	JARIR MARKETING CO	429	127.40	54,654.60	
	ALMARAI CO	1,821	46.10	83,948.10	
	SAVOLA	1,962	38.70	75,929.40	
	AL RAJHI BANK	9,410	54.00	508,140.00	
	ALINMA BANK	7,493	14.52	108,798.36	
	ARAB NATIONAL BANK	4,532	17.80	80,669.60	
	BANK AL-JAZIRA	3,069	10.96	33,636.24	
	BANK ALBILAD	2,768	21.62	59,844.16	
	BANQUE SAUDI FRANSI	4,201	29.05	122,039.05	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	9,198	34.15	314,111.70	
	RIYAD BANK	9,144	15.20	138,988.80	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	7,527	20.40	153,550.80	
SAUDI BRITISH BANK	5,498	22.60	124,254.80		
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	298	109.60	32,660.80		
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	65.50	43,295.50		
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	6.99	27,554.58		

	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	6.67	28,647.65	
	ETIHAD ETISALAT CO	2,827	25.70	72,653.90	
	SAUDI TELECOM CO	2,986	94.40	281,878.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	6,559	16.36	107,305.24	
	サウジアラビアリアル 小計	126,954		3,711,753.07	(106,304,607)
	合 計	21,630,493		4,180,001,412	(4,180,001,412)

(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	23,900	423,747.00	
		メキシコペソ 小計	23,900	423,747.00	(1,902,624)
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	119,185.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	22,674	279,343.68	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	40,872	70,299.84	
	南アフリカランド 小計	75,646	468,828.52	(2,728,581)	
	合 計			4,631,205	(4,631,205)

(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 59銘柄	100.0%		15.4%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.5%		1.8%
	投資証券 1銘柄		2.5%	0.0%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.0%		4.4%

チリペソ	株式	17銘柄	100.0%		0.6%
コロンビアペソ	株式	7銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式	8銘柄	100.0%		0.2%
トルコリラ	株式	15銘柄	100.0%		0.4%
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	18銘柄	100.0%		0.7%
香港ドル	株式	205銘柄	100.0%		24.5%
マレーシアリングット	株式	40銘柄	100.0%		1.8%
タイバーツ	株式	40銘柄	100.0%		2.3%
フィリピンペソ	株式	21銘柄	100.0%		0.8%
インドネシアルピア	株式	28銘柄	100.0%		1.5%
韓国ウォン	株式	108銘柄	100.0%		11.7%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%		12.9%
インドルピー	株式	84銘柄	100.0%		8.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		0.9%
南アフリカランド	株式	44銘柄	98.3%		3.7%
	投資証券	3銘柄		1.7%	0.1%
アラブディルハム	株式	7銘柄	100.0%		0.5%
オフショア人民元	株式	461銘柄	100.0%		4.8%
サウジアラビアリアル	株式	33銘柄	100.0%		2.5%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	92,549,797
コール・ローン	10,700,379
投資信託受益証券	3,953,745,835
流動資産合計	4,056,996,011
資産合計	
4,056,996,011	
負債の部	
流動負債	
未払金	80,714,522
未払利息	29
その他未払費用	45
流動負債合計	80,714,596
負債合計	
80,714,596	
純資産の部	
元本等	
元本	4,118,316,761
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	142,035,346
元本等合計	3,976,281,415
純資産合計	
3,976,281,415	
負債純資産合計	
4,056,996,011	

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	2,584,358,217円
期中追加設定元本額	5,315,652,382円
期中一部解約元本額	3,781,693,838円
期末元本額	4,118,316,761円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	607,009,687円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	417,049,560円
りそなラップ型ファンド(成長型)	208,197,245円
DCりそな グローバルバランス	11,475,631円
つみたてバランスファンド	320,404,042円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	139,605,981円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	65,916,996円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	38,506,835円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,728,994円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,237,285円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	821,628円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	839,554円
リスクコントロール・オープン	482,221円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	247,977,722円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,735,745,448円
Smart-i 8資産バランス 安定型	18,690,095円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	46,777,584円
Smart-i 8資産バランス 成長型	49,966,323円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	44,163,302円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	39,851,412円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	22,441,629円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	16,199,459円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	80,664,153円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	563,975円
2. 計算日における受益権の総数	4,118,316,761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	142,035,346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	0.9655円
(10,000口当たり純資産額)	(9,655円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額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）

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		488,671,900
合計		488,671,900

(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	481,085	25,309,881.85	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	395,224	11,493,113.92	
		米ドル 小計	876,309	36,802,995.77 (3,953,745,835)	
合計				3,953,745,835 (3,953,745,835)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RAM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	269,933,356
投資証券	14,535,809,650
派生商品評価勘定	31,790
未収入金	289,050
未収配当金	176,109,427
前払金	70,779,200
差入委託証拠金	51,212,500
流動資産合計	15,104,164,973
資産合計	15,104,164,973
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	79,029,250
未払解約金	78,000,000
未払利息	732
その他未払費用	509
流動負債合計	157,030,491
負債合計	157,030,491
純資産の部	
元本等	
元本	14,073,485,169
剰余金	
剰余金又は欠損金()	873,649,313

