【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10月27日提出
【計算期間】	第3期(自 2019年7月26日至 2020年7月27日)
【ファンド名】	つみたてバランスファンド
【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】

① ファンドの目的

信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	
		債券	インデックス型
	海外	不動産投信	
追加型投信		その他資産（　　）	特殊型
	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	対象インデックス
株式	年１回	グローバル（含む日本）			
一般					
大型株	年２回	日本			
中小型株					日経225
	年４回	北米	ファミリーファンド	あり	
債券					
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			ＴＯＰＩＸ
クレジット属性（　　）					
		オセアニア			
	日々				
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
	その他（　）	アフリカ			その他（合成ベンチマーク）
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）（資産配分固定型）））		中近東（中東）			
		エマージング			
資産複合（　　）					
資産配分固定型					
資産配分変更型					

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産(投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）（資産配分固定型））)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ないファンドをいう。
(2)追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行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
①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

①資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2. 決算頻度による属性区分

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

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

③年4回：目論見書又は投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

④年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいう。

⑤年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

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

⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

①グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

②日本：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

③北米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

④欧州：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑤アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑥オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑦中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑧アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑨中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑩エマージング：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 投資形態による属性区分

①ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資され

るものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
②ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

5. 為替ヘッジによる属性区分
①為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
①日経225
②TOPIX
③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型
①ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
②条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
③ロング・ショート型／絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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

③ ファンドの特色

1 国内、先進国および新興国の株式・債券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）を実質的な主要投資対象とし、以下の指数を「基本的資産配分」で組み合わせた合成ベンチマーク*1に連動する投資成果を目指します。

● 合成ベンチマークへの連動性を高めるため、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ETF（上場投資信託証券）を活用することがあります。

実質的な投資対象	合成ベンチマークを構成する指数*2	基本的資産配分
国内株式	東証株価指数（TOPIX、配当込み）	30%
先進国株式	MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）	20%
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）	5%
国内債券	NOMURA-BPI総合	20%
先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	5%
新興国債券	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）	5%
国内リート	東証REIT指数（配当込み）	10%
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）	5%

*1 合成ベンチマークは、合成ベンチマークを構成する指数および基本的資産配分をもとに委託会社が計算したものです。
*2 合成ベンチマークを構成する指数については、「合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について」をご参照ください。

2 以下のマザーファンドを通じて、国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券への投資を行います。

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

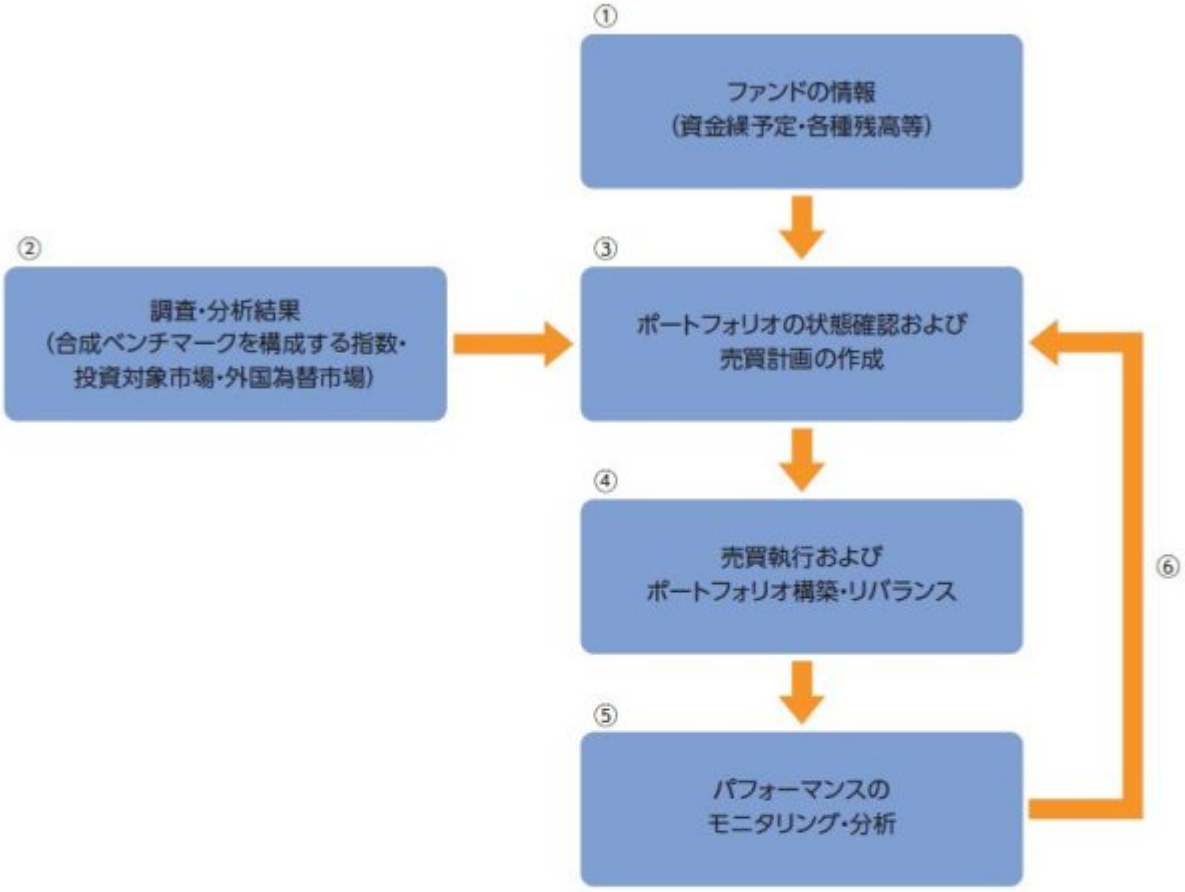
実質的な投資対象	投資対象地域	国内	先進国	新興国
	株式	**RAM国内株式マザーファンド** 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 東証株価指数(TOPIX、配当込み)	**RAM先進国株式マザーファンド** 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)	**RAM新興国株式マザーファンド** 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	債券	**RAM国内債券マザーファンド** 【主要投資対象】 国内の債券 【対象指数】 NOMURA-BPI総合	**RAM先進国債券マザーファンド** 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	**RAM新興国債券マザーファンド** 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
	リート	**RAM国内リートマザーファンド** 【主要投資対象】 不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	**RAM先進国リートマザーファンド** 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資信託証券、不動産関連株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	—

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

4 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

● 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

運用プロセスのイメージ



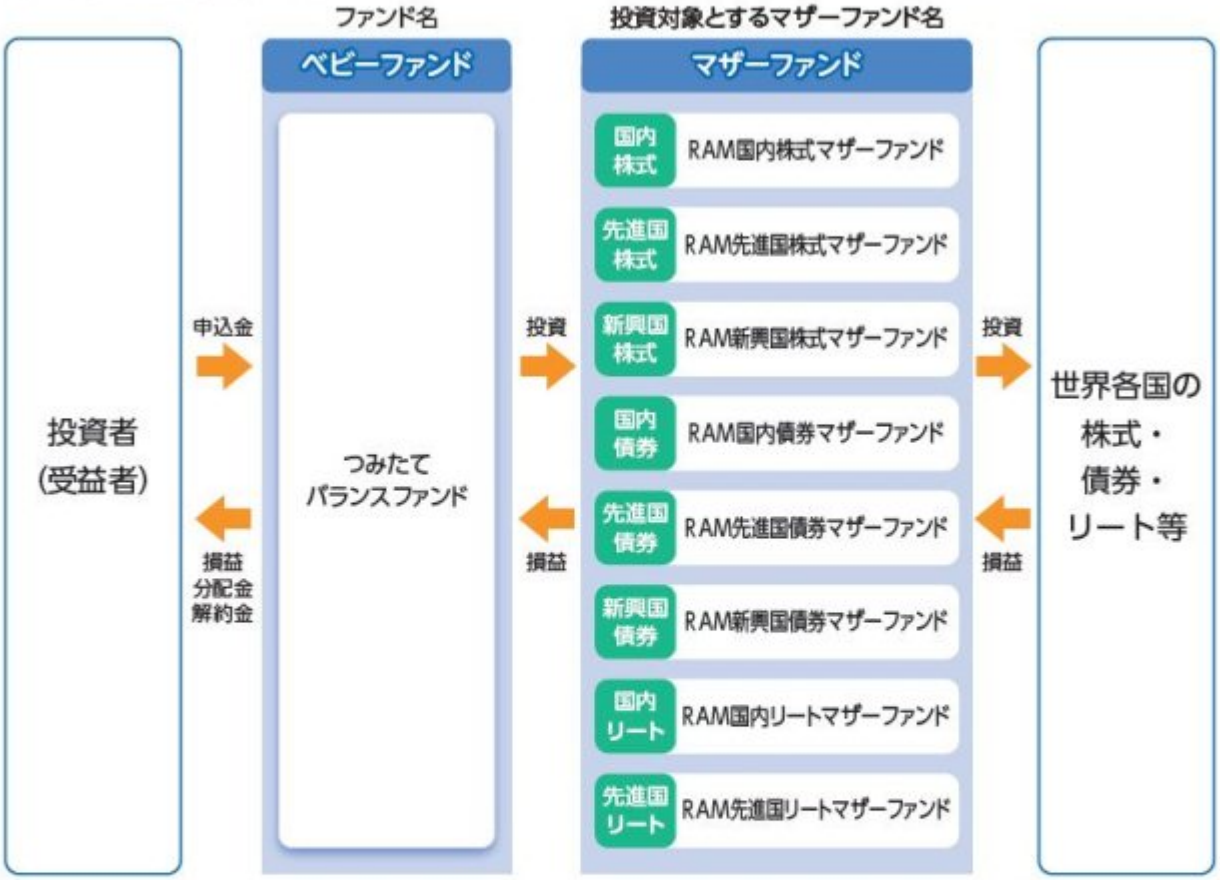
①設定・解約による資金繰予定のほか、各マザーファンド・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
②合成ベンチマークを構成する指数、投資対象となる市場および外国為替市場に関する調査・分析を行います。
③各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じてマザーファンドの売買計画を作成します。
④売買執行（マザーファンドの売買）により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
⑤運用パフォーマンスや合成ベンチマークとの連動性について、モニタリング・分析を行います。
⑥上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年7月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
③留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について

- 「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。
- 「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。
- 「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。
- 「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。
- 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)」は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(J.P. Morgan Securities LLC)が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。
- 「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。
- 「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。

④　信託金限度額

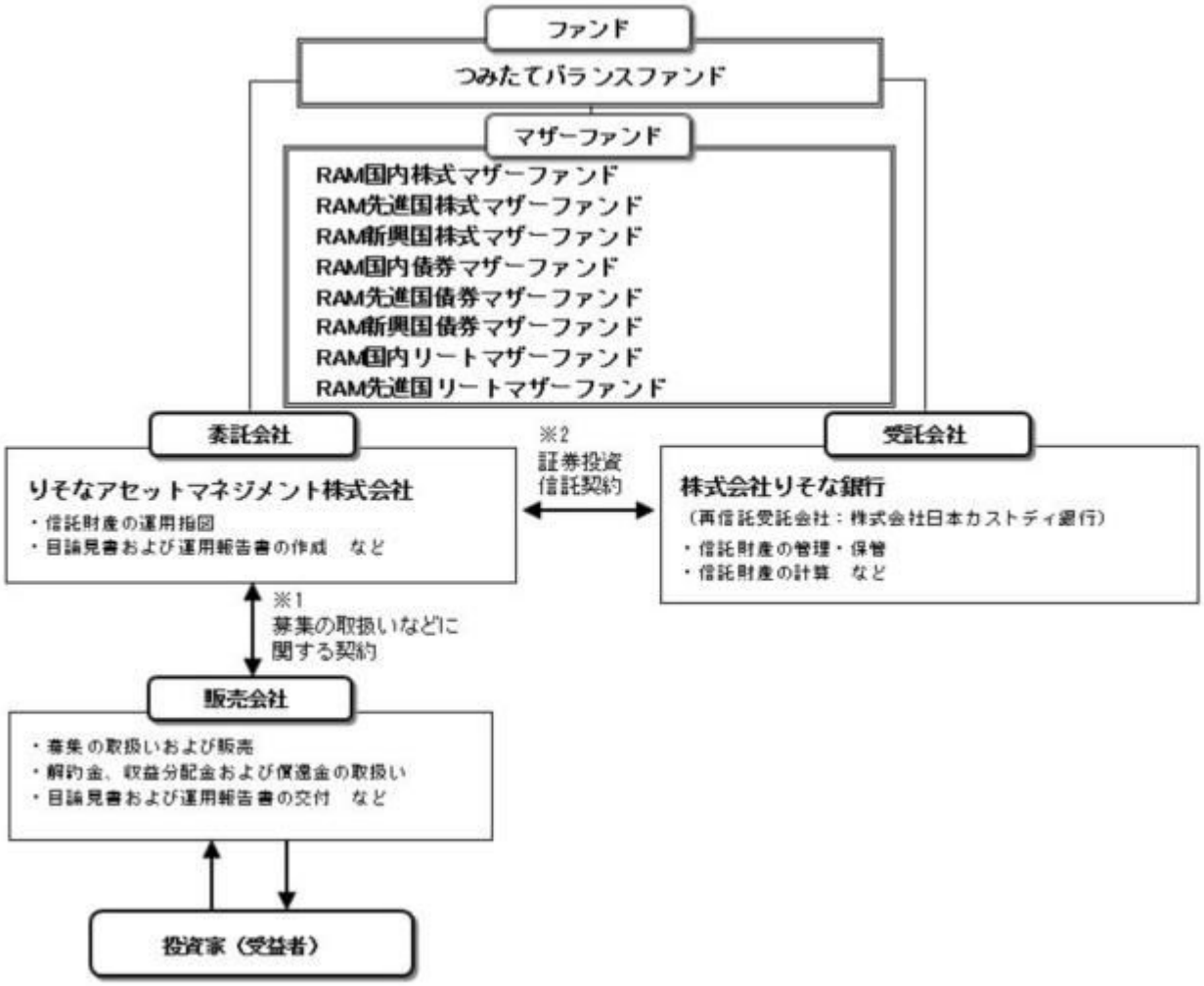
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（2）【ファンドの沿革】

2017年10月26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】

①　ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況（2020年7月末現在）

１）資本金

1,000百万円

２）沿革

2015年8月3日：　りそなアセットマネジメント株式会社設立

2020年1月1日：　株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継

３）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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国内債券マザーファンド、ＲＡＭ先進国債券マザーファンド、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およびＲＡＭ先進国リートマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします。

① 主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

② 以下の指数を「基本的資産配分」で組合わせたものを合成ベンチマークとし、当該合成ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

実質的な投資対象	指数名称	基本的資産配分
国内株式	東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）	30%
先進国株式	ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）	20%
新興国株式	ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）	5%
国内債券	ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合	20%
先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	5%
新興国債券	ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）	5%
国内リート	東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）	10%
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）	5%

③ 合成ベンチマークへの連動性を高めるため、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ＥＴＦ（上場投資信託証券）を活用することがあります。

④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

⑤ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

※指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、前述の「運用プロセスのイメージ」をご参照ください。

（２）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ）有価証券

ロ）デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）

ハ）約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ）金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

２）次に掲げる特定資産以外の資産

イ）為替手形

② 有価証券の指図範囲

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

１）株券または新株引受権証書

２）国債証券

３）地方債証券

４）特別の法律により法人の発行する債券

５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

６）特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

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

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

③　金融商品の指図範囲

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

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

上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、③に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

④　その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

＜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	①　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。 ②　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、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行いません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜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－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）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	①　主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社

受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＡＭ新興国株式マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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

＜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－ＢＰＩ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－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券
投資方針	①　主として、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ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－ＢＰＩ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。 ②　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資は、行いません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年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＞

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、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	① 主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 ② 債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③ 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。