2020年 5月15日現在

元本等合計	14,947,134,482
純資産合計	14,947,134,482
負債純資産合計	15,104,164,973

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)

2020年 5月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	12,801,763,774円
期中追加設定元本額	17,634,543,896円
期中一部解約元本額	16,362,822,501円
期末元本額	14,073,485,169円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	533,997,557円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	369,531,036円
りそなラップ型ファンド(成長型)	193,108,034円
DCりそな グローバルバランス	10,096,139円
つみたてバランスファンド	573,981,121円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	147,692,054円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	68,545,351円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	38,716,126円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,923,160円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,389,844円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	847,193円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	866,248円
リスクコントロール・オープン	419,397円

FWりそな国内リートインデックスオープン	3,307,006,204円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,185,956,116円
Smart-i Jリートインデックス	2,108,337,604円
Smart-i 8資産バランス 安定型	17,179,490円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	51,742,976円
Smart-i 8資産バランス 成長型	51,343,429円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	38,398,009円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	34,649,260円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	19,512,158円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	14,085,139円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	70,085,803円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,780,296,297円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	501,155円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	451,278,269円
2. 計算日における受益権の総数	14,073,485,169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	1.0621円
(10,000口当たり純資産額)	(10,621円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。

2.時価の算定方法

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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		5,117,153,203
合計		5,117,153,203

(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）

（2020年 5月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	490,765,460	-	411,768,000	78,997,460
合計		490,765,460	-	411,768,000	78,997,460

(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	220	21,428,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	262	26,252,400	
	S O S i L A 物流リート投資法人	403	50,536,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	602	358,792,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,323	172,831,200	
	森ヒルズリート投資法人	2,083	276,205,800	
	産業ファンド投資法人	2,332	366,124,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,718	563,504,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,181	192,148,700	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	907	302,484,500	
	G L P 投資法人	4,510	605,693,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	788	237,188,000	
日本プロロジスリート投資法人	2,725	829,762,500		

星野リゾート・リート投資法人	276	102,948,000	
Oneリート投資法人	282	65,762,400	
イオンリート投資法人	1,954	213,963,000	
ヒューリックリート投資法人	1,540	182,336,000	
日本リート投資法人	588	194,628,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	11,634	165,319,140	
積水ハウス・リート投資法人	5,295	330,937,500	
トーセイ・リート投資法人	394	37,824,000	
ケネディクス商業リート投資法人	699	130,293,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人	386	44,351,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人	362	34,172,800	
野村不動産マスターファンド投資法人	5,846	683,982,000	
いちごホテルリート投資法人	300	16,320,000	
ラサールロジポート投資法人	1,684	253,610,400	
スターアジア不動産投資法人	601	48,741,100	
マリモ地方創生リート投資法人	178	17,390,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	515	225,312,500	
大江戸温泉リート投資法人	308	19,003,600	
さくら総合リート投資法人	392	27,518,400	
投資法人みらい	2,059	74,329,900	
森トラスト・ホテルリート投資法人	425	36,932,500	
三菱地所物流リート投資法人	356	129,584,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	340	49,300,000	
ザイマックス・リート投資法人	263	23,012,500	
タカラレーベン不動産投資法人	514	41,634,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	377	47,690,500	
日本ビルファンド投資法人	1,754	1,083,972,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,811	1,017,782,000	
日本リテールファンド投資法人	3,422	445,886,600	
オリックス不動産投資法人	3,608	459,298,400	
日本プライムリアルティ投資法人	1,190	341,173,000	
プレミア投資法人	1,636	173,088,800	
東急リアル・エステート投資法人	1,214	162,311,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,257	108,604,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人	4,066	446,853,400	
森トラスト総合リート投資法人	1,294	154,891,800	

インヴィンシブル投資法人	7,943	176,096,310	
フロンティア不動産投資法人	643	201,902,000	
平和不動産リート投資法人	1,128	107,498,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,183	318,345,300	
福岡リート投資法人	937	106,911,700	
ケネディクス・オフィス投資法人	560	300,160,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,402	93,233,000	
大和証券オフィス投資法人	418	248,292,000	
阪急阪神リート投資法人	818	105,276,600	
スタートアップリート投資法人	282	51,718,800	
大和ハウスリート投資法人	2,584	636,180,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,834	210,024,000	
大和証券リビング投資法人	2,217	199,530,000	
ジャパンエクセレント投資法人	1,675	186,930,000	
合計	106,498	14,535,809,650	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	126,996,965
コール・ローン	10,138,972
投資証券	11,337,025,341
派生商品評価勘定	403
未収入金	29,381,180
未収配当金	24,284,164

2020年 5月15日現在

流動資産合計	11,527,827,025
資産合計	11,527,827,025
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	357,677
未払金	59,889,782
未払解約金	80,000,000
未払利息	27
その他未払費用	62
流動負債合計	140,247,548
負債合計	140,247,548
純資産の部	
元本等	
元本	14,007,821,874
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,620,242,397
元本等合計	11,387,579,477
純資産合計	11,387,579,477
負債純資産合計	11,527,827,025

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日

期首元本額	11,585,825,295円
期中追加設定元本額	16,619,069,959円
期中一部解約元本額	14,197,073,380円
期末元本額	14,007,821,874円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	681,197,269円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	468,664,019円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,452,431,636円
DCりそな グローバルバランス	12,827,838円
つみたてバランスファンド	350,652,611円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	208,796,071円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	98,710,337円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	56,742,437円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,155,987円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,539,062円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,283,745円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,210,271円
リスクコントロール・オープン	2,182,633円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,445,379,791円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,000,541,606円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,041,004,626円
Smart-i 8資産バランス 安定型	21,868,619円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	65,116,128円
Smart-i 8資産バランス 成長型	76,546,170円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	100,003,178円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	90,192,365円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	50,789,787円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	36,663,326円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	182,428,446円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,216,022円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	553,677,894円
2. 計算日における受益権の総数	14,007,821,874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	2,620,242,397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	0.8129円
(10,000口当たり純資産額)	(8,129円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020年 5月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		4,749,001,739
合計		4,749,001,739

(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)

(2020年 5月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	34,552,930	-	34,553,314	384
	米ドル	25,243,535	-	25,243,700	165
	カナダドル	2,983,059	-	2,983,110	51
	ユーロ	2,124,077	-	2,124,264	187
	英ポンド	4,202,259	-	4,202,240	19
	売建	71,804,892	-	72,162,550	357,658
	米ドル	46,385,920	-	46,620,280	234,360
	カナダドル	3,411,855	-	3,442,050	30,195
	ユーロ	6,361,575	-	6,384,400	22,825
	英ポンド	4,707,612	-	4,727,520	19,908
	オーストラリアドル	4,828,600	-	4,860,800	32,200
	香港ドル	2,344,130	-	2,354,500	10,370
	シンガポールドル	3,765,200	-	3,773,000	7,800
合計	106,357,822	-	106,715,864	357,274	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	10,637	113,177.68	
		AGREE REALTY CORP	5,316	311,623.92	
		ALEXANDER'S INC	228	51,826.68	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,778	1,936,222.34	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,332	131,060.56	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	15,509	426,652.59	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	11,624	73,347.44	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	28,706	661,960.36	
		AMERICOLD REALTY TRUST	21,584	721,337.28	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	16,786	563,170.30	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	23,878	196,754.72	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	66,200	24,163.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,694	7,511.05	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,742	2,390,580.12	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	19,083.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	16,154	1,239,011.80	

BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	11,520.70	
BRANDYWINE REALTY TRUST	19,242	170,099.28	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	33,229	316,340.08	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,942	62,686.26	
BRT APARTMENTS CORP	877	7,928.08	
CAMDEN PROPERTY TRUST	10,880	905,433.60	
CARETRUST REIT INC	11,124	182,322.36	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	3,624.95	
CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	11,795.12	
CHATHAM LODGING TRUST	4,881	25,674.06	
CITY OFFICE REIT INC	5,944	49,454.08	
CLIPPER REALTY INC	1,350	7,830.00	
COLONY CAPITAL INC	52,342	87,411.14	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	13,663	160,130.36	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	2,216	76,651.44	
CORECIVIC INC	12,935	129,996.75	
COREPOINT LODGING INC	3,700	12,173.00	
CORESITE REALTY CORP	4,592	552,784.96	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	12,189	269,986.35	
COUSINS PROPERTIES INC	16,724	415,089.68	
CUBESMART	21,876	527,211.60	
CYRUSONE INC	12,786	892,846.38	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	21,047	91,764.92	
DIGITAL REALTY TRUST INC	29,472	3,911,523.84	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	25,929	68,063.62	
DOUGLAS EMMETT INC	18,709	494,104.69	
DUKE REALTY CORP	41,268	1,258,261.32	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	8,349	194,281.23	
EASTGROUP PROPERTIES INC	4,357	432,432.25	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16,942	120,118.78	
EPR PROPERTIES	8,521	211,746.85	
EQUINIX INC	9,904	6,529,311.04	
EQUITY COMMONWEALTH	13,820	441,272.60	

EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	20,434	1,146,960.42	
EQUITY RESIDENTIAL	39,106	2,249,377.12	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	9,514	111,218.66	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,401	1,665,299.01	
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,565	1,226,373.00	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	20,401.34	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,963	557,569.26	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	14,372	489,366.60	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	7,483	138,211.01	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,690	54,475.40	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	5,341	33,381.25	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	23,190	619,636.80	
GEO GROUP INC/THE	13,192	137,328.72	
GETTY REALTY CORP	3,725	86,718.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,578	51,702.10	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	33,703.45	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,153	39,453.50	
GLOBAL NET LEASE INC	9,633	124,651.02	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	15,310	437,712.90	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	23,476	565,067.32	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	55,735	1,238,989.05	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,293	22,124.74	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	11,783	380,590.90	
HOST HOTELS & RESORTS INC	81,180	815,047.20	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	17,778	361,248.96	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	9,916	88,450.72	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,034	111,770.26	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,010	144,478.80	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,268	77,715.72	
INVITATION HOMES INC	60,396	1,450,711.92	
IRON MOUNTAIN INC	32,404	733,626.56	
JBG SMITH PROPERTIES	12,895	361,060.00	
KILROY REALTY CORP	11,006	585,849.38	
KIMCO REALTY CORP	47,623	439,084.06	
KITE REALTY GROUP TRUST	9,153	76,702.14	

LEXINGTON REALTY TRUST	27,742	241,632.82	
LIFE STORAGE INC	5,249	446,479.94	
LTC PROPERTIES INC	4,638	149,297.22	
MACERICH CO/THE	12,011	74,468.20	
MACK-CALI REALTY CORP	9,988	139,232.72	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	167,400	117,180.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	58,338	946,825.74	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,794	1,350,022.88	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	11,590	134,444.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	19,340	540,939.80	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,907	173,020.35	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,860	231,141.60	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	8,195	19,422.15	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,457	69,705.09	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	4,862	106,283.32	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	24,769	646,718.59	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,470	20,315.40	
PARAMOUNT GROUP INC	22,684	170,583.68	
PARK HOTELS & RESORTS INC	26,676	195,268.32	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	15,688	151,546.08	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	8,636.55	
PHYSICIANS REALTY TRUST	21,840	328,692.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	14,437	198,653.12	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	24,192.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4,984	32,196.64	
PRIME US REIT	47,000	32,430.00	
PROLOGIS INC	82,919	6,971,829.52	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,308	258,057.48	
PUBLIC STORAGE	16,848	3,015,792.00	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	6,385	401,999.60	
REALTY INCOME CORP	38,494	1,939,327.72	
REGENCY CENTERS CORP	18,867	688,834.17	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	12,646	109,704.05	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	23,181	103,850.88	
RETAIL VALUE INC	1,615	17,732.70	

REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	13,390	498,777.50	
RLJ LODGING TRUST	18,816	152,033.28	
RPT REALTY	8,748	45,752.04	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	6,423	160,639.23	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	22,608	267,226.56	
SAFEHOLD INC	1,342	62,859.28	
SAUL CENTERS INC	1,280	34,368.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,642	24,729.18	
SERVICE PROPERTIES TRUST	17,556	89,272.26	
SIMON PROPERTY GROUP INC	34,401	1,773,371.55	
SITE CENTERS CORP	16,265	78,397.30	
SL GREEN REALTY CORP	8,856	348,837.84	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	10,939	285,836.07	
STAG INDUSTRIAL INC	16,414	381,297.22	
STORE CAPITAL CORP	24,466	428,155.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	10,940	52,183.80	
SUN COMMUNITIES INC	10,397	1,275,815.87	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	24,618	180,696.12	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	10,120	59,505.60	
TAUBMAN CENTERS INC	6,725	259,652.25	
TERRENO REALTY CORP	7,292	337,838.36	
UDR INC	32,902	1,148,279.80	
UMH PROPERTIES INC	3,956	43,001.72	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,521	124,752.42	
URBAN EDGE PROPERTIES	12,561	105,763.62	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,249	37,525.95	
VENTAS INC	41,926	1,166,800.58	
VEREIT INC	121,172	564,661.52	
VICI PROPERTIES INC	52,116	791,642.04	
VORNADO REALTY TRUST	17,887	626,223.87	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	12,978.56	
WASHINGTON REIT	8,780	167,434.60	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	13,453	207,714.32	
WELLTOWER INC	45,569	1,838,253.46	
WHITESTONE REIT	4,416	22,521.60	

	WP CAREY INC	19,433	1,077,365.52
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	12,048	87,950.40
	米ドル 小計	2,874,037	79,063,216.72 (8,493,761,372)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6,585	267,087.60
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6,997	50,728.25
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,426	58,903.28
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,571	447,157.12
	CHOICE PROPERTIES REIT	16,537	198,774.74
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9,480	71,005.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4,706	55,860.22
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5,459	65,835.54
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	8,023	73,249.99
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,961	55,133.82
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	12,266	151,853.08
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,058	195,283.88
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	15,054	128,561.16
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,427	88,628.33
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,177	85,058.11
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,894	36,535.26
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,047	26,713.35
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,558	121,754.76
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	9,751	88,344.06
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	18,323	256,338.77
	SLATE OFFICE REIT	4,169	14,925.02
	SLATE RETAIL REIT - U	1,920	15,436.80
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,623	146,361.60
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	7,226	68,213.44
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	24,816.00
	カナダドル 小計	176,038	2,792,559.38 (213,630,792)
ユーロ	AEDIFICA	3,049	272,580.60
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	18,380	225,522.60
	ALTAREA	379	43,812.40
	BEFIMMO	2,794	105,613.20