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

＜ＲＡＭ新興国債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＡＭ国内リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）

投資方針	①　主として、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行いません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＡＭ先進国リートマザーファンド＞

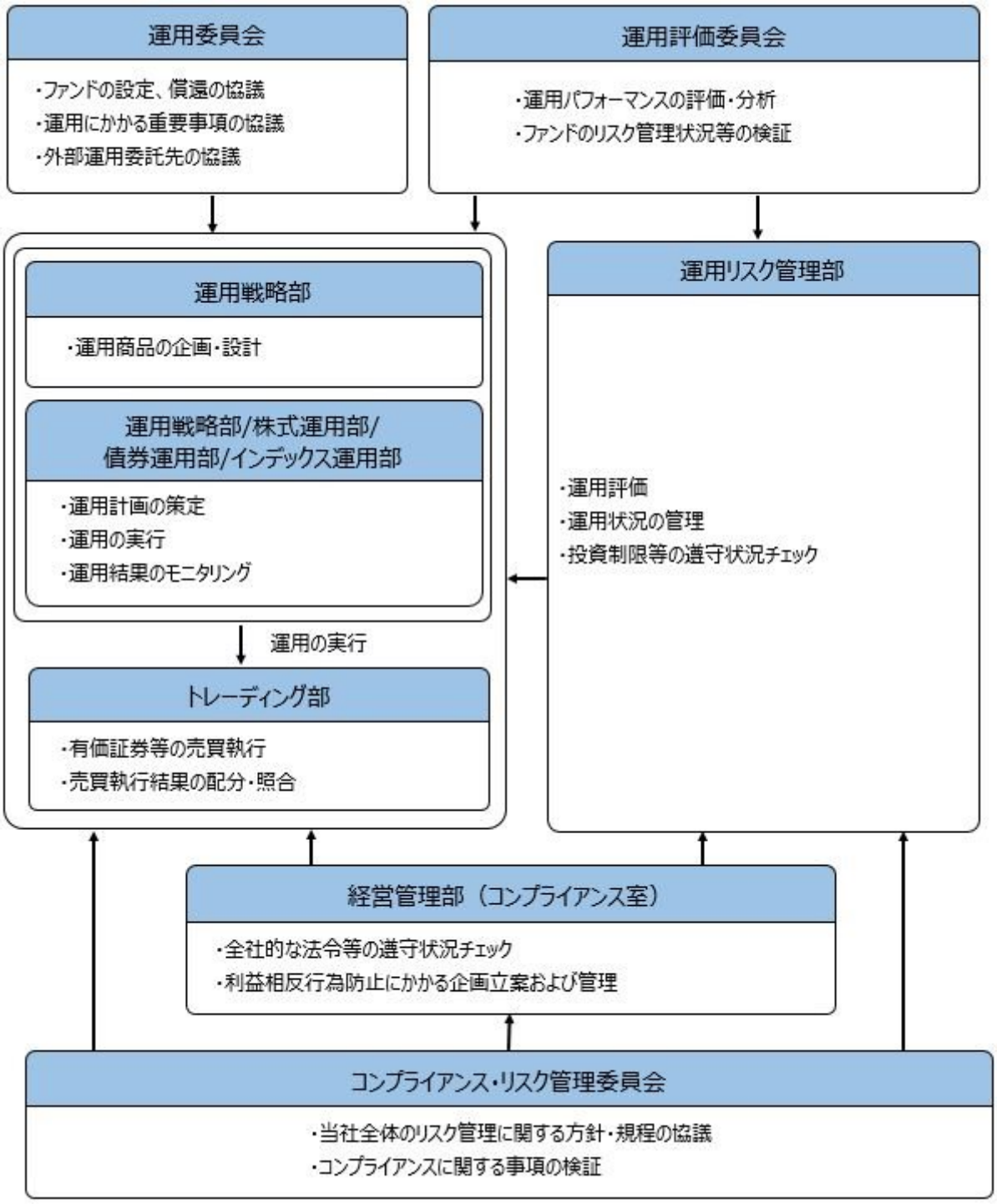
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

①　ファンドの運用体制は以下のとおりです。



※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。

②　りそなアセットマネジメント株式会社の運用体制に関する社内規則等は次の通りです。
委託会社では、運用に関する社内規程およびリスク管理規程を定め、適切な運用を行うと共に運用リスクの管理を行っています。

③　ファンドの関係法人に対する管理体制

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

※上記の運用体制は、2020年7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（4）【分配方針】

① 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

1）分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

2）原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

3）留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

※委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

② 収益分配金の支払い

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

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

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

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

（5）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

1）株式への実質投資割合には、制限を設けません。

2）新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

3）投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

4）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

5）デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

6）一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

7）一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

8）投資する株式等の範囲

1．委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

2．前記１．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

9）信用取引の指図範囲

1．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

2．前記１．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うこと

ができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

ヘ）信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（ホ）に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

10）先物取引等の運用指図および範囲

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16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

2．委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・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16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・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16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受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。

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13）直物為替先渡取引の運用指図

1．委託者は、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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

14）有価証券の貸付けの指図および範囲

1．委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

イ）株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ロ）公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ハ）投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

2．前記１．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に

相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3．委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15）特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

16）外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

17）資金の借入れ

1．委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

3．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

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

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

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

③ 信用リスク
実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合またはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。

④ 流動性リスク
時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。

⑤ カントリーリスク
投資対象国・地域（特に新興国）において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

①当ファンドは合成ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は合成ベンチマークの動きから乖離する場合があります。
・組入資産の時価変動等の理由により、基本的資産配分から実際の資産配分比率が乖離する場合があること。
・合成ベンチマークを構成する指数の全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、構成銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。
・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。
・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。
・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

②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。

③当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

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

⑤ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

（２）リスク管理体制

○委託会社における投資リスクに対する管理体制

①運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。

②運用評価委員会は、運用実績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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
*年間騰落率は、2015年8月から2020年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2018年9月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	18.1	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△10.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.9	4.4	6.5	2.8	1.7	0.7	0.2

*全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
*2015年8月から2020年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
*決算日に対応した数値とは異なります。
*当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

東証株価指数(TOPIX、配当込み)は、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、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、FTSE世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.2145%（税抜0.195%）の率を乗じて得た額とします。
※ただし、ＲＡＭ新興国債券マザーファンドがＥＴＦ（上場投資信託証券）を保有した場合に受益者が負担する実質的な信託報酬率の合計値は0.217%（年率、税抜）程度
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.075%	0.100%	0.020%

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合は翌営業日）、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）
③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から都度支払われます。
④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。
⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。
※これらのその他の手数料等は、信託財産の運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額またはその計算方法の概要等を記載することができません。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

① 個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

２）解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）*については譲渡所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座（源泉徴収選択口座）を選択している場合は、20.315%（所得税15.315%および地方税５%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合、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。

※非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度（つみたてNISA）をご利用の場合、毎年、年間40万円の範囲で販売会社との契約に基づいて定期的かつ継続的な方法で購入することにより生じる配当所得および譲渡所得が20年間非課税となります。なお、「NISA」と「つみたてNISA」の投資枠は、年ごとに選択制であり、同一年において両方の適用を受けることはできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

② 法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

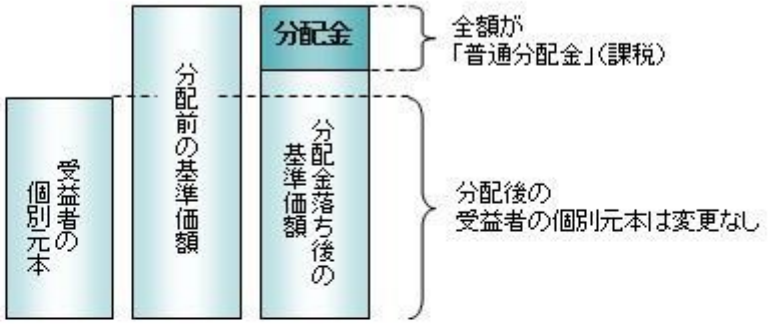
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

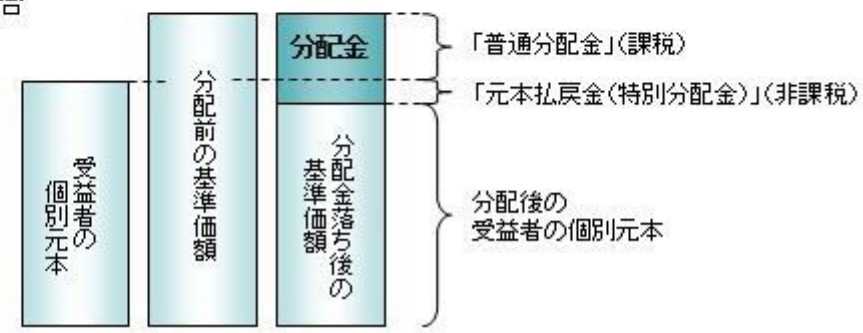
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



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

※上記は2020年7月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【つみたてバランスファンド】

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

（１）【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	7,598,016,807	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	22,194,653	0.29
合計（純資産総額）		7,620,211,460	100.00

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	2,080,350,763	1.1184	2,326,664,293	1.0612	2,207,668,229	28.97
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	1,474,116,724	1.0522	1,551,065,616	1.0543	1,554,161,262	20.40
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	1,144,518,133	1.3317	1,524,154,797	1.3276	1,519,462,273	19.94
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	676,734,334	1.1562	782,440,236	1.1500	778,244,484	10.21
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	412,484,360	0.9146	377,258,195	0.9406	387,982,789	5.09
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	299,837,531	1.2839	384,961,406	1.2933	387,779,878	5.09
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	361,996,029	1.0588	383,281,395	1.0597	383,607,191	5.03
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	368,283,176	1.0407	383,272,301	1.0294	379,110,701	4.98

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.71
合　　計	99.71

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2018年 7月25日)	556	556	1.0211	1.0211
第2計算期間末　(2019年 7月25日)	3,291	3,291	1.0322	1.0322
第3計算期間末　(2020年 7月27日)	7,744	7,744	1.0317	1.0317
2019年 7月末日	3,280	—	1.0298	—
8月末日	3,507	—	1.0079	—

9月末日	3,937	—	1.0403	—
10月末日	4,399	—	1.0738	—
11月末日	4,801	—	1.0860	—
12月末日	5,237	—	1.0986	—
2020年 1月末日	5,562	—	1.0947	—
2月末日	5,578	—	1.0302	—
3月末日	5,426	—	0.9327	—
4月末日	6,062	—	0.9706	—
5月末日	6,742	—	1.0100	—
6月末日	7,197	—	1.0164	—
7月末日	7,620	—	1.0163	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	0.0000
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.0000
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	2.11
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1.09
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	△0.05

(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	2017年10月26日～2018年 7月25日	548,362,039	3,063,179
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,744,605,538	101,031,481
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	4,603,201,837	284,995,956

(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）

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	26,039,422,040	98.66
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	353,633,617	1.34
合計（純資産総額）		26,393,055,657	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	433,985,000	1.64

(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	138,600	7,233.55	1,002,570,457	6,217.00	861,676,200	3.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	96,700	4,918.80	475,648,444	6,595.00	637,736,500	2.42
日本	株式	ソニー	電気機器	77,800	7,537.90	586,449,202	8,076.00	628,312,800	2.38
日本	株式	キーエンス	電気機器	11,300	39,968.41	451,643,061	44,220.00	499,686,000	1.89
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	163,000	2,657.26	433,133,463	2,443.50	398,290,500	1.51
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	103,400	4,031.20	416,826,219	3,756.00	388,370,400	1.47
日本	株式	任天堂	その他製品	7,600	43,551.66	330,992,668	46,440.00	352,944,000	1.34
日本	株式	第一三共	医薬品	35,600	7,764.41	276,413,126	9,258.00	329,584,800	1.25
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	838,200	499.00	418,266,034	393.20	329,580,240	1.25
日本	株式	ダイキン工業	機械	15,800	15,923.85	251,596,959	18,450.00	291,510,000	1.10
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	88,900	3,242.48	288,256,631	3,259.00	289,725,100	1.10
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	85,000	3,943.70	335,214,845	3,268.00	277,780,000	1.05
日本	株式	信越化学工業	化学	20,900	12,263.44	256,306,045	12,275.00	256,547,500	0.97
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	24,600	10,573.63	260,111,392	10,420.00	256,332,000	0.97
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	87,200	3,067.92	267,522,864	2,907.50	253,534,000	0.96
日本	株式	日本電産	電気機器	29,900	7,005.58	209,466,842	8,375.00	250,412,500	0.95
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	97,800	2,784.43	272,317,590	2,524.00	246,847,200	0.94
日本	株式	村田製作所	電気機器	36,500	6,346.15	231,634,535	6,609.00	241,228,500	0.91

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	84,700	3,437.21	291,131,917	2,800.00	237,160,000	0.90
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	7,900	24,870.81	196,479,453	28,800.00	227,520,000	0.86
日本	株式	花王	化学	29,700	8,798.57	261,317,597	7,636.00	226,789,200	0.86
日本	株式	ＳＭＣ	機械	3,900	50,417.11	196,626,747	55,070.00	214,773,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,665,000	146.38	243,737,791	127.60	212,454,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	11,700	19,151.45	224,071,988	17,705.00	207,148,500	0.78
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	85,600	2,453.39	210,011,007	2,300.00	196,880,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	43,300	5,419.00	234,643,044	4,436.00	192,078,800	0.73
日本	株式	日立製作所	電気機器	59,700	3,901.77	232,935,707	3,128.00	186,741,600	0.71
日本	株式	中外製薬	医薬品	38,900	4,191.55	163,051,627	4,736.00	184,230,400	0.70
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	107,700	1,814.24	195,394,637	1,650.00	177,705,000	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	124,200	1,464.65	181,909,959	1,370.50	170,216,100	0.64

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	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.45
		食料品	3.82
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.22
		化学	7.15
		医薬品	6.76
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.54
		ガラス・土石製品	0.73
		鉄鋼	0.53
		非鉄金属	0.69
		金属製品	0.53
		機械	5.31
		電気機器	15.57
		輸送用機器	6.92
		精密機器	2.62
		その他製品	2.48
		電気・ガス業	1.45
		陸運業	3.49
		海運業	0.13
		空運業	0.31
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	10.67
		卸売業	4.44
		小売業	4.99

		銀行業	4.76
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	1.83
		その他金融業	1.07
		不動産業	1.86
		サービス業	5.20
合　　計			98.66

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	29	日本円	468,875,950	433,985,000	1.64

(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先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	29,962,537,070	47.04
	カナダ	1,576,066,726	2.47
	パナマ	5,555,867	0.01
	ドイツ	1,419,896,195	2.23
	イタリア	285,233,257	0.45
	フランス	1,547,023,332	2.43
	オランダ	862,025,860	1.35
	スペイン	356,692,833	0.56
	ベルギー	148,224,414	0.23
	オーストリア	27,684,358	0.04
	ルクセンブルク	31,624,204	0.05
	フィンランド	180,341,186	0.28
	アイルランド	807,170,149	1.27
	ポルトガル	25,063,934	0.04
	イギリス	1,994,842,532	3.13
	スイス	1,701,559,297	2.67

	スウェーデン	463,398,211	0.73
	ノルウェー	79,528,705	0.12
	デンマーク	377,549,926	0.59
	ケイマン	89,685,122	0.14
	リベリア	8,249,844	0.01
	オーストラリア	978,893,801	1.54
	バミューダ	135,123,721	0.21
	ニュージーランド	50,293,857	0.08
	パプアニューギニア	3,346,431	0.01
	香港	361,181,354	0.57
	シンガポール	136,557,002	0.21
	イスラエル	97,078,567	0.15
	キュラソー	29,080,879	0.05
	ジャージー	143,619,920	0.23
	マン島	6,513,153	0.01
	小計	43,891,641,707	68.91
新株予約権証券	アメリカ	573,312	0.00
投資証券	アメリカ	956,908,306	1.50
	カナダ	7,522,867	0.01
	フランス	20,825,583	0.03
	イギリス	26,006,924	0.04
	オーストラリア	62,183,049	0.10
	香港	20,025,630	0.03
	シンガポール	27,811,672	0.04
	小計	1,121,284,031	1.76
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	18,680,558,247	29.33
合計（純資産総額）		63,694,057,297	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	14,765,373,656	23.18
	買建	ドイツ	3,969,470,091	6.23

(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	—	149,495,010	0.23

(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	46,585	34,613.42	1,612,466,439	40,245.89	1,874,855,065	2.94
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	76,921	18,471.75	1,420,865,533	21,327.94	1,640,566,473	2.58
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	4,506	227,189.28	1,023,714,940	319,226.64	1,438,435,276	2.26
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	25,641	23,419.71	600,504,913	24,528.70	628,940,397	0.99
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	3,272	153,613.35	502,622,906	160,189.66	524,140,600	0.82
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,198	153,765.41	491,741,792	160,913.50	514,601,379	0.81
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	28,077	15,414.33	432,788,325	15,359.46	431,247,671	0.68
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	31,738	12,405.37	393,721,666	12,655.08	401,647,234	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	18,183	21,123.86	384,095,151	20,298.67	369,090,826	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	26,285	12,942.42	340,191,540	13,746.53	361,327,594	0.57
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	32,764	12,724.18	416,895,308	10,148.29	332,498,639	0.52
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	11,640	24,823.47	288,945,302	27,856.02	324,244,143	0.51
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	10,112	30,887.98	312,339,339	31,927.05	322,846,410	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	9,541	33,100.80	315,814,761	32,321.39	308,378,477	0.48
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	14,800	22,128.66	327,504,168	20,323.78	300,791,944	0.47
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,520	31,108.76	202,829,131	44,408.97	289,546,524	0.45
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	7,497	37,508.83	281,203,716	37,008.53	277,453,013	0.44
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	44,223	6,168.32	272,782,015	5,993.57	265,054,088	0.42
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,574	80,935.41	127,392,340	155,591.45	244,900,949	0.38
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	11,889	14,041.74	166,942,281	20,136.54	239,403,395	0.38
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	59,057	4,019.24	237,364,611	4,052.20	239,311,012	0.38
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	4,689	40,907.64	191,815,969	50,814.68	238,270,035	0.37
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	76,714	3,778.11	289,834,694	3,093.02	237,278,090	0.37

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	5,143	39,386.76	202,566,120	45,906.84	236,098,919	0.37
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	19,296	13,880.14	267,831,338	12,098.03	233,443,703	0.37
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	45,561	6,898.23	314,290,655	5,019.75	228,705,012	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	27,061	8,764.66	237,180,669	8,262.35	223,587,562	0.35
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	48,588	4,494.61	218,384,519	4,567.88	221,944,251	0.35
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	45,313	5,033.92	228,102,369	4,857.62	220,113,516	0.35
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	83,806	3,237.04	271,283,795	2,598.26	217,750,113	0.34

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	2.25
		素材	3.15
		資本財	4.32
		商業・専門サービス	0.87
		運輸	1.36
		自動車・自動車部品	0.93
		耐久消費財・アパレル	1.22
		消費者サービス	1.02
		メディア・娯楽	4.69
		小売	4.40
		食品・生活必需品小売り	1.09
		食品・飲料・タバコ	3.29
		家庭用品・パーソナル用品	1.59
		ヘルスケア機器・サービス	3.89
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.24
		銀行	3.73
		各種金融	3.00
		保険	2.22
		不動産	0.30
		ソフトウェア・サービス	8.59
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.03
		電気通信サービス	1.49
		公益事業	2.50
		半導体・半導体製造装置	2.74
新株予約権証券	—	—	0.00
投資証券	—	—	1.76

合　　計	70.67

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（各通貨）	契約額等（円）	評価額（各通貨）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2009	買建	869	米ドル	135,312,305	14,153,667,105	141,160,360	14,765,373,656	23.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002009	買建	1,786	ユーロ	32,033,262	3,976,288,812	31,978,330	3,969,470,091	6.23

(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	485,000.00	50,963,509	50,726,150	0.08
	カナダドル	買建	243,000.00	19,139,409	18,922,410	0.03
	英ポンド	買建	204,000.00	27,835,208	27,988,800	0.04
	スイスフラン	買建	186,000.00	21,414,886	21,414,180	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	544,000.00	6,548,780	6,549,760	0.01
	デンマーククローネ	買建	305,000.00	5,072,302	5,084,350	0.01
	オーストラリアドル	買建	110,000.00	8,301,700	8,289,600	0.01
	香港ドル	買建	384,000.00	5,206,694	5,180,160	0.01
	シンガポールドル	買建	70,000.00	5,353,180	5,339,600	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。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	アメリカ	22,974,768	0.25
	アルゼンチン	2,096,153	0.02
	メキシコ	107,052,466	1.15
	ブラジル	370,265,288	3.97
	チリ	38,924,361	0.42
	コロンビア	12,448,887	0.13

	ペルー	2,673,649	0.03
	オランダ	5,775,125	0.06
	ルクセンブルク	9,430,465	0.10
	ギリシャ	8,679,102	0.09
	トルコ	25,492,575	0.27
	チェコ	6,041,444	0.06
	ハンガリー	14,151,417	0.15
	ポーランド	46,322,122	0.50
	ロシア	189,373,911	2.03
	ケイマン	1,703,520,548	18.25
	バミューダ	57,437,560	0.62
	香港	162,280,800	1.74
	シンガポール	1,366,200	0.01
	マレーシア	117,188,356	1.26
	タイ	132,185,912	1.42
	フィリピン	49,789,631	0.53
	インドネシア	93,318,829	1.00
	韓国	767,127,389	8.22
	台湾	846,746,100	9.07
	中国	793,478,860	8.50
	インド	542,451,861	5.81
	カタール	51,127,688	0.55
	エジプト	6,328,472	0.07
	南アフリカ	241,317,231	2.59
	アラブ首長国連邦	31,627,387	0.34
	マン島	2,373,525	0.03
	サウジアラビア	165,175,763	1.77
	小計	6,626,543,845	70.99
投資証券	メキシコ	2,886,394	0.03
	南アフリカ	2,728,931	0.03
	小計	5,615,325	0.06
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	2,702,437,731	28.95
合計（純資産総額）		9,334,596,901	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	2,703,700,800	28.96

(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	—	15,485,598	0.17

	売建	—	6,292	△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	18,930	22,636.42	428,507,497	26,436.60	500,444,914	5.36
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	57,700	5,508.79	317,857,216	7,222.50	416,738,250	4.46
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	248,000	1,172.28	290,726,481	1,545.04	383,169,920	4.10
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	48,081	5,194.05	249,735,391	5,192.00	249,636,552	2.67
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	35,900	1,942.63	69,740,524	2,632.50	94,506,750	1.01
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,489	16,252.84	72,959,000	19,507.87	87,570,851	0.94
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,830	2,177.62	62,780,985	2,973.47	85,725,385	0.92
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	971,000	86.48	83,977,106	77.89	75,636,045	0.81
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	60,000	1,223.11	73,386,872	1,115.77	66,946,500	0.72
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	8,620	4,883.48	42,095,604	6,515.53	56,163,903	0.60
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	34,508	1,084.96	37,440,142	1,355.64	46,780,580	0.50
ブラジル	株式	VALE SA	素材	37,400	1,089.32	40,740,871	1,242.55	46,471,579	0.50
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	62,000	893.13	55,374,613	716.85	44,444,700	0.48
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	16,605	3,212.63	53,345,876	2,553.01	42,392,839	0.45
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	5,510	8,335.62	45,929,299	7,506.40	41,360,264	0.44
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	615,000	74.46	45,797,590	62.77	38,606,625	0.41
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8,329	4,185.50	34,861,073	4,452.79	37,087,371	0.40
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	782	36,862.29	28,826,315	47,197.61	36,908,533	0.40
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	15,000	1,556.96	23,354,508	2,431.48	36,472,200	0.39
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	125,800	317.76	39,975,454	277.68	34,932,144	0.37
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	28,306	1,630.55	46,154,369	1,232.71	34,893,118	0.37
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,750	13,329.25	36,655,440	12,342.80	33,942,700	0.36

韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,247	17,300.86	21,574,183	25,872.00	32,262,384	0.35
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	3,900	5,468.78	21,328,246	8,158.80	31,819,320	0.34
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	62,002	717.32	44,475,397	511.91	31,739,592	0.34
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	4,306	10,176.51	43,820,068	7,215.30	31,069,116	0.33
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	9,183	3,054.89	28,053,093	3,214.09	29,515,034	0.32
中国	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	806,000	42.54	34,291,533	35.37	28,508,220	0.31
ブラジル	株式	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	各種金融	21,200	1,007.72	21,363,735	1,310.29	27,778,165	0.30
ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	銀行	49,000	650.52	31,875,639	563.98	27,635,353	0.30

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	4.09
		素材	4.93
		資本財	1.97
		商業・専門サービス	0.22
		運輸	0.99
		自動車・自動車部品	1.51
		耐久消費財・アパレル	0.82
		消費者サービス	1.20
		メディア・娯楽	6.71
		小売	9.28
		食品・生活必需品小売り	1.03
		食品・飲料・タバコ	2.67
		家庭用品・パーソナル用品	0.84
		ヘルスケア機器・サービス	0.93
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.07
		銀行	9.06
		各種金融	1.51
		保険	2.35
		不動産	1.65
		ソフトウェア・サービス	1.48
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.77
		電気通信サービス	2.53
		公益事業	1.53
		半導体・半導体製造装置	5.82
投資証券	―	―	0.06
合　　計			71.05

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 2009	買建	480	米ドル	23,910,590	2,501,047,714	25,848,000	2,703,700,800	28.96

(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	148,060.03	15,566,557	15,485,598	0.17
	オフショア人民元	売建	421.20	6,326	6,292	△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。

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	71,071,022,750	83.31
地方債証券	日本	4,467,505,500	5.24
特殊債券	日本	5,427,023,941	6.36
社債券	日本	3,310,374,000	3.88
	フランス	98,662,000	0.12
	オーストラリア	100,269,000	0.12
	小計	3,509,305,000	4.11
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	831,514,360	0.97
合計（純資産総額）		85,306,371,551	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１３３回利付国債（５年）	1,280,000,000	100.66	1,288,557,000	100.54	1,286,976,000	0.100	2022/9/20	1.51
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	1,070,000,000	101.00	1,080,752,900	100.97	1,080,432,500	0.100	2024/6/20	1.27
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	1,060,000,000	100.72	1,067,646,500	100.60	1,066,455,400	0.100	2022/12/20	1.25
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	910,000,000	101.30	921,897,300	101.19	920,829,000	0.100	2029/9/20	1.08
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	890,000,000	100.91	898,111,500	100.93	898,277,000	0.100	2024/3/20	1.05
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	870,000,000	101.83	885,948,000	101.53	883,371,900	0.100	2027/3/20	1.04
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	860,000,000	100.74	866,429,400	100.67	865,779,200	0.100	2023/3/20	1.01
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	850,000,000	100.82	856,970,000	100.75	856,392,000	0.100	2023/6/20	1.00
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	814,000,000	103.09	839,166,700	102.73	836,279,180	0.400	2025/9/20	0.98
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	820,000,000	100.90	827,394,900	100.88	827,240,600	0.100	2023/12/20	0.97
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	790,000,000	101.42	801,240,300	101.55	802,292,400	0.100	2028/9/20	0.94
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	760,000,000	101.22	769,287,600	101.08	768,208,000	0.100	2029/12/20	0.90
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	690,000,000	101.51	700,480,300	101.42	699,804,900	0.100	2026/9/20	0.82
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	680,000,000	101.50	690,230,500	101.36	689,261,600	0.100	2026/6/20	0.81
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	680,000,000	101.09	687,446,200	101.05	687,187,600	0.100	2024/12/20	0.81
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	640,000,000	101.49	649,574,400	101.47	649,465,600	0.100	2026/12/20	0.76
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	640,000,000	101.50	649,627,000	101.38	648,876,800	0.100	2029/3/20	0.76
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	640,000,000	101.40	648,960,000	101.29	648,268,800	0.100	2029/6/20	0.76
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	102.78	648,591,900	102.49	646,718,210	0.400	2025/3/20	0.76
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	620,000,000	101.80	631,180,600	101.61	630,013,000	0.100	2028/3/20	0.74
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	620,000,000	101.03	626,409,800	101.03	626,441,800	0.100	2024/9/20	0.73
日本	国債証券	第４０８回利付国債（２年）	610,000,000	100.45	612,782,100	100.36	612,244,800	0.100	2022/1/1	0.72
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	590,000,000	100.86	595,086,000	101.01	595,964,900	0.100	2030/3/20	0.70
日本	国債証券	第４１３回利付国債（２年）	550,000,000	100.46	552,569,700	100.47	552,618,000	0.100	2022/6/1	0.65
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	532,000,000	102.98	547,859,440	102.58	545,741,560	0.600	2023/12/20	0.64
日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	520,000,000	102.49	532,981,900	102.33	532,116,000	0.300	2025/12/20	0.62
日本	国債証券	第１５２回利付国債（２０年）	460,000,000	115.38	530,791,600	113.96	524,252,800	1.200	2035/3/20	0.61
日本	国債証券	第１６６回利付国債（２０年）	490,000,000	108.18	530,091,500	106.32	521,012,100	0.700	2038/9/20	0.61
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	510,000,000	101.38	517,047,200	101.47	517,522,500	0.100	2028/12/20	0.61
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	510,000,000	100.86	514,391,000	100.81	514,171,800	0.100	2023/9/20	0.60

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.31
地方債証券	5.24
特殊債券	6.36
社債券	4.11
合　　計	99.03

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。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	11,347,650,749	43.50
	カナダ	471,636,342	1.81
	メキシコ	188,718,436	0.72
	ドイツ	1,968,788,744	7.55
	イタリア	2,412,931,371	9.25
	フランス	2,657,928,907	10.19
	オランダ	522,783,657	2.00
	スペイン	1,576,857,206	6.05
	ベルギー	667,717,314	2.56
	オーストリア	408,046,046	1.56
	フィンランド	164,401,711	0.63
	アイルランド	217,367,473	0.83
	イギリス	1,696,044,912	6.50
	スウェーデン	79,548,557	0.30
	ノルウェー	58,059,582	0.22
	デンマーク	140,559,882	0.54
	ポーランド	158,063,243	0.61
	オーストラリア	570,352,324	2.19
	シンガポール	108,425,431	0.42
	マレーシア	127,461,380	0.49