	COFINIMMO	2,686	344,882.40
	COVIVIO	4,836	246,636.00
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	4,371	39,601.26
	GECINA SA	6,217	641,594.40
	HAMBORNER REIT AG	7,579	58,418.93
	HIBERNIA REIT PLC	74,814	74,814.00
	ICADE	3,176	188,972.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	15,942.22
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	27,440	210,464.80
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,408	50,808.80
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	46,661	54,126.76
	KLEPIERRE	23,883	369,589.42
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,811	24,655.82
	MERCIALYS	3,481	21,529.98
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	40,285	283,002.12
	MONTEA	1,341	112,644.00
	NSI NV	1,790	56,922.00
	RETAIL ESTATES	1,189	62,779.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	15,562	690,641.56
	VASTNED RETAIL NV	2,010	31,758.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	14,150	328,987.50
	WERELDHAVE NV	4,269	27,492.36
	ユーロ 小計	324,512	4,583,792.33 (532,086,613)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	12,000.00
	ASSURA PLC	264,097	191,734.42
	BIG YELLOW GROUP PLC	17,521	161,017.99
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	96,000	49,920.00
	BRITISH LAND CO PLC	107,604	355,416.01
	CAPITAL & COUNTIES PROPRTIE	101,200	137,126.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	4,532.22
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	67,652	66,637.22
	DERWENT LONDON PLC	12,046	334,878.80
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	65,239	36,925.27
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	28,198	172,007.80
	HAMMERSON PLC	83,861	36,529.85

	INTU PROPERTIES PLC	117,549	5,141.59
	LAND SECURITIES GROUP PLC	85,600	445,976.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	92,942	172,686.23
	LXI REIT PLC	55,678	52,225.96
	NEWRIVER REIT PLC	33,051	16,558.55
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,400	32,144.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	131,084	197,150.33
	RDI REIT PLC	27,350	12,581.00
	REGIONAL REIT LTD	43,881	32,033.13
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	22,757	142,003.68
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	58,503	17,609.40
	SEGRE PLC	123,916	978,192.90
	SHAFTESBURY PLC	24,122	117,425.89
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	37,939	36,573.19
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	184,777	236,514.56
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	89,710	45,572.68
	UNITE GROUP PLC	41,581	291,274.90
	WORKSPACE GROUP PLC	13,927	88,227.54
	英債券 小計	2,109,805	4,478,617.11 (588,176,785)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	38,307	90,021.45
	APN INDUSTRIA REIT	13,219	27,627.71
	ARENA REIT	32,557	66,416.28
	BWP TRUST	56,781	197,030.07
	CENTURIA OFFICE REIT	40,642	73,968.44
	CHARTER HALL GROUP	51,894	394,913.34
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	45,828	185,145.12
	CHARTER HALL RETAIL REIT	52,891	158,673.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	27,061	58,451.76
	CROMWELL PROPERTY GROUP	205,502	150,016.46
	DEXUS	122,612	1,094,925.16
	GDI PROPERTY GROUP	55,291	56,949.73
	GOODMAN GROUP	180,353	2,551,994.95
	GPT GROUP	218,540	871,974.60
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	29,877	86,344.53

	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,020	36,048.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	26,599	94,426.45
	MIRVAC GROUP	449,419	930,297.33
	NATIONAL STORAGE REIT	117,338	195,954.46
	RURAL FUNDS GROUP	34,950	65,531.25
	SCENTRE GROUP	602,360	1,216,767.20
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	118,742	254,107.88
	STOCKLAND	273,205	740,385.55
	VICINITY CENTRES	360,328	490,046.08
	VIVA ENERGY REIT	78,935	186,286.60
	オーストラリアドル 小計	3,248,251	10,274,303.40 (713,550,371)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	88,533	90,746.32
	GOODMAN PROPERTY TRUST	125,060	278,883.80
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	171,370	150,805.60
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	117,741	186,030.78
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	37,526	89,687.14
	ニュージーランドドル 小計	540,230	796,153.64 (51,391,717)
香港ドル	CHAMPION REIT	219,000	939,510.00
	FORTUNE REIT	167,000	1,222,440.00
	LINK REIT	235,800	15,645,330.00
	PROSPERITY REIT	136,000	323,680.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	109,000	420,740.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	159,000	583,530.00
	香港ドル 小計	1,025,800	19,135,230.00 (265,214,287)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	48,100	56,758.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	105,200	52,600.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	340,300	980,064.00
	ASCOTT TRUST	222,596	185,867.66
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	328,500	492,750.00
	CAPITALAND MALL TRUST	319,500	555,930.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	82,500	105,600.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	85,100	76,164.50
	ESR REIT	222,700	77,945.00