	イスラエル	97,610,111	0.37
	小計	25,640,953,378	98.30
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	442,932,026	1.70
合計（純資産総額）		26,083,885,404	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	11,181.92	129,710,359	11,413.86	132,400,797	1.500	2030/2/15	0.51
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	18,970.66	117,618,115	18,880.33	117,058,073	5.500	2029/4/25	0.45
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	490,000	21,382.75	104,775,514	21,502.30	105,361,282	5.750	2032/10/25	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	450,000	22,552.97	101,488,364	23,244.48	104,600,179	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,339.68	96,387,331	12,264.55	104,248,708	2.750	2028/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	10,980.74	98,826,707	11,251.24	101,261,173	1.625	2026/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	10,728.24	95,481,349	11,208.33	99,754,215	2.125	2024/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	10,916.19	91,696,030	11,734.19	98,567,276	2.250	2027/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,734.05	91,239,442	11,535.00	98,047,583	2.000	2026/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,171.47	94,957,553	11,383.21	96,757,347	2.500	2024/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	12,674.82	81,118,880	15,102.23	96,654,316	3.000	2049/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	630,000	12,405.72	78,156,056	15,032.36	94,703,920	3.000	2048/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	11,745.29	93,962,377	11,807.74	94,461,967	2.250	2027/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	11,598.92	84,672,183	12,338.10	90,068,130	2.625	2029/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	10,862.71	85,815,409	11,383.83	89,932,259	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	560,000	13,342.65	74,718,886	16,043.02	89,840,940	3.375	2048/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	690,000	11,714.15	80,827,662	12,719.31	87,763,295	3.125	2028/11/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	570,000	15,263.89	87,004,206	15,342.89	87,454,473	2.750	2027/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	590,000	12,163.93	71,767,210	14,809.07	87,373,520	2.875	2049/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	700,000	11,590.86	81,136,086	12,458.22	87,207,589	2.875	2028/8/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	410,000	20,854.58	85,503,798	21,200.78	86,923,212	4.750	2035/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	810,000	10,554.79	85,493,829	10,714.75	86,789,535	2.000	2021/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	10,818.77	81,140,835	11,377.70	85,332,755	2.250	2024/11/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	680,000	11,459.97	77,927,837	12,410.42	84,390,868	2.875	2028/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	710,000	10,811.45	76,761,337	11,643.28	82,667,341	1.750	2029/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	680,000	11,100.15	75,481,034	12,155.45	82,657,123	2.375	2029/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	10,736.03	78,373,024	11,305.17	82,527,779	2.000	2025/2/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	520,000	15,708.97	81,686,657	15,843.33	82,385,329	2.500	2030/5/25	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	13,357.32	82,815,415	13,255.22	82,182,377	1.750	2023/5/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	530,000	12,673.33	67,168,680	15,317.15	81,180,934	3.125	2048/5/15	0.31

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）

国債証券	98.30
合　　計	98.30

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。

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資信託受益証券	アメリカ	1,388,674,247	28.91
	アイルランド	3,304,578,769	68.80
	小計	4,693,253,016	97.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	109,609,118	2.28
合計（純資産総額）		4,802,862,134	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	―	12,320,702	0.26

(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	561,645	6,063.93	3,405,778,888	5,883.75	3,304,578,769	68.80
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	417,617	3,477.98	1,452,467,629	3,325.23	1,388,674,247	28.91

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	97.72
合　　計	97.72

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	117,800.00	12,378,424	12,320,702	0.26

(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 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	日本	17,539,855,792	97.65
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	421,893,360	2.35
合計（純資産総額）		17,961,749,152	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	416,682,000	2.32

(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	1,960	805,537.32	1,578,853,163	592,000	1,160,320,000	6.46
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,063	300,219.58	919,572,597	364,500	1,116,463,500	6.22
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,024	732,982.39	1,483,556,364	540,000	1,092,960,000	6.08

日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	5,821	141,858.93	825,760,844	175,700	1,022,749,700	5.69
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,547	171,832.62	1,124,988,173	130,800	856,347,600	4.77
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,888	277,406.54	801,150,089	274,700	793,333,600	4.42
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,923	338,020.49	650,013,420	341,000	655,743,000	3.65
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,034	209,300.06	844,316,481	135,900	548,220,600	3.05
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,610	166,806.32	435,364,517	197,400	515,214,000	2.87
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,826	204,779.43	783,486,109	126,900	485,519,400	2.70
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	673	681,498.6	458,648,560	681,000	458,313,000	2.55
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,330	173,779.17	752,463,806	102,900	445,557,000	2.48
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,323	285,619.47	377,874,566	317,000	419,391,000	2.33
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	5,954	85,359.03	508,227,680	69,100	411,421,400	2.29
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,892	165,115.79	312,399,087	192,700	364,588,400	2.03
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	626	786,529.34	492,367,369	578,000	361,828,000	2.01
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,014	511,523.44	518,684,770	348,500	353,379,000	1.97
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,260	442,904.75	558,059,985	278,300	350,658,000	1.95
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	580	515,271.37	298,857,398	577,000	334,660,000	1.86
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,329	172,536.92	401,838,489	137,100	319,305,900	1.78
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	883	347,063.1	306,456,726	331,000	292,273,000	1.63
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,554	102,935.56	262,897,436	107,000	273,278,000	1.52
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	1,321	205,026.54	270,840,068	193,300	255,349,300	1.42
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,522	63,993.46	417,365,348	38,150	248,814,300	1.39
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	431	792,109.38	341,399,142	553,000	238,343,000	1.33
日本	投資証券	プレミア投資法人	1,829	144,989.19	265,185,238	118,700	217,102,300	1.21
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,053	139,444.61	286,279,784	104,000	213,512,000	1.19
日本	投資証券	日本リート投資法人	658	456,654.09	300,478,392	319,500	210,231,000	1.17
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,879	175,489.84	329,745,426	111,800	210,072,200	1.17
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,465	47,175.21	399,338,152	24,200	204,853,000	1.14

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	97.65
合　　計	97.65

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	252	日本円	428,222,720	416,682,000	2.32

(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 7月31日現在です。
・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
投資証券	アメリカ	15,209,067,653	74.61
	カナダ	383,343,879	1.88
	ドイツ	55,199,194	0.27
	イタリア	1,877,503	0.01
	フランス	432,805,955	2.12
	オランダ	36,949,104	0.18
	スペイン	97,461,488	0.48
	ベルギー	255,288,600	1.25
	アイルランド	30,647,600	0.15
	イギリス	1,067,595,734	5.24
	オーストラリア	1,322,367,339	6.49
	ニュージーランド	93,343,202	0.46
	香港	337,007,520	1.65
	シンガポール	888,529,138	4.36
	韓国	9,442,576	0.05
	イスラエル	11,978,855	0.06
	ガーンジー	41,889,572	0.21
	マン島	5,824,743	0.03
	小計	20,280,619,655	99.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	103,532,069	0.51
合計（純資産総額）		20,384,151,724	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	買建	—	20,499,640	0.10

(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	127,359	9,835.82	1,252,680,461	11,002.87	1,401,315,030	6.87
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,264	67,433.95	1,029,311,838	81,373.56	1,242,086,172	6.09
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	46,302	14,255.10	660,039,882	16,603.15	768,759,422	3.77
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	25,918	21,927.06	568,305,788	20,680.46	535,996,318	2.63
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	72,079	7,219.12	520,347,450	5,702.79	411,051,545	2.02
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,833	16,929.30	369,617,550	18,423.19	402,233,682	1.97
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,292	19,826.80	481,632,736	15,815.52	384,190,612	1.88
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	59,324	7,040.57	417,674,781	6,333.53	375,730,334	1.84
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	281,653	1,134.00	319,396,800	1,282.04	361,091,454	1.77
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	52,861	11,133.16	588,510,437	6,654.65	351,771,559	1.73
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	60,356	7,484.03	451,706,687	5,643.16	340,599,168	1.67
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	93,886	3,031.17	284,585,293	3,119.17	292,846,582	1.44
香港	投資証券	LINK REIT	355,200	987.25	350,671,201	814.05	289,150,560	1.42
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	206,516	1,241.83	256,457,882	1,305.69	269,645,949	1.32
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	92,745	3,276.35	303,865,564	2,905.78	269,497,308	1.32
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	63,778	3,710.82	236,668,891	4,180.86	266,647,017	1.31
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	16,967	15,420.80	261,644,777	15,448.37	262,112,562	1.29
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,296	28,553.40	322,539,255	23,076.85	260,676,120	1.28
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	64,246	4,919.56	316,062,671	4,030.23	258,926,671	1.27
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,744	13,141.37	259,463,305	12,292.59	242,704,936	1.19
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	22,245	10,782.07	239,847,198	10,617.94	236,196,209	1.16
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	25,054	12,245.20	306,791,426	9,233.04	231,324,634	1.13
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,444	7,074.08	222,437,450	7,064.68	222,141,924	1.09
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,793	7,907.32	235,582,933	7,377.43	219,796,010	1.08
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	91,438	2,126.48	194,441,337	2,152.66	196,835,657	0.97
アメリカ	投資証券	UDR INC	51,022	4,494.69	229,328,543	3,776.05	192,662,133	0.95
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	81,146	2,425.10	196,787,658	2,265.63	183,847,299	0.90
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	19,956	7,099.59	141,679,432	8,699.58	173,608,858	0.85
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	16,840	10,572.30	178,037,633	9,724.66	163,763,308	0.80
アメリカ	投資証券	AMERICOLD REALTY TRUST	34,824	3,701.10	128,887,298	4,220.61	146,978,523	0.72

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.49
合　　計	99.49

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	196,000.00	20,606,793	20,499,640	0.10

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

≪参考情報≫

運用実績

2020年7月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,163円	純資産総額	76.2億円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年7月25日	0円
2019年7月25日	0円
2020年7月27日	0円
－	－
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内株式マザーファンド	29.0
RAM先進国株式マザーファンド	19.9
RAM新興国株式マザーファンド	5.1
RAM国内債券マザーファンド	20.4
RAM先進国債券マザーファンド	5.0
RAM新興国債券マザーファンド	5.0
RAM国内リートマザーファンド	10.2
RAM先進国リートマザーファンド	5.1
現金等	0.3
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	60.1
米ドル	22.8
ユーロ	5.1
英ポンド	1.3
香港ドル	1.1
その他	9.8
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内株式	日本	トヨタ自動車	－	3.26
	日本	ソフトバンクグループ	－	2.42
	日本	ソニー	－	2.38
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	－	2.94
	アメリカ	MICROSOFT CORP	－	2.58
	アメリカ	AMAZON.COM INC	－	2.26
新興国株式	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	－	5.36
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	－	4.46
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	－	4.10
国内債券	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.51
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.27
	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.25
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/2/15	0.51
	フランス	GOV OF FRANCE	2029/4/25	0.45
	フランス	GOV OF FRANCE	2032/10/25	0.40
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	－	68.80
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	－	28.91
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	－	6.46
	日本	日本プロロジスリート投資法人	－	6.22
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	－	6.08
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	－	6.87
	アメリカ	EQUINIX INC	－	6.09
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	－	3.77

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

・2011年から2016年までは、対象インデックス(合成ベンチマーク)の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は10月26日から12月末までの騰落率です。2020年は7月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（２）コースの選択

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

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（３）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（４）取扱時間

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

（５）取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

（６）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

（７）申込単位

最低単位を1円または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）申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

（９）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

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

（３）解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

（４）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（５）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

（６）手取額

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

（７）解約単位

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

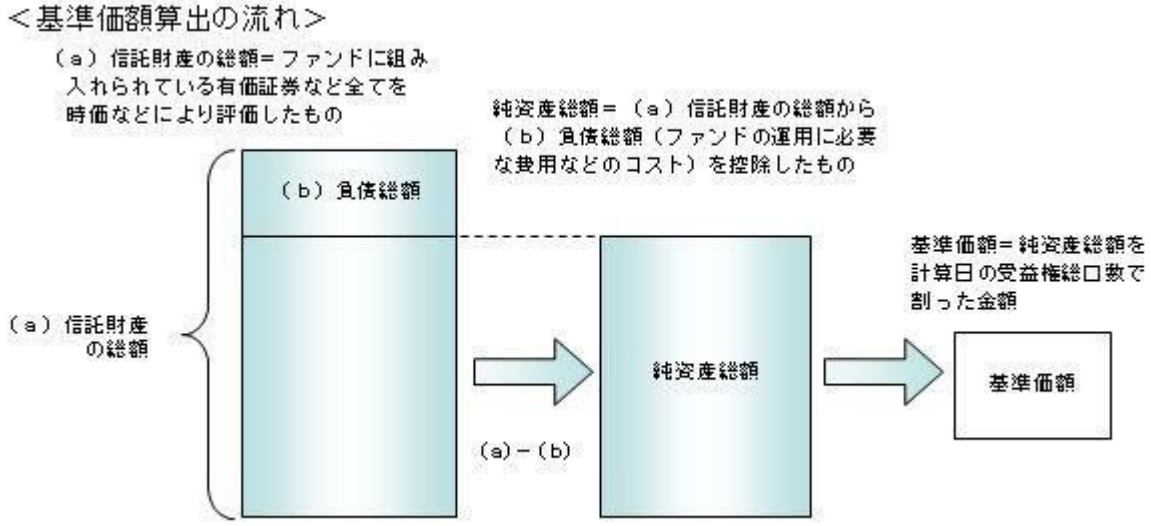
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①　基準価額の算出

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



②　有価証券などの評価基準

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

す。
＜主な資産の評価方法＞
◇マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。
◇国内上場株式
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇外国株式
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。
・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
・価格情報会社の提供する価額
※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。
＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。
◇国内上場不動産投信
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇海外上場不動産投信
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2017年10月26日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年7月26日から翌年7月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）
１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
イ）信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

② 償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更など

1）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2）この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

3）委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

④ 書面決議

1）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の２週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

2）受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

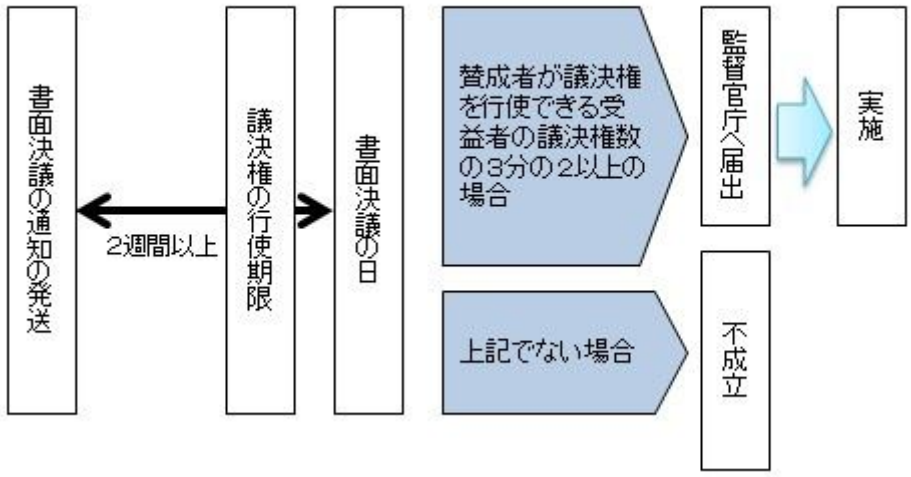
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

4）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。

5）当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

6）当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

＜書面決議の主な流れ＞



⑤　公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

⑥　運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

⑦　関係法人との契約について

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

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

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

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

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期計算期間(2019年 7月26日から2020年 7月27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】

【つみたてバランスファンド】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 2019年 7月25日現在	第3期 2020年 7月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,238,120	41,438,298
親投資信託受益証券	3,279,255,746	7,713,098,239
流動資産合計	3,295,493,866	7,754,536,537
資産合計	3,295,493,866	7,754,536,537
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,410,134	2,733,612
未払受託者報酬	259,677	683,592
未払委託者報酬	2,272,129	5,981,382
未払利息	44	112
その他未払費用	129,783	290,435
流動負債合計	4,071,767	9,689,133
負債合計	4,071,767	9,689,133
純資産の部		
元本等		
元本	3,188,872,917	7,507,078,798
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	102,549,182	237,768,606
（分配準備積立金）	85,590,407	191,711,824
元本等合計	3,291,422,099	7,744,847,404
純資産合計	3,291,422,099	7,744,847,404
負債純資産合計	3,295,493,866	7,754,536,537

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期 自　2018年 7月26日 至　2019年 7月25日	第3期 自　2019年 7月26日 至　2020年 7月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	83,722,623	48,942,493
営業収益合計	83,722,623	48,942,493
営業費用		
支払利息	8,174	24,393
受託者報酬	373,217	1,166,627
委託者報酬	3,265,522	10,207,869
その他費用	186,884	499,187
営業費用合計	3,833,797	11,898,076
営業利益又は営業損失（△）	79,888,826	37,044,417
経常利益又は経常損失（△）	79,888,826	37,044,417
当期純利益又は当期純損失（△）	79,888,826	37,044,417
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（△）	347,250	△405,406
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,501,654	102,549,182
剰余金増加額又は欠損金減少額	12,117,941	107,624,613
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	12,117,941	107,624,613
剰余金減少額又は欠損金増加額	611,989	9,855,012
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	611,989	9,855,012
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	102,549,182	237,768,606

（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原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっております。ただし、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2019年 7月26日から2020年 7月27日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第2期 2019年 7月25日現在		第3期 2020年 7月27日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況		１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	545,298,860円	期首元本額	3,188,872,917円
期中追加設定元本額	2,744,605,538円	期中追加設定元本額	4,603,201,837円
期中一部解約元本額	101,031,481円	期中一部解約元本額	284,995,956円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	3,188,872,917口	２． 計算期間の末日における受益権の総数	7,507,078,798口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0322円	３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0317円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(10,322円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,317円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日		第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	39,815,689円	A 費用控除後の配当等収益額	110,914,577円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	39,725,887円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	39,716,068円	C 収益調整金額	219,159,100円
D 分配準備積立金額	6,048,831円	D 分配準備積立金額	80,797,247円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	125,306,475円	E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	410,870,924円
F 当ファンドの期末残存口数	3,188,872,917口	F 当ファンドの期末残存口数	7,507,078,798口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	392円	G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	547円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第2期 2019年 7月25日現在	第3期 2020年 7月27日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	83,666,500	92,493,244
合計	83,666,500	92,493,244

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	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	2,080,350,763	2,326,664,293	
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	676,734,334	782,440,236	
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	1,144,518,133	1,524,154,797	
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	299,837,531	384,961,406	
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	412,484,360	377,258,195	
	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	1,474,116,724	1,551,065,616	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	361,996,029	383,281,395	
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	368,283,176	383,272,301	
合計		6,818,321,050	7,713,098,239	

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

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	432,067,596
株式	26,845,238,190
派生商品評価勘定	733,350
未収入金	19,191,826
未収配当金	33,415,400

	2020年 7月27日現在
前払金	12,545,000
差入委託証拠金	16,530,000
流動資産合計	27,359,721,362
資産合計	27,359,721,362
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,844,300
未払金	72,177,251
未払解約金	3,088,000
未払利息	1,171
流動負債合計	87,110,722
負債合計	87,110,722
純資産の部	
元本等	
元本	24,384,590,778
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,888,019,862
元本等合計	27,272,610,640
純資産合計	27,272,610,640
負債純資産合計	27,359,721,362

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 7月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	26,668,234,398円
期中追加設定元本額	35,164,870,676円
期中一部解約元本額	37,448,514,296円
期末元本額	24,384,590,778円
期末元本の内訳※	

りそなラップ型ファンド（安定型）	1,705,146,782円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,213,573,607円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,111,936,980円
ＤＣりそな　グローバルバランス	33,795,255円
つみたてバランスファンド	2,080,350,763円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	695,553,585円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	343,062,813円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	205,035,444円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,608,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	11,143,239円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	3,961,213円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	6,771,567円
リスクコントロール・オープン	5,150,901円
ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	196,941,729円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	11,058,055,556円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	929,396,480円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	89,474,074円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	269,848,296円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	299,577,000円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	340,110,389円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	244,877,619円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	155,375,135円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	100,063,513円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	317,639,747円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	51,619,540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）	1,933,118円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	532,001,366円
りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	827,263,864円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,495,483,821円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	45,838,639円
２．　計算日における受益権の総数	
	24,384,590,778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	1.1184円
(10,000口当たり純資産額)	(11,184円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△591,599,136
合計	△591,599,136

(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 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	468,875,950	－	457,765,000	△11,110,950
合計		468,875,950	－	457,765,000	△11,110,950

（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	600	2,720.00	1,632,000	
日本水産	16,500	468.00	7,722,000	
マルハニチロ	2,400	2,142.00	5,140,800	
カネコ種苗	500	1,450.00	725,000	
サカタのタネ	2,000	3,335.00	6,670,000	
ホクト	1,300	2,100.00	2,730,000	

ホクリヨウ	300	641.00	192,300	
住石ホールディングス	3,300	126.00	415,800	
日鉄鉱業	400	4,365.00	1,746,000	
三井松島ホールディングス	600	772.00	463,200	
国際石油開発帝石	66,200	668.00	44,221,600	
石油資源開発	2,200	1,859.00	4,089,800	
K＆Oエナジーグループ	800	1,527.00	1,221,600	
ヒノキヤグループ	400	1,560.00	624,000	
ショーボンドホールディングス	2,600	4,790.00	12,454,000	
ミライト・ホールディングス	4,900	1,598.00	7,830,200	
タマホーム	900	1,189.00	1,070,100	
サンヨーホームズ	100	612.00	61,200	
日本アクア	700	638.00	446,600	
ファーストコーポレーション	500	600.00	300,000	
ベステラ	300	1,009.00	302,700	
ＴＡＴＥＲＵ	3,300	164.00	541,200	
キャンディル	300	562.00	168,600	
スペースバリューホールディングス	2,000	365.00	730,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	706.00	211,800	
第一カッター興業	200	2,511.00	502,200	
明豊ファシリティワークス	500	595.00	297,500	
安藤・間	9,800	601.00	5,889,800	
東急建設	4,800	542.00	2,601,600	
コムシスホールディングス	5,900	3,235.00	19,086,500	
ビーアールホールディングス	1,800	604.00	1,087,200	
高松コンストラクショングループ	1,000	2,322.00	2,322,000	
東建コーポレーション	500	7,130.00	3,565,000	
ソネック	200	821.00	164,200	
ヤマウラ	700	835.00	584,500	
大成建設	12,700	3,845.00	48,831,500	
大林組	38,100	998.00	38,023,800	
清水建設	38,700	843.00	32,624,100	
飛島建設	1,100	1,100.00	1,210,000	
長谷工コーポレーション	14,800	1,307.00	19,343,600	
松井建設	1,500	671.00	1,006,500	
錢高組	200	3,980.00	796,000	
鹿島建設	29,900	1,239.00	37,046,100	
不動テトラ	1,000	1,428.00	1,428,000	
大末建設	400	822.00	328,800	
鉄建建設	800	2,029.00	1,623,200	
西松建設	2,900	2,102.00	6,095,800	
三井住友建設	9,200	458.00	4,213,600	

大豊建設	900	2,418.00	2,176,200	
前田建設工業	9,500	760.00	7,220,000	
佐田建設	800	415.00	332,000	
ナカノフドー建設	1,000	399.00	399,000	
奥村組	2,100	2,589.00	5,436,900	
東鉄工業	1,600	2,711.00	4,337,600	
イチケン	300	1,541.00	462,300	
富士ピー・エス	600	598.00	358,800	
淺沼組	400	4,210.00	1,684,000	
戸田建設	15,800	705.00	11,139,000	
熊谷組	1,800	2,590.00	4,662,000	
北野建設	200	2,671.00	534,200	
植木組	200	2,444.00	488,800	
矢作建設工業	1,700	809.00	1,375,300	
ピーエス三菱	1,300	520.00	676,000	
日本ハウスホールディングス	2,600	268.00	696,800	
大東建託	4,200	10,135.00	42,567,000	
新日本建設	1,600	877.00	1,403,200	
ＮＩＰＰＯ	3,200	2,867.00	9,174,400	
東亜道路工業	200	3,210.00	642,000	
前田道路	3,400	2,009.00	6,830,600	
日本道路	400	7,540.00	3,016,000	
東亜建設工業	1,200	1,585.00	1,902,000	
日本国土開発	3,700	560.00	2,072,000	
若築建設	700	1,232.00	862,400	
東洋建設	4,300	399.00	1,715,700	
五洋建設	15,100	574.00	8,667,400	
世紀東急工業	1,800	748.00	1,346,400	
福田組	400	4,915.00	1,966,000	
住友林業	9,700	1,317.00	12,774,900	
日本基礎技術	1,300	403.00	523,900	
巴コーポレーション	1,700	343.00	583,100	
大和ハウス工業	37,700	2,540.00	95,758,000	
ライト工業	2,200	1,528.00	3,361,600	
積水ハウス	41,300	2,103.50	86,874,550	
日特建設	1,000	788.00	788,000	
北陸電気工事	700	1,002.00	701,400	
ユアテック	2,200	658.00	1,447,600	
日本リーテック	800	3,200.00	2,560,000	
四電工	200	2,414.00	482,800	
中電工	1,500	2,289.00	3,433,500	
関電工	5,400	894.00	4,827,600	

きんでん	9,100	1,716.00	15,615,600	
東京エネシス	1,300	785.00	1,020,500	
トーエネック	400	3,695.00	1,478,000	
住友電設	1,100	2,389.00	2,627,900	
日本電設工業	2,100	2,381.00	5,000,100	
協和エクシオ	5,800	2,625.00	15,225,000	
新日本空調	1,000	2,389.00	2,389,000	
九電工	2,700	3,205.00	8,653,500	
三機工業	2,700	1,263.00	3,410,100	
日揮ホールディングス	11,700	1,144.00	13,384,800	
中外炉工業	400	1,647.00	658,800	
ヤマト	1,200	657.00	788,400	
太平電業	900	2,169.00	1,952,100	
高砂熱学工業	3,300	1,525.00	5,032,500	
三晃金属工業	200	2,097.00	419,400	
朝日工業社	300	3,170.00	951,000	
明星工業	2,500	891.00	2,227,500	
大氣社	1,900	3,240.00	6,156,000	
ダイダン	900	2,807.00	2,526,300	
日比谷総合設備	1,200	1,913.00	2,295,600	
フィル・カンパニー	200	1,837.00	367,400	
ＯＳＪＢホールディングス	6,000	244.00	1,464,000	
東洋エンジニアリング	1,600	353.00	564,800	
レイズネクスト	2,000	1,237.00	2,474,000	
日本製粉	3,600	1,697.00	6,109,200	
日清製粉グループ本社	13,800	1,576.00	21,748,800	
日東富士製粉	100	6,050.00	605,000	
昭和産業	1,100	3,450.00	3,795,000	
鳥越製粉	1,100	932.00	1,025,200	
中部飼料	1,500	1,674.00	2,511,000	
フィード・ワン	8,100	202.00	1,636,200	
東洋精糖	200	1,194.00	238,800	
日本甜菜製糖	600	1,814.00	1,088,400	
三井製糖	1,100	2,032.00	2,235,200	
塩水港精糖	1,300	216.00	280,800	
日新製糖	600	1,864.00	1,118,400	
森永製菓	2,900	3,965.00	11,498,500	
中村屋	300	4,100.00	1,230,000	
江崎グリコ	3,600	5,030.00	18,108,000	
名糖産業	600	1,381.00	828,600	
井村屋グループ	700	2,350.00	1,645,000	
不二家	700	2,188.00	1,531,600	

山崎製パン	9,100	1,817.00	16,534,700	
第一屋製パン	200	983.00	196,600	
モロゾフ	200	5,450.00	1,090,000	
亀田製菓	700	5,550.00	3,885,000	
寿スピリッツ	1,200	4,060.00	4,872,000	
カルビー	5,600	3,090.00	17,304,000	
森永乳業	2,300	4,835.00	11,120,500	
六甲バター	800	1,596.00	1,276,800	
ヤクルト本社	8,400	6,410.00	53,844,000	
明治ホールディングス	8,100	8,440.00	68,364,000	
雪印メグミルク	2,900	2,538.00	7,360,200	
プリマハム	1,900	2,752.00	5,228,800	
日本ハム	4,700	4,325.00	20,327,500	
林兼産業	400	572.00	228,800	
丸大食品	1,300	1,943.00	2,525,900	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,000	2,564.00	2,564,000	
柿安本店	400	2,609.00	1,043,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	7,900	643.00	5,079,700	
サッポロホールディングス	4,200	1,935.00	8,127,000	
アサヒグループホールディングス	25,500	3,610.00	92,055,000	
キリンホールディングス	51,700	2,083.00	107,691,100	
宝ホールディングス	9,000	942.00	8,478,000	
オエノンホールディングス	3,200	419.00	1,340,800	
養命酒製造	400	1,828.00	731,200	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	8,600	1,749.00	15,041,400	
サントリー食品インターナショナル	8,200	4,135.00	33,907,000	
ダイドーグループホールディングス	600	4,685.00	2,811,000	
伊藤園	3,700	6,290.00	23,273,000	
キーコーヒー	1,200	2,216.00	2,659,200	
ユニカフェ	300	1,015.00	304,500	
ジャパンフーズ	200	1,218.00	243,600	
日清オイリオグループ	1,600	3,345.00	5,352,000	
不二製油グループ本社	3,000	2,849.00	8,547,000	
かどや製油	100	3,765.00	376,500	
Ｊ－オイルミルズ	600	4,080.00	2,448,000	
キッコーマン	8,800	4,895.00	43,076,000	
味の素	26,900	1,731.50	46,577,350	
キユーピー	6,800	1,946.00	13,232,800	
ハウス食品グループ本社	4,600	3,355.00	15,433,000	
カゴメ	4,600	3,140.00	14,444,000	
焼津水産化学工業	600	900.00	540,000	
アリアケジャパン	1,100	6,670.00	7,337,000	

ピエトロ	200	1,650.00	330,000	
エバラ食品工業	300	2,190.00	657,000	
やまみ	100	2,227.00	222,700	
ニチレイ	5,800	2,916.00	16,912,800	
東洋水産	6,300	6,330.00	39,879,000	
イートアンド	400	1,800.00	720,000	
大冷	200	2,073.00	414,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	903.00	632,100	
日清食品ホールディングス	5,200	9,510.00	49,452,000	
永谷園ホールディングス	600	2,196.00	1,317,600	
一正蒲鉾	500	1,003.00	501,500	
フジッコ	1,300	2,081.00	2,705,300	
ロック・フィールド	1,300	1,291.00	1,678,300	
日本たばこ産業	70,400	1,897.50	133,584,000	
ケンコーマヨネーズ	700	1,902.00	1,331,400	
わらべや日洋ホールディングス	800	1,576.00	1,260,800	
なとり	700	1,820.00	1,274,000	
イフジ産業	200	834.00	166,800	
ピックルスコーポレーション	300	2,809.00	842,700	
北の達人コーポレーション	4,300	528.00	2,270,400	
ユーグレナ	5,300	766.00	4,059,800	
ミヨシ油脂	500	1,131.00	565,500	
理研ビタミン	1,200	2,359.00	2,830,800	
片倉工業	1,700	1,137.00	1,932,900	
グンゼ	900	4,055.00	3,649,500	
東洋紡	4,700	1,531.00	7,195,700	
ユニチカ	3,500	358.00	1,253,000	
富士紡ホールディングス	600	3,040.00	1,824,000	
倉敷紡績	1,200	2,139.00	2,566,800	
シキボウ	600	1,051.00	630,600	
日本毛織	3,900	957.00	3,732,300	
ダイトウボウ	1,900	120.00	228,000	
トーア紡コーポレーション	500	482.00	241,000	
ダイドーリミテッド	1,500	194.00	291,000	
帝国繊維	1,300	2,443.00	3,175,900	
帝人	9,700	1,660.00	16,102,000	
東レ	86,200	499.30	43,039,660	
サカイオーベックス	300	2,225.00	667,500	
住江織物	300	1,978.00	593,400	
日本フエルト	700	485.00	339,500	
イチカワ	200	1,300.00	260,000	
日東製網	100	1,397.00	139,700	