	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	80,200	36,892.00	
	FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	60,600	48,177.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	84,100	166,518.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	81,000	36,450.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	259,779	280,561.32	
	KEPPEL DC REIT	133,800	302,388.00	
	KEPPEL REIT	217,600	216,512.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	25,285.70	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	241,900	433,001.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	171,200	417,728.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	343,300	621,373.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	254,900	201,371.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	269,000	100,875.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	42,700	134,505.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	89,900	28,768.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	59,300	42,696.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	37,837.50	
	SPH REIT	92,200	72,377.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	146,100	65,745.00	
	SUNTEC REIT	261,200	355,232.00	
	シンガポールドル 小計	4,943,275	6,207,971.68 (468,515,622)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	25,092,000.00	
	韓国ウォン 小計	4,100	25,092,000.00 (2,198,059)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	18,865	280,333.90	
	イスラエルシェケル 小計	18,865	280,333.90 (8,499,723)	
	合計		11,337,025,341 (11,337,025,341)	

(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	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 157銘柄	100.0%	74.9%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.7%
英ポンド	投資証券 30銘柄	100.0%	5.2%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.3%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.3%
シンガポールドル	投資証券 29銘柄	100.0%	4.1%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M マネーマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 5月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	35,627,817,972
国債証券	41,921,036,000
流動資産合計	77,548,853,972
資産合計	77,548,853,972
負債の部	
流動負債	
未払利息	96,634
その他未払費用	107,330
流動負債合計	203,964
負債合計	203,964
純資産の部	

2020年 5月15日現在

元本等	
元本	77,659,427,433
剰余金	
剰余金又は欠損金()	110,777,425
元本等合計	77,548,650,008
純資産合計	77,548,650,008
負債純資産合計	77,548,853,972

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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)

2020年 5月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 6月10日
期首元本額	593,600,700円
期中追加設定元本額	108,226,127,249円
期中一部解約元本額	31,160,300,516円
期末元本額	77,659,427,433円
期末元本の内訳	
リスクコントロール・オープン	65,214,780円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	12,820,254,203円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	22,835,268,215円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	12,520,020,022円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	9,515,116,600円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	6,709,722,640円
りそなDAA先物ファンド(適格機関投資家専用)	6,915,182,040円
りそなマネー・プール・ファンド(適格機関投資家専用)	553,926円
DD抑制型フランス国債ファンド(適格機関投資家専用)	5,813,842,459円
りそなDAA先物 ファンド(適格機関投資家専用)	464,252,548円
2. 計算日における受益権の総数	77,659,427,433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	110,777,425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	0.9986円
(10,000口当たり純資産額)	(9,986円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2020年 5月15日現在
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>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。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

金融商品の時価等に関する事項

2020年 5月15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお</p> <p>ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額</p> <p>が異なることもあります。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 5月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 5月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		34,274,700
合計		34,274,700

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

2 デリバティブ取引に関する注記

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864回国庫短期証券	200,000,000	200,135,800	
	第871回国庫短期証券	3,700,000,000	3,703,111,700	
	第893回国庫短期証券	6,500,000,000	6,503,276,000	
	第895回国庫短期証券	8,000,000,000	8,011,152,000	
	第896回国庫短期証券	23,500,000,000	23,503,360,500	
	合計	41,900,000,000	41,921,036,000	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 5月29日現在です。

【りそな・リスクコントロールファンド2019-06】

【純資産額計算書】

資産総額	22,099,312,457円
負債総額	55,852,586円
純資産総額(-)	22,043,459,871円
発行済口数	22,690,271,261口
1口当たり純資産額(/)	0.9715円

(参考)

RAM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	80,771,710,833円
負債総額	1,080,617,242円
純資産総額(-)	79,691,093,591円
発行済口数	75,529,676,001口
1口当たり純資産額(/)	1.0551円

RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

純資産額計算書

資産総額	150,197,755,745円
負債総額	5,733,966,181円
純資産総額(-)	144,463,789,564円
発行済口数	136,430,704,202口
1口当たり純資産額(/)	1.0589円

RAM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	21,021,428,849円
負債総額	509,127,583円
純資産総額（ - ）	20,512,301,266円
発行済口数	18,522,018,678口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1075円

R A M先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	45,576,143,055円
負債総額	4,900,850円
純資産総額（ - ）	45,571,242,205円
発行済口数	36,117,275,961口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2618円

R A M新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	6,801,191,641円
負債総額	39,602,012円
純資産総額（ - ）	6,761,589,629円
発行済口数	6,012,709,931口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1245円

R A M新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	4,307,389,719円
負債総額	30,027,903円
純資産総額（ - ）	4,277,361,816円
発行済口数	4,189,706,295口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0209円