アツギ	1,000	583.00	583,000	
ダイニック	400	787.00	314,800	
セーレン	2,900	1,328.00	3,851,200	
ソトー	500	958.00	479,000	
東海染工	200	1,125.00	225,000	
小松マテーレ	2,000	748.00	1,496,000	
ワコールホールディングス	3,000	1,961.00	5,883,000	
ホギメディカル	1,400	3,275.00	4,585,000	
クラウディアホールディングス	300	332.00	99,600	
ＴＳＩホールディングス	4,000	322.00	1,288,000	
マツオカコーポレーション	300	1,853.00	555,900	
ワールド	1,700	1,398.00	2,376,600	
三陽商会	600	628.00	376,800	
ナイガイ	400	354.00	141,600	
オンワードホールディングス	7,100	311.00	2,208,100	
ルックホールディングス	400	734.00	293,600	
キムラタン	6,200	25.00	155,000	
ゴールドウイン	2,200	6,610.00	14,542,000	
デサント	2,300	1,807.00	4,156,100	
キング	600	535.00	321,000	
ヤマトインターナショナル	1,000	340.00	340,000	
特種東海製紙	800	4,765.00	3,812,000	
王子ホールディングス	49,800	477.00	23,754,600	
日本製紙	5,300	1,434.00	7,600,200	
三菱製紙	1,300	349.00	453,700	
北越コーポレーション	7,100	373.00	2,648,300	
中越パルプ工業	500	1,561.00	780,500	
巴川製紙所	400	879.00	351,600	
大王製紙	5,200	1,437.00	7,472,400	
阿波製紙	300	486.00	145,800	
レンゴー	11,300	833.00	9,412,900	
トーモク	700	1,819.00	1,273,300	
ザ・パック	900	2,858.00	2,572,200	
クラレ	18,700	1,100.00	20,570,000	
旭化成	78,900	812.00	64,066,800	
共和レザー	600	642.00	385,200	
昭和電工	8,500	2,366.00	20,111,000	
住友化学	87,500	332.00	29,050,000	
住友精化	500	3,430.00	1,715,000	
日産化学	6,600	5,700.00	37,620,000	
ラサ工業	400	1,584.00	633,600	
クレハ	1,000	4,640.00	4,640,000	

多木化学	500	7,100.00	3,550,000	
テイカ	900	1,369.00	1,232,100	
石原産業	2,100	731.00	1,535,100	
片倉コープアグリ	300	1,242.00	372,600	
日本曹達	1,800	2,846.00	5,122,800	
東ソー	18,400	1,479.00	27,213,600	
トクヤマ	3,400	2,621.00	8,911,400	
セントラル硝子	2,400	2,037.00	4,888,800	
東亞合成	7,500	1,087.00	8,152,500	
大阪ソーダ	1,200	2,378.00	2,853,600	
関東電化工業	2,800	857.00	2,399,600	
デンカ	4,300	2,701.00	11,614,300	
信越化学工業	20,400	13,525.00	275,910,000	
日本カーバイド工業	400	1,231.00	492,400	
堺化学工業	800	2,140.00	1,712,000	
第一稀元素化学工業	1,300	788.00	1,024,400	
エア・ウォーター	11,100	1,466.00	16,272,600	
大陽日酸	11,400	1,887.00	21,511,800	
日本化学工業	400	2,228.00	891,200	
東邦アセチレン	200	1,232.00	246,400	
日本パーカライジング	6,000	1,124.00	6,744,000	
高圧ガス工業	1,900	850.00	1,615,000	
チタン工業	100	1,770.00	177,000	
四国化成工業	1,800	1,142.00	2,055,600	
戸田工業	300	1,794.00	538,200	
ステラ　ケミファ	600	2,827.00	1,696,200	
保土谷化学工業	400	4,705.00	1,882,000	
日本触媒	1,800	5,580.00	10,044,000	
大日精化工業	1,100	2,479.00	2,726,900	
カネカ	3,100	2,683.00	8,317,300	
三菱瓦斯化学	11,100	1,676.00	18,603,600	
三井化学	10,800	2,200.00	23,760,000	
ＪＳＲ	11,100	2,273.00	25,230,300	
東京応化工業	2,000	5,720.00	11,440,000	
大阪有機化学工業	1,100	2,822.00	3,104,200	
三菱ケミカルホールディングス	79,600	622.10	49,519,160	
ＫＨネオケム	2,100	2,127.00	4,466,700	
ダイセル	15,500	797.00	12,353,500	
住友ベークライト	1,900	2,903.00	5,515,700	
積水化学工業	25,200	1,526.00	38,455,200	
日本ゼオン	10,700	1,046.00	11,192,200	
アイカ工業	3,600	3,620.00	13,032,000	

宇部興産	6,000	1,806.00	10,836,000	
積水樹脂	2,100	2,234.00	4,691,400	
タキロンシーアイ	2,600	707.00	1,838,200	
旭有機材	700	1,409.00	986,300	
ニチバン	600	1,558.00	934,800	
リケンテクノス	3,000	421.00	1,263,000	
大倉工業	600	1,550.00	930,000	
積水化成品工業	1,600	573.00	916,800	
群栄化学工業	300	2,437.00	731,100	
タイガースポリマー	600	474.00	284,400	
ミライアル	400	1,114.00	445,600	
ダイキアクシス	400	791.00	316,400	
ダイキョーニシカワ	2,500	502.00	1,255,000	
竹本容器	400	705.00	282,000	
森六ホールディングス	600	1,669.00	1,001,400	
日本化薬	7,400	1,079.00	7,984,600	
カーリットホールディングス	1,300	520.00	676,000	
日本精化	1,000	1,459.00	1,459,000	
扶桑化学工業	1,200	4,220.00	5,064,000	
トリケミカル研究所	300	11,150.00	3,345,000	
ＡＤＥＫＡ	5,500	1,492.00	8,206,000	
日油	4,500	4,000.00	18,000,000	
新日本理化	1,900	164.00	311,600	
ハリマ化成グループ	1,000	987.00	987,000	
花王	29,100	8,544.00	248,630,400	
第一工業製薬	400	4,950.00	1,980,000	
石原ケミカル	300	2,023.00	606,900	
日華化学	400	876.00	350,400	
ニイタカ	200	3,245.00	649,000	
三洋化成工業	700	4,815.00	3,370,500	
有機合成薬品工業	900	358.00	322,200	
大日本塗料	1,300	996.00	1,294,800	
日本ペイントホールディングス	9,800	7,640.00	74,872,000	
関西ペイント	13,400	2,156.00	28,890,400	
神東塗料	900	167.00	150,300	
中国塗料	3,400	866.00	2,944,400	
日本特殊塗料	900	1,037.00	933,300	
藤倉化成	1,600	554.00	886,400	
太陽ホールディングス	900	5,160.00	4,644,000	
ＤＩＣ	5,000	2,728.00	13,640,000	
サカタインクス	2,600	1,063.00	2,763,800	
東洋インキＳＣホールディングス	2,500	2,059.00	5,147,500	

Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	900	841.00	756,900	
富士フイルムホールディングス	23,300	4,777.00	111,304,100	
資生堂	24,200	6,615.00	160,083,000	
ライオン	15,800	2,771.00	43,781,800	
高砂香料工業	800	2,167.00	1,733,600	
マンダム	2,700	1,861.00	5,024,700	
ミルボン	1,600	5,080.00	8,128,000	
ファンケル	4,900	3,195.00	15,655,500	
コーセー	2,300	12,030.00	27,669,000	
コタ	700	1,210.00	847,000	
シーボン	200	1,913.00	382,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	5,200	1,752.00	9,110,400	
ノエビアホールディングス	1,000	4,570.00	4,570,000	
アジュバンコスメジャパン	300	939.00	281,700	
エステー	800	1,850.00	1,480,000	
アグロ　カネショウ	500	1,433.00	716,500	
コニシ	2,000	1,513.00	3,026,000	
長谷川香料	2,100	2,291.00	4,811,100	
星光ＰＭＣ	700	735.00	514,500	
小林製薬	3,400	9,100.00	30,940,000	
荒川化学工業	1,100	1,258.00	1,383,800	
メック	800	2,023.00	1,618,400	
日本高純度化学	300	2,585.00	775,500	
タカラバイオ	3,200	2,914.00	9,324,800	
ＪＣＵ	1,500	3,270.00	4,905,000	
新田ゼラチン	800	667.00	533,600	
ＯＡＴアグリオ	200	1,082.00	216,400	
デクセリアルズ	3,100	878.00	2,721,800	
アース製薬	900	7,370.00	6,633,000	
北興化学工業	1,200	602.00	722,400	
大成ラミック	400	2,790.00	1,116,000	
クミアイ化学工業	5,000	1,079.00	5,395,000	
日本農薬	2,200	537.00	1,181,400	
アキレス	800	1,942.00	1,553,600	
有沢製作所	1,900	796.00	1,512,400	
日東電工	8,400	6,290.00	52,836,000	
レック	1,300	1,621.00	2,107,300	
三光合成	1,400	277.00	387,800	
きもと	2,000	180.00	360,000	
藤森工業	1,100	3,585.00	3,943,500	
前澤化成工業	800	1,002.00	801,600	
未来工業	700	1,926.00	1,348,200	

ウェーブロックホールディングス	400	825.00	330,000	
ＪＳＰ	700	1,485.00	1,039,500	
エフピコ	1,300	8,520.00	11,076,000	
天馬	800	1,682.00	1,345,600	
信越ポリマー	2,200	1,002.00	2,204,400	
東リ	3,000	272.00	816,000	
ニフコ	4,500	2,518.00	11,331,000	
バルカー	1,000	1,917.00	1,917,000	
ユニ・チャーム	23,400	4,779.00	111,828,600	
ショーエイコーポレーション	200	959.00	191,800	
協和キリン	12,200	2,686.00	32,769,200	
武田薬品工業	101,100	3,807.00	384,887,700	
アステラス製薬	105,400	1,739.50	183,343,300	
大日本住友製薬	9,000	1,376.00	12,384,000	
塩野義製薬	15,300	6,374.00	97,522,200	
わかもと製薬	1,400	267.00	373,800	
あすか製薬	1,400	1,200.00	1,680,000	
日本新薬	3,200	8,430.00	26,976,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,415.00	483,000	
中外製薬	38,000	5,095.00	193,610,000	
科研製薬	2,100	4,985.00	10,468,500	
エーザイ	14,500	8,746.00	126,817,000	
ロート製薬	6,200	3,355.00	20,801,000	
小野薬品工業	27,900	3,039.00	84,788,100	
久光製薬	3,200	4,780.00	15,296,000	
持田製薬	1,700	3,965.00	6,740,500	
参天製薬	22,700	1,872.00	42,494,400	
扶桑薬品工業	400	2,490.00	996,000	
日本ケミファ	200	2,549.00	509,800	
ツムラ	3,800	2,754.00	10,465,200	
日医工	3,400	1,292.00	4,392,800	
キッセイ薬品工業	2,200	2,306.00	5,073,200	
生化学工業	2,400	1,092.00	2,620,800	
栄研化学	2,100	1,677.00	3,521,700	
日水製薬	500	1,137.00	568,500	
鳥居薬品	800	3,500.00	2,800,000	
ＪＣＲファーマ	900	10,380.00	9,342,000	
東和薬品	1,600	1,987.00	3,179,200	
富士製薬工業	800	1,155.00	924,000	
沢井製薬	2,500	5,330.00	13,325,000	
ゼリア新薬工業	2,200	1,932.00	4,250,400	
第一三共	34,800	8,666.00	301,576,800	

キョーリン製薬ホールディングス	2,700	2,010.00	5,427,000	
大幸薬品	1,500	2,170.00	3,255,000	
ダイト	700	3,145.00	2,201,500	
大塚ホールディングス	23,200	4,508.00	104,585,600	
大正製薬ホールディングス	2,600	6,350.00	16,510,000	
ペプチドリーム	6,200	4,520.00	28,024,000	
日本コークス工業	10,100	65.00	656,500	
ニチレキ	1,400	1,681.00	2,353,400	
ユシロ化学工業	700	1,330.00	931,000	
ビーピー・カストロール	400	1,153.00	461,200	
富士石油	3,200	164.00	524,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	400	1,021.00	408,400	
出光興産	13,500	2,307.00	31,144,500	
ＥＮＥＯＳホールディングス	182,900	392.80	71,843,120	
コスモエネルギーホールディングス	3,500	1,640.00	5,740,000	
横浜ゴム	7,000	1,520.00	10,640,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	7,000	1,497.00	10,479,000	
ブリヂストン	35,000	3,428.00	119,980,000	
住友ゴム工業	10,900	980.00	10,682,000	
藤倉コンポジット	1,100	382.00	420,200	
オカモト	700	4,210.00	2,947,000	
フコク	500	630.00	315,000	
ニッタ	1,400	2,337.00	3,271,800	
住友理工	2,400	585.00	1,404,000	
三ツ星ベルト	1,600	1,867.00	2,987,200	
バンドー化学	2,100	666.00	1,398,600	
日東紡績	1,800	5,050.00	9,090,000	
ＡＧＣ	12,000	3,095.00	37,140,000	
日本板硝子	5,800	402.00	2,331,600	
石塚硝子	200	1,837.00	367,400	
日本山村硝子	500	879.00	439,500	
日本電気硝子	4,900	1,724.00	8,447,600	
オハラ	500	1,037.00	518,500	
住友大阪セメント	2,300	3,740.00	8,602,000	
太平洋セメント	7,700	2,433.00	18,734,100	
日本ヒューム	1,200	802.00	962,400	
日本コンクリート工業	2,600	278.00	722,800	
三谷セキサン	600	5,700.00	3,420,000	
アジアパイルホールディングス	1,700	490.00	833,000	
東海カーボン	12,700	970.00	12,319,000	
日本カーボン	600	3,480.00	2,088,000	
東洋炭素	700	1,759.00	1,231,300	

ノリタケカンパニーリミテド	700	3,340.00	2,338,000	
ＴＯＴＯ	8,700	4,200.00	36,540,000	
日本碍子	14,600	1,460.00	21,316,000	
日本特殊陶業	9,200	1,550.00	14,260,000	
ダントーホールディングス	900	168.00	151,200	
ＭＡＲＵＷＡ	500	8,610.00	4,305,000	
品川リフラクトリーズ	300	2,241.00	672,300	
黒崎播磨	200	3,540.00	708,000	
ヨータイ	1,000	730.00	730,000	
イソライト工業	600	434.00	260,400	
東京窯業	1,500	311.00	466,500	
ニッカトー	500	730.00	365,000	
フジミインコーポレーテッド	1,100	3,630.00	3,993,000	
クニミネ工業	500	988.00	494,000	
エーアンドエーマテリアル	200	1,036.00	207,200	
ニチアス	3,300	2,432.00	8,025,600	
ニチハ	1,700	2,360.00	4,012,000	
日本製鉄	53,800	985.50	53,019,900	
神戸製鋼所	22,000	383.00	8,426,000	
中山製鋼所	1,700	369.00	627,300	
合同製鐵	600	1,813.00	1,087,800	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	32,500	786.00	25,545,000	
東京製鐵	5,900	640.00	3,776,000	
共英製鋼	1,400	1,281.00	1,793,400	
大和工業	2,600	2,231.00	5,800,600	
東京鐵鋼	500	1,532.00	766,000	
大阪製鐵	600	1,232.00	739,200	
淀川製鋼所	1,600	1,920.00	3,072,000	
丸一鋼管	3,900	2,675.00	10,432,500	
モリ工業	400	2,254.00	901,600	
大同特殊鋼	2,000	3,495.00	6,990,000	
日本高周波鋼業	400	337.00	134,800	
日本冶金工業	1,000	1,596.00	1,596,000	
山陽特殊製鋼	800	879.00	703,200	
愛知製鋼	700	2,896.00	2,027,200	
日立金属	12,900	1,353.00	17,453,700	
日本金属	300	597.00	179,100	
大平洋金属	800	1,601.00	1,280,800	
新日本電工	7,700	153.00	1,178,100	
栗本鐵工所	600	1,646.00	987,600	
虹技	200	1,278.00	255,600	
日本鋳鉄管	100	1,265.00	126,500	

三菱製鋼	900	612.00	550,800	
日亜鋼業	1,700	303.00	515,100	
日本精線	200	3,545.00	709,000	
エンビプロ・ホールディングス	500	528.00	264,000	
シンニッタン	1,800	233.00	419,400	
新家工業	300	1,186.00	355,800	
大紀アルミニウム工業所	2,000	549.00	1,098,000	
日本軽金属ホールディングス	30,400	186.00	5,654,400	
三井金属鉱業	3,200	2,377.00	7,606,400	
東邦亜鉛	600	1,626.00	975,600	
三菱マテリアル	7,900	2,283.00	18,035,700	
住友金属鉱山	15,400	3,309.00	50,958,600	
ＤＯＷＡホールディングス	3,000	3,255.00	9,765,000	
古河機械金属	2,100	1,108.00	2,326,800	
エス・サイエンス	5,300	45.00	238,500	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	916.00	1,099,200	
東邦チタニウム	2,200	676.00	1,487,200	
ＵＡＣＪ	1,800	1,878.00	3,380,400	
ＣＫサンエツ	300	3,095.00	928,500	
古河電気工業	3,700	2,628.00	9,723,600	
住友電気工業	44,900	1,258.50	56,506,650	
フジクラ	14,500	314.00	4,553,000	
昭和電線ホールディングス	1,400	1,313.00	1,838,200	
東京特殊電線	200	2,290.00	458,000	
タツタ電線	2,400	567.00	1,360,800	
カナレ電気	200	1,698.00	339,600	
平河ヒューテック	600	964.00	578,400	
リョービ	1,500	1,160.00	1,740,000	
アーレスティ	1,600	360.00	576,000	
アサヒホールディングス	2,100	3,145.00	6,604,500	
稲葉製作所	700	1,426.00	998,200	
宮地エンジニアリンググループ	400	1,643.00	657,200	
トーカロ	3,300	1,211.00	3,996,300	
アルファＣｏ	400	952.00	380,800	
ＳＵＭＣＯ	14,300	1,669.00	23,866,700	
川田テクノロジーズ	200	4,650.00	930,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	300	3,950.00	1,185,000	
信和	700	707.00	494,900	
東洋製罐グループホールディングス	7,700	1,216.00	9,363,200	
ホッカンホールディングス	700	1,853.00	1,297,100	
コロナ	700	1,023.00	716,100	
横河ブリッジホールディングス	2,200	2,083.00	4,582,600	

駒井ハルテック	200	1,378.00	275,600	
高田機工	100	2,417.00	241,700	
三和ホールディングス	11,300	923.00	10,429,900	
文化シヤッター	3,500	719.00	2,516,500	
三協立山	1,500	924.00	1,386,000	
アルインコ	900	922.00	829,800	
東洋シヤッター	300	700.00	210,000	
ＬＩＸＩＬグループ	17,700	1,533.00	27,134,100	
日本フイルコン	900	484.00	435,600	
ノーリツ	2,500	1,356.00	3,390,000	
長府製作所	1,200	2,270.00	2,724,000	
リンナイ	2,300	8,980.00	20,654,000	
ダイニチ工業	600	674.00	404,400	
日東精工	1,700	452.00	768,400	
三洋工業	200	1,962.00	392,400	
岡部	2,400	826.00	1,982,400	
ジーテクト	1,500	970.00	1,455,000	
東プレ	2,200	1,148.00	2,525,600	
高周波熱錬	2,300	520.00	1,196,000	
東京製綱	900	571.00	513,900	
サンコール	900	415.00	373,500	
モリテック　スチール	900	308.00	277,200	
パイオラックス	1,800	1,620.00	2,916,000	
エイチワン	1,200	558.00	669,600	
日本発條	12,900	667.00	8,604,300	
中央発條	100	2,722.00	272,200	
アドバネクス	200	1,385.00	277,000	
立川ブラインド工業	500	1,200.00	600,000	
三益半導体工業	900	2,359.00	2,123,100	
日本ドライケミカル	300	1,637.00	491,100	
日本製鋼所	3,600	1,590.00	5,724,000	
三浦工業	5,200	4,195.00	21,814,000	
タクマ	4,100	1,506.00	6,174,600	
ツガミ	2,500	941.00	2,352,500	
オークマ	1,400	4,600.00	6,440,000	
芝浦機械	1,400	2,114.00	2,959,600	
アマダ	14,900	780.00	11,622,000	
アイダエンジニアリング	3,100	720.00	2,232,000	
滝澤鉄工所	400	1,035.00	414,000	
ＦＵＪＩ	5,200	1,990.00	10,348,000	
牧野フライス製作所	1,400	3,505.00	4,907,000	
オーエスジー	5,600	1,620.00	9,072,000	

ダイジェット工業	100	1,472.00	147,200	
旭ダイヤモンド工業	3,200	483.00	1,545,600	
DMG森精機	7,600	1,257.00	9,553,200	
ソディック	2,800	867.00	2,427,600	
ディスコ	1,600	26,810.00	42,896,000	
日東工器	700	2,079.00	1,455,300	
日進工具	500	2,717.00	1,358,500	
パンチ工業	1,100	429.00	471,900	
冨士ダイス	500	708.00	354,000	
豊和工業	700	824.00	576,800	
ＯＫＫ	500	373.00	186,500	
石川製作所	300	1,774.00	532,200	
東洋機械金属	900	408.00	367,200	
津田駒工業	200	860.00	172,000	
エンシュウ	300	936.00	280,800	
島精機製作所	1,900	1,410.00	2,679,000	
オプトラン	1,300	2,473.00	3,214,900	
ＮＣホールディングス	400	579.00	231,600	
イワキポンプ	800	969.00	775,200	
フリュー	1,200	975.00	1,170,000	
ヤマシンフィルタ	2,600	1,033.00	2,685,800	
日阪製作所	1,500	789.00	1,183,500	
やまびこ	2,300	970.00	2,231,000	
平田機工	600	6,230.00	3,738,000	
ペガサスミシン製造	1,200	310.00	372,000	
マルマエ	400	1,020.00	408,000	
タツモ	600	1,652.00	991,200	
ナブテスコ	7,100	3,495.00	24,814,500	
三井海洋開発	1,300	1,570.00	2,041,000	
レオン自動機	1,200	1,324.00	1,588,800	
ＳＭＣ	3,800	58,420.00	221,996,000	
ホソカワミクロン	400	6,080.00	2,432,000	
ユニオンツール	400	2,743.00	1,097,200	
オイレス工業	1,600	1,485.00	2,376,000	
日精エー・エス・ビー機械	300	2,939.00	881,700	
サトーホールディングス	1,700	2,345.00	3,986,500	
技研製作所	1,100	4,290.00	4,719,000	
日本エアーテック	400	1,401.00	560,400	
カワタ	400	751.00	300,400	
日精樹脂工業	1,000	825.00	825,000	
オカダアイヨン	400	932.00	372,800	
ワイエイシイホールディングス	500	707.00	353,500	

小松製作所	55,100	2,344.50	129,181,950	
住友重機械工業	7,000	2,350.00	16,450,000	
日立建機	4,900	3,290.00	16,121,000	
日工	1,700	634.00	1,077,800	
巴工業	500	1,887.00	943,500	
井関農機	1,200	1,221.00	1,465,200	
ＴＯＷＡ	1,200	1,382.00	1,658,400	
丸山製作所	200	1,236.00	247,200	
北川鉄工所	500	1,625.00	812,500	
ローツェ	500	5,900.00	2,950,000	
タカキタ	400	648.00	259,200	
クボタ	64,500	1,611.00	103,909,500	
荏原実業	300	2,907.00	872,100	
三菱化工機	400	1,875.00	750,000	
月島機械	2,200	1,224.00	2,692,800	
帝国電機製作所	1,000	1,226.00	1,226,000	
東京機械製作所	500	281.00	140,500	
新東工業	2,900	761.00	2,206,900	
澁谷工業	1,100	2,940.00	3,234,000	
アイチ　コーポレーション	2,100	805.00	1,690,500	
小森コーポレーション	3,100	733.00	2,272,300	
鶴見製作所	900	1,894.00	1,704,600	
住友精密工業	200	2,272.00	454,400	
日本ギア工業	500	281.00	140,500	
酒井重工業	200	2,240.00	448,000	
荏原製作所	5,000	2,706.00	13,530,000	
石井鐵工所	200	2,515.00	503,000	
西島製作所	1,200	896.00	1,075,200	
北越工業	1,300	1,195.00	1,553,500	
ダイキン工業	15,500	19,365.00	300,157,500	
オルガノ	400	5,590.00	2,236,000	
トーヨーカネツ	500	2,125.00	1,062,500	
栗田工業	6,600	3,020.00	19,932,000	
椿本チエイン	1,700	2,666.00	4,532,200	
大同工業	600	635.00	381,000	
木村化工機	1,000	443.00	443,000	
アネスト岩田	1,900	847.00	1,609,300	
ダイフク	6,200	9,960.00	61,752,000	
サムコ	300	2,935.00	880,500	
加藤製作所	700	1,281.00	896,700	
油研工業	200	1,562.00	312,400	
タダノ	5,900	912.00	5,380,800	

フジテック	4,400	1,827.00	8,038,800	
ＣＫＤ	3,300	2,184.00	7,207,200	
キトー	900	1,211.00	1,089,900	
平和	3,400	1,850.00	6,290,000	
理想科学工業	1,100	1,431.00	1,574,100	
ＳＡＮＫＹＯ	2,700	2,738.00	7,392,600	
日本金銭機械	1,300	572.00	743,600	
マースグループホールディングス	800	1,687.00	1,349,600	
フクシマガリレイ	700	3,345.00	2,341,500	
オーイズミ	500	378.00	189,000	
ダイコク電機	600	1,289.00	773,400	
竹内製作所	2,000	1,918.00	3,836,000	
アマノ	3,200	2,191.00	7,011,200	
ＪＵＫＩ	1,700	500.00	850,000	
サンデンホールディングス	1,600	289.00	462,400	
蛇の目ミシン工業	1,100	463.00	509,300	
マックス	1,900	1,551.00	2,946,900	
グローリー	3,100	2,498.00	7,743,800	
新晃工業	1,100	1,459.00	1,604,900	
大和冷機工業	1,800	975.00	1,755,000	
セガサミーホールディングス	12,100	1,302.00	15,754,200	
日本ピストンリング	400	1,241.00	496,400	
リケン	600	2,809.00	1,685,400	
ＴＰＲ	1,600	1,421.00	2,273,600	
ツバキ・ナカシマ	2,500	823.00	2,057,500	
ホシザキ	3,600	8,510.00	30,636,000	
大豊工業	1,000	565.00	565,000	
日本精工	22,900	788.00	18,045,200	
ＮＴＮ	28,100	213.00	5,985,300	
ジェイテクト	11,700	818.00	9,570,600	
不二越	1,100	3,320.00	3,652,000	
日本トムソン	3,600	346.00	1,245,600	
ＴＨＫ	7,100	2,694.00	19,127,400	
ユーシン精機	900	710.00	639,000	
前澤給装工業	400	2,037.00	814,800	
イーグル工業	1,500	705.00	1,057,500	
前澤工業	800	398.00	318,400	
日本ピラー工業	1,200	1,534.00	1,840,800	
キッツ	4,900	710.00	3,479,000	
マキタ	15,900	4,120.00	65,508,000	
日立造船	9,600	385.00	3,696,000	
三菱重工業	20,400	2,668.50	54,437,400	

ＩＨＩ	8,800	1,565.00	13,772,000	
スター精密	1,900	1,277.00	2,426,300	
日清紡ホールディングス	8,100	760.00	6,156,000	
イビデン	7,400	2,980.00	22,052,000	
コニカミノルタ	26,600	369.00	9,815,400	
ブラザー工業	14,800	1,880.00	27,824,000	
ミネベアミツミ	22,600	1,876.00	42,397,600	
日立製作所	58,400	3,340.00	195,056,000	
三菱電機	121,500	1,427.00	173,380,500	
富士電機	7,300	2,914.00	21,272,200	
東洋電機製造	400	1,164.00	465,600	
安川電機	13,100	3,745.00	49,059,500	
シンフォニアテクノロジー	1,600	1,108.00	1,772,800	
明電舎	2,200	1,732.00	3,810,400	
オリジン	300	1,308.00	392,400	
山洋電気	600	5,000.00	3,000,000	
デンヨー	1,000	2,075.00	2,075,000	
東芝テック	1,500	4,435.00	6,652,500	
芝浦メカトロニクス	200	2,805.00	561,000	
マブチモーター	3,400	3,405.00	11,577,000	
日本電産	29,300	8,395.00	245,973,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	392.00	274,400	
トレックス・セミコンダクター	700	1,199.00	839,300	
東光高岳	700	1,029.00	720,300	
ダブル・スコープ	1,900	708.00	1,345,200	
宮越ホールディングス	500	697.00	348,500	
ダイヘン	1,300	4,055.00	5,271,500	
ヤーマン	2,000	1,019.00	2,038,000	
ＪＶＣケンウッド	9,800	157.00	1,538,600	
ミマキエンジニアリング	1,100	388.00	426,800	
第一精工	500	1,984.00	992,000	
日新電機	2,800	1,043.00	2,920,400	
大崎電気工業	2,400	521.00	1,250,400	
オムロン	10,900	7,490.00	81,641,000	
日東工業	1,800	1,821.00	3,277,800	
ＩＤＥＣ	1,800	1,735.00	3,123,000	
正興電機製作所	300	1,014.00	304,200	
不二電機工業	200	1,327.00	265,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	4,100	1,817.00	7,449,700	
サクサホールディングス	300	1,513.00	453,900	
メルコホールディングス	400	3,200.00	1,280,000	
テクノメディカ	300	1,857.00	557,100	

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	589.00	176,700	
日本電気	14,700	5,930.00	87,171,000	
富士通	11,700	14,010.00	163,917,000	
沖電気工業	4,900	1,086.00	5,321,400	
岩崎通信機	500	843.00	421,500	
電気興業	600	2,488.00	1,492,800	
サンケン電気	1,300	2,160.00	2,808,000	
ナカヨ	200	1,481.00	296,200	
アイホン	700	1,532.00	1,072,400	
ルネサスエレクトロニクス	58,200	574.00	33,406,800	
セイコーエプソン	15,100	1,245.00	18,799,500	
ワコム	8,200	593.00	4,862,600	
アルバック	2,200	3,350.00	7,370,000	
アクセル	500	865.00	432,500	
ＥＩＺＯ	900	4,160.00	3,744,000	
ジャパンディスプレイ	34,900	49.00	1,710,100	
日本信号	3,100	1,070.00	3,317,000	
京三製作所	2,800	556.00	1,556,800	
能美防災	1,600	2,163.00	3,460,800	
ホーチキ	900	1,199.00	1,079,100	
星和電機	600	611.00	366,600	
エレコム	1,400	5,440.00	7,616,000	
パナソニック	138,900	1,039.00	144,317,100	
シャープ	14,100	1,171.00	16,511,100	
アンリツ	7,800	2,459.00	19,180,200	
富士通ゼネラル	3,300	2,603.00	8,589,900	
ソニー	76,100	8,196.00	623,715,600	
ＴＤＫ	5,900	10,700.00	63,130,000	
帝国通信工業	500	1,215.00	607,500	
タムラ製作所	4,100	463.00	1,898,300	
アルプスアルパイン	10,800	1,422.00	15,357,600	
池上通信機	400	879.00	351,600	
日本電波工業	1,100	329.00	361,900	
鈴木	600	685.00	411,000	
日本トリム	200	3,190.00	638,000	
ローランド　ディー．ジー．	700	1,224.00	856,800	
フォスター電機	1,300	1,122.00	1,458,600	
ＳＭＫ	300	2,658.00	797,400	
ヨコオ	800	2,687.00	2,149,600	
ティアック	600	110.00	66,000	
ホシデン	3,300	943.00	3,111,900	
ヒロセ電機	1,900	11,670.00	22,173,000	