R A M国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	17,139,581,776円
負債総額	385,056,779円
純資産総額（ - ）	16,754,524,997円
発行済口数	14,361,437,323口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1666円

R A M先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	13,810,890,248円
負債総額	172,461,801円
純資産総額（ - ）	13,638,428,447円
発行済口数	14,925,576,312口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9138円

R A Mマネーマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	77,587,845,001円
負債総額	6,765,559,837円
純資産総額（ - ）	70,822,285,164円
発行済口数	70,925,315,238口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9985円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知

するものとしします。

- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(4) 受益証券の再発行

受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとしします。

(5) 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

2020年5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

年月日	変更後（変更前）
2017年7月7日	1,000,000,000円（490,000,000円）

(2) 委託会社の機構（2020年5月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。

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

取締役は株主総会において選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

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

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

投資運用の意思決定機構

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

PLAN：計画

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

DO：実行

- ・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
- ・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
- ・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
- ・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。

CHECK：検証 ACTION：改善

- ・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年5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	77	734,613
単位型株式投資信託	5	122,321
合計	82	856,934

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5期事業年度（自2019年4月1日至2020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 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	1,344,092	2,211,091
前払費用	21,505	186,739
未収入金	238	247
未収委託者報酬	369,524	810,183
未収運用受託報酬	-	1,261,327
未収投資助言報酬	38,188	418,494
流動資産計	1,773,550	4,888,083
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 2,791	4,325
器具備品	1 9,167	11,668
有形固定資産計	11,958	15,993
無形固定資産		
ソフトウェア	29,501	18,733
無形固定資産計	29,501	18,733
投資その他の資産		
投資有価証券	599	7,975
長期前払費用	1,416	416
繰延税金資産	34,080	72,304

投資その他の資産計	36,097	80,969
固定資産計	77,557	115,424
資産合計	1,851,107	5,003,507

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	87,317	311,378
その他未払金	2 163,133	760,759
未払費用	23,612	85,094
未払法人税等	17,310	192,367
未払消費税等	39,930	287,966
預り金	444	1,648
賞与引当金	36,596	96,675
流動負債計	368,344	1,735,890
負債合計	368,344	1,735,890
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	7,236	1,778,051
利益剰余金計	7,236	1,778,051
株主資本計	1,482,763	3,268,051
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	433
評価・換算差額等計	0	433
純資産合計	1,482,762	3,267,617
負債・純資産合計	1,851,107	5,003,507

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,786,724	3,170,025
運用受託報酬	-	1,201,400
投資助言報酬	35,360	1,166,500
営業収益計	1,822,084	5,537,925
営業費用		
支払手数料	437,713	1,050,201
広告宣伝費	48,845	63,238
調査費		

調査費	192,459	500,578
委託調査費	199,514	128,044
委託計算費	149,138	188,413
営業雑経費		
印刷費	49,857	68,686
協会費	3,294	5,690
販売促進費	5,915	5,255
その他	42,522	55,169
営業費用計	1,129,261	2,065,279
一般管理費		
給料		
役員報酬	65,787	82,651
給料・手当	216,403	490,014
賞与	18,883	3,982
賞与引当金繰入額	36,596	132,198
旅費交通費	8,181	13,634
租税公課	14,129	48,964
不動産賃借料	23,852	48,771
固定資産減価償却費	15,147	16,096
諸経費	72,402	119,502
一般管理費計	471,383	955,815
営業利益	221,439	2,516,831
営業外収益		
受取配当金	-	23
投資有価証券売却益	176	73
雑収入	2	46
営業外収益計	179	142
営業外費用		
雑損失	-	13
営業外費用計	-	13
経常利益	221,618	2,516,960
税引前当期純利益	221,618	2,516,960
法人税、住民税及び事業税	1	49,931
法人税等調整額	7,606	38,032
法人税等計	57,538	731,672
当期純利益	164,079	1,785,287

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683
当期変動額						
当期純利益				164,079	164,079	164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	164,079	164,079	164,079
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763

	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	11	11	1,318,695
当期変動額			
当期純利益			164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	11	11	11
当期変動額合計	11	11	164,067
当期末残高	0	0	1,482,762

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763
当期変動額						
当期純利益				1,785,287	1,785,287	1,785,287
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	1,785,287	1,785,287	1,785,287
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051

	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	0	0	1,482,762
当期変動額			
当期純利益			1,785,287
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	433	433	433
当期変動額合計	433	433	1,784,854
当期末残高	433	433	3,267,617

（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

 時価のあるもの

 決算日の市場価格等に基づく時価法（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 8～15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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

当社は、株式会社りそなホールディングスを連結納税親会社とする連結納税主体の連結納税子会社として、連結納税制度を適用しております。

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（2020年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し、認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	540千円	885千円
器具備品	6,957千円	11,323千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
流動負債		
その他未払金	44,766千円	616,704千円

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する主な取引

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
法人税、住民税及び事業税	44,766千円	616,720千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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。

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	1,344,092	1,344,092	-

未収委託者報酬	369,524	369,524	-
未収投資助言報酬	38,188	38,188	-
資産計	1,751,805	1,751,805	-
未払手数料	87,317	87,317	-
その他未払金	163,133	163,133	-
負債計	250,451	250,451	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	2,211,091	2,211,091	-
未収委託者報酬	810,183	810,183	-
未収運用受託報酬	1,261,327	1,261,327	-
未収投資助言報酬	418,494	418,494	-
資産計	4,701,096	4,701,096	-
未払手数料	311,378	311,378	-
その他未払金	760,759	760,759	-
負債計	1,072,138	1,072,138	-

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

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

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

負債

未払手数料、その他未払金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	11,202千円	29,592千円
未払事業所税	341千円	655千円
未払事業税	3,323千円	33,577千円
未確定債務	913千円	757千円
減価償却超過額	5,341千円	3,944千円
税務上の繰越欠損金(*1)	54,381千円	3,586千円
その他有価証券評価差額金	0千円	191千円
その他	1,399千円	-
繰延税金資産小計	76,903千円	72,304千円
税務上の繰越欠損金に係る評価性引当額(*1)	37,635千円	-
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	5,186千円	-
評価性引当額小計	42,822千円	-
繰延税金資産合計	34,080千円	72,304千円
繰延税金資産の純額	34,080千円	72,304千円

(*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2019年3月31日)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超	合計
税務上の 繰越欠損金	-	-	-	-	-	54,381千円	54,381千円
評価性引当額	-	-	-	-	-	37,635千円	37,635千円
繰延税金資産	-	-	-	-	-	16,746千円	16,746千円

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2020年3月31日)

	1年以内	1年超 2年以内	2年超 3年以内	3年超 4年以内	4年超 5年以内	5年超	合計
税務上の 繰越欠損金	-	-	-	-	-	3,586千円	3,586千円
評価性引当額	-	-	-	-	-	-	-
繰延税金資産	-	-	-	-	-	3,586千円	3,586千円

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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 2018年4月1日 至 2019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	0.43%
評価性引当額の増減	3.23%
その他	1.89%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>25.96%</u>

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	0.01%
住民税均等割	0.09%
その他	1.64%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.07%</u>

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1) 取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：株式会社りそな銀行の資産運用事業に関して有する権利義務の一部

事業の内容：法人・機関投資家向け資産運用サービスの提供

企業結合日

2020年1月1日

企業結合の法的形式

株式会社りそな銀行(当社の親会社の連結子会社)を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後の名称

りそなアセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

法人・機関投資家向けとリテール向けで分かれていた運用機能集約による運用サービスの向上を図ることを目的とし、法人・機関投資家向けに高品質の運用サービスを提供する株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を分割し、バランスファンド・ファンドラップ専用投資信託・インデックスファンド等を中心に、リテール向けに業容拡大を図ってきた当社へ、発展的に統合するものであります。

(2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

(セグメント情報等)

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

内国籍投資信託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。

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

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がないため、記載を省略しております。

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

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 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社りそなホールディングス	東京都江東区	50,472	持株会社としての経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税に係る個別帰属額(注1)	44,766	その他未払金	44,766

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（2）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社の子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	-	投資信託の販売委託投資助言投資一任	支払手数料(注3)	340,304	未払手数料	72,673
							委託調査費(注1)(注2)	130,062	その他未払金	51,486

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の費用については、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) 投資一任の費用については、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 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	--------	-----	-----------------------	-----------	----------------------------	---------------	-------	--------------	----	--------------

親会社	株式会社 りそなホールディングス	東京都 江東区	50,472	持株会社 としての 経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税 に係る 個別帰属額 (注1)	616,720	その他 未払金	616,704
-----	---------------------	------------	--------	----------------------	--------------	------	------------------------------	---------	------------	---------

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社 の 子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託 報酬(注2) 投資助言 報酬(注1) 支払手数料 (注3)	1,159,040 1,059,624 706,067	未収運用 受託報酬 未収投資 助言報酬 未払 手数料	1,224,680 350,629 203,372

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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2) 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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	374円43銭	825円15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()	41円43銭	450円83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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益又は当期純損失()(千円)	164,079	1,785,287
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)	164,079	1,785,287
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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
2020年1月1日付で株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を承継する吸収分割を行いました。
- (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 (2020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（2020年7月27日現在）
 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 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	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。

(3) 保証会社

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(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いません。

(3) 保証会社

基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。

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。

(3) 保証会社

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
2020年 3月 9日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2020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	山田	信之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	畑中	建二	印

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第5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2020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。

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、継続企業的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、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

利害関係

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

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. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2020年7月7日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそな・リスクコントロールファンド2019-06の2019年6月10日から2020年5月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・リスクコントロールファンド2019-06の2020年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

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、継続企業的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、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に

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

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。