日本航空電子工業	2,800	1,429.00	4,001,200	
ＴＯＡ	1,300	759.00	986,700	
マクセルホールディングス	2,600	926.00	2,407,600	
古野電気	1,600	1,019.00	1,630,400	
ユニデンホールディングス	300	1,759.00	527,700	
スミダコーポレーション	900	712.00	640,800	
アイコム	700	3,020.00	2,114,000	
リオン	500	2,069.00	1,034,500	
本多通信工業	1,000	430.00	430,000	
船井電機	1,200	540.00	648,000	
横河電機	11,200	1,692.00	18,950,400	
新電元工業	400	2,142.00	856,800	
アズビル	7,700	3,530.00	27,181,000	
東亜ディーケーケー	600	862.00	517,200	
日本光電工業	5,000	3,700.00	18,500,000	
チノー	400	1,409.00	563,600	
共和電業	1,300	428.00	556,400	
日本電子材料	500	1,266.00	633,000	
堀場製作所	2,400	5,730.00	13,752,000	
アドバンテスト	9,000	6,650.00	59,850,000	
小野測器	500	508.00	254,000	
エスペック	1,100	1,888.00	2,076,800	
キーエンス	11,000	46,140.00	507,540,000	
日置電機	600	3,340.00	2,004,000	
シスメックス	8,700	8,177.00	71,139,900	
日本マイクロニクス	2,100	1,095.00	2,299,500	
メガチップス	1,100	2,124.00	2,336,400	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	700	3,580.00	2,506,000	
澤藤電機	100	1,638.00	163,800	
原田工業	600	898.00	538,800	
コーセル	1,600	880.00	1,408,000	
イリソ電子工業	1,000	3,405.00	3,405,000	
オプテックスグループ	2,000	1,228.00	2,456,000	
千代田インテグレ	600	1,664.00	998,400	
アイ・オー・データ機器	400	1,016.00	406,400	
レーザーテック	5,300	9,760.00	51,728,000	
スタンレー電気	8,500	2,669.00	22,686,500	
岩崎電気	500	1,850.00	925,000	
ウシオ電機	6,700	1,329.00	8,904,300	
岡谷電機産業	900	302.00	271,800	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,100	309.00	339,900	
エノモト	400	1,073.00	429,200	

日本セラミック	1,200	2,158.00	2,589,600	
遠藤照明	600	629.00	377,400	
古河電池	900	1,155.00	1,039,500	
双信電機	600	403.00	241,800	
山一電機	900	1,339.00	1,205,100	
図研	800	3,100.00	2,480,000	
日本電子	2,400	2,919.00	7,005,600	
カシオ計算機	10,800	1,834.00	19,807,200	
ファナック	11,400	20,745.00	236,493,000	
日本シイエムケイ	2,900	434.00	1,258,600	
エンプラス	600	2,279.00	1,367,400	
大真空	400	2,209.00	883,600	
ローム	5,400	7,040.00	38,016,000	
浜松ホトニクス	8,700	4,835.00	42,064,500	
三井ハイテック	1,300	1,617.00	2,102,100	
新光電気工業	4,100	1,708.00	7,002,800	
京セラ	17,100	5,917.00	101,180,700	
太陽誘電	5,400	3,245.00	17,523,000	
村田製作所	35,700	6,712.00	239,618,400	
双葉電子工業	1,900	968.00	1,839,200	
北陸電気工業	500	897.00	448,500	
ニチコン	4,100	718.00	2,943,800	
日本ケミコン	900	1,891.00	1,701,900	
ＫＯＡ	1,800	994.00	1,789,200	
市光工業	1,800	506.00	910,800	
小糸製作所	7,300	4,585.00	33,470,500	
ミツバ	2,200	395.00	869,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,100	5,430.00	11,403,000	
キヤノン電子	1,300	1,540.00	2,002,000	
キヤノン	65,400	2,098.50	137,241,900	
リコー	30,900	798.00	24,658,200	
象印マホービン	3,600	1,376.00	4,953,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,532.00	306,400	
東京エレクトロン	7,700	28,870.00	222,299,000	
トヨタ紡織	3,500	1,427.00	4,994,500	
芦森工業	300	989.00	296,700	
ユニプレス	2,400	935.00	2,244,000	
豊田自動織機	9,800	5,790.00	56,742,000	
モリタホールディングス	2,100	1,908.00	4,006,800	
三櫻工業	1,500	675.00	1,012,500	
デンソー	26,800	4,150.00	111,220,000	
東海理化電機製作所	3,200	1,520.00	4,864,000	

三井Ｅ＆Ｓホールディングス	4,400	461.00	2,028,400	
川崎重工業	9,500	1,621.00	15,399,500	
名村造船所	3,800	172.00	653,600	
サノヤスホールディングス	1,400	183.00	256,200	
日本車輌製造	400	2,625.00	1,050,000	
三菱ロジスネクスト	1,600	1,029.00	1,646,400	
近畿車輛	200	1,228.00	245,600	
日産自動車	143,400	429.40	61,575,960	
いすゞ自動車	35,200	936.60	32,968,320	
トヨタ自動車	135,600	6,737.00	913,537,200	
日野自動車	15,200	719.00	10,928,800	
三菱自動車工業	45,000	269.00	12,105,000	
エフテック	800	497.00	397,600	
レシップホールディングス	500	563.00	281,500	
ＧＭＢ	200	607.00	121,400	
ファルテック	200	639.00	127,800	
武蔵精密工業	2,700	909.00	2,454,300	
日産車体	2,400	938.00	2,251,200	
新明和工業	3,300	1,025.00	3,382,500	
極東開発工業	2,300	1,499.00	3,447,700	
日信工業	1,800	2,200.00	3,960,000	
トピー工業	1,000	1,210.00	1,210,000	
ティラド	400	1,347.00	538,800	
曙ブレーキ工業	6,600	175.00	1,155,000	
タチエス	2,000	932.00	1,864,000	
ＮＯＫ	6,500	1,280.00	8,320,000	
フタバ産業	3,400	457.00	1,553,800	
ＫＹＢ	1,400	1,945.00	2,723,000	
大同メタル工業	2,300	552.00	1,269,600	
プレス工業	6,000	314.00	1,884,000	
ミクニ	1,500	271.00	406,500	
太平洋工業	2,500	916.00	2,290,000	
ケーヒン	2,100	2,544.00	5,342,400	
河西工業	1,600	444.00	710,400	
アイシン精機	10,000	3,180.00	31,800,000	
マツダ	35,800	699.00	25,024,200	
今仙電機製作所	1,100	738.00	811,800	
本田技研工業	95,700	2,758.00	263,940,600	
スズキ	24,100	3,702.00	89,218,200	
ＳＵＢＡＲＵ	37,700	2,246.00	84,674,200	
安永	600	1,042.00	625,200	
ヤマハ発動機	15,900	1,666.00	26,489,400	

ショーワ	2,100	2,250.00	4,725,000	
ＴＢＫ	1,400	455.00	637,000	
エクセディ	1,700	1,599.00	2,718,300	
豊田合成	3,900	2,138.00	8,338,200	
愛三工業	1,900	510.00	969,000	
盟和産業	200	897.00	179,400	
日本プラスト	1,000	434.00	434,000	
ヨロズ	1,100	1,107.00	1,217,700	
エフ・シー・シー	2,000	1,890.00	3,780,000	
シマノ	4,500	21,720.00	97,740,000	
テイ・エス　テック	2,800	2,939.00	8,229,200	
ジャムコ	600	726.00	435,600	
テルモ	34,400	4,012.00	138,012,800	
クリエートメディック	400	996.00	398,400	
日機装	3,600	973.00	3,502,800	
日本エム・ディ・エム	700	1,672.00	1,170,400	
島津製作所	14,500	2,810.00	40,745,000	
ＪＭＳ	1,000	813.00	813,000	
クボテック	300	369.00	110,700	
長野計器	900	986.00	887,400	
ブイ・テクノロジー	600	3,675.00	2,205,000	
東京計器	800	1,003.00	802,400	
愛知時計電機	200	4,460.00	892,000	
インターアクション	700	1,681.00	1,176,700	
オーバル	1,000	224.00	224,000	
東京精密	2,200	3,465.00	7,623,000	
マニー	4,800	2,838.00	13,622,400	
ニコン	18,600	844.00	15,698,400	
トプコン	6,100	806.00	4,916,600	
オリンパス	67,300	1,973.00	132,782,900	
理研計器	1,100	2,513.00	2,764,300	
タムロン	1,000	1,787.00	1,787,000	
ＨＯＹＡ	24,100	10,490.00	252,809,000	
シード	500	684.00	342,000	
ノーリツ鋼機	800	1,525.00	1,220,000	
エー・アンド・デイ	1,100	682.00	750,200	
朝日インテック	13,800	2,986.00	41,206,800	
シチズン時計	14,200	327.00	4,643,400	
リズム時計工業	400	615.00	246,000	
大研医器	800	565.00	452,000	
メニコン	1,700	5,090.00	8,653,000	
シンシア	100	362.00	36,200	

松風	500	1,418.00	709,000	
セイコーホールディングス	1,700	1,615.00	2,745,500	
ニプロ	8,400	1,178.00	9,895,200	
中本パックス	300	1,505.00	451,500	
スノーピーク	600	1,123.00	673,800	
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,530.00	5,889,000	
トランザクション	700	1,092.00	764,400	
粧美堂	300	353.00	105,900	
ニホンフラッシュ	1,100	1,515.00	1,666,500	
前田工繊	1,300	2,549.00	3,313,700	
永大産業	1,600	290.00	464,000	
アートネイチャー	1,300	630.00	819,000	
バンダイナムコホールディングス	12,600	6,100.00	76,860,000	
アイフィスジャパン	300	731.00	219,300	
共立印刷	1,900	137.00	260,300	
ＳＨＯＥＩ	1,100	2,820.00	3,102,000	
フランスベッドホールディングス	1,700	846.00	1,438,200	
パイロットコーポレーション	2,000	3,260.00	6,520,000	
萩原工業	700	1,423.00	996,100	
トッパン・フォームズ	2,600	1,079.00	2,805,400	
フジシールインターナショナル	2,700	1,977.00	5,337,900	
タカラトミー	5,500	866.00	4,763,000	
廣済堂	800	804.00	643,200	
エステールホールディングス	300	646.00	193,800	
アーク	4,600	112.00	515,200	
タカノ	500	714.00	357,000	
プロネクサス	1,000	1,196.00	1,196,000	
ホクシン	700	118.00	82,600	
ウッドワン	400	1,178.00	471,200	
大建工業	800	1,896.00	1,516,800	
凸版印刷	17,200	1,695.00	29,154,000	
大日本印刷	15,900	2,422.00	38,509,800	
共同印刷	400	2,734.00	1,093,600	
ＮＩＳＳＨＡ	2,500	1,094.00	2,735,000	
光村印刷	100	1,524.00	152,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	600	2,328.00	1,396,800	
アシックス	10,000	1,266.00	12,660,000	
ツツミ	400	1,920.00	768,000	
小松ウオール工業	400	1,733.00	693,200	
ヤマハ	7,200	4,990.00	35,928,000	
河合楽器製作所	400	2,734.00	1,093,600	
クリナップ	1,100	577.00	634,700	

ピジョン	7,300	4,345.00	31,718,500	
オリバー	300	2,520.00	756,000	
兼松サステック	100	1,478.00	147,800	
キングジム	1,000	866.00	866,000	
リンテック	2,900	2,573.00	7,461,700	
イトーキ	2,600	338.00	878,800	
任天堂	7,500	47,500.00	356,250,000	
三菱鉛筆	2,000	1,326.00	2,652,000	
タカラスタンダード	2,500	1,542.00	3,855,000	
コクヨ	5,800	1,226.00	7,110,800	
ナカバヤシ	1,200	602.00	722,400	
グローブライド	500	2,094.00	1,047,000	
オカムラ	4,200	761.00	3,196,200	
美津濃	1,100	2,008.00	2,208,800	
東京電力ホールディングス	97,000	323.00	31,331,000	
中部電力	37,200	1,344.50	50,015,400	
関西電力	46,100	1,063.50	49,027,350	
中国電力	17,500	1,345.00	23,537,500	
北陸電力	11,100	672.00	7,459,200	
東北電力	30,400	1,034.00	31,433,600	
四国電力	10,900	779.00	8,491,100	
九州電力	25,100	931.00	23,368,100	
北海道電力	11,400	414.00	4,719,600	
沖縄電力	2,400	1,737.00	4,168,800	
電源開発	9,700	1,688.00	16,373,600	
エフオン	700	604.00	422,800	
イーレックス	1,700	1,545.00	2,626,500	
レノバ	2,000	1,061.00	2,122,000	
東京瓦斯	23,400	2,695.00	63,063,000	
大阪瓦斯	23,600	2,160.00	50,976,000	
東邦瓦斯	6,000	5,220.00	31,320,000	
北海道瓦斯	700	1,560.00	1,092,000	
広島ガス	2,500	362.00	905,000	
西部瓦斯	1,400	2,627.00	3,677,800	
静岡ガス	3,500	875.00	3,062,500	
メタウォーター	600	4,680.00	2,808,000	
ＳＢＳホールディングス	1,000	2,345.00	2,345,000	
東武鉄道	12,700	3,395.00	43,116,500	
相鉄ホールディングス	3,900	2,815.00	10,978,500	
東急	30,700	1,332.00	40,892,400	
京浜急行電鉄	15,600	1,585.00	24,726,000	
小田急電鉄	18,100	2,562.00	46,372,200	

京王電鉄	6,300	5,940.00	37,422,000	
京成電鉄	8,500	2,984.00	25,364,000	
富士急行	1,700	3,300.00	5,610,000	
新京成電鉄	300	2,243.00	672,900	
東日本旅客鉄道	21,400	6,976.00	149,286,400	
西日本旅客鉄道	10,800	5,168.00	55,814,400	
東海旅客鉄道	10,100	14,455.00	145,995,500	
西武ホールディングス	15,900	1,038.00	16,504,200	
鴻池運輸	1,900	1,125.00	2,137,500	
西日本鉄道	3,400	2,849.00	9,686,600	
ハマキョウレックス	900	3,215.00	2,893,500	
サカイ引越センター	600	4,935.00	2,961,000	
近鉄グループホールディングス	11,500	4,600.00	52,900,000	
阪急阪神ホールディングス	15,400	3,390.00	52,206,000	
南海電気鉄道	5,500	2,420.00	13,310,000	
京阪ホールディングス	5,100	4,665.00	23,791,500	
神戸電鉄	300	3,595.00	1,078,500	
名古屋鉄道	9,500	2,893.00	27,483,500	
山陽電気鉄道	800	2,235.00	1,788,000	
日本通運	4,000	5,560.00	22,240,000	
ヤマトホールディングス	20,200	2,735.00	55,247,000	
山九	3,200	3,895.00	12,464,000	
丸運	600	225.00	135,000	
丸全昭和運輸	900	3,175.00	2,857,500	
センコーグループホールディングス	6,300	812.00	5,115,600	
トナミホールディングス	300	6,000.00	1,800,000	
ニッコンホールディングス	4,100	2,065.00	8,466,500	
日本石油輸送	100	3,070.00	307,000	
福山通運	1,500	3,810.00	5,715,000	
セイノーホールディングス	8,600	1,364.00	11,730,400	
エスライン	300	946.00	283,800	
神奈川中央交通	300	3,910.00	1,173,000	
日立物流	2,100	3,015.00	6,331,500	
丸和運輸機関	1,200	3,290.00	3,948,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,200	1,679.00	2,014,800	
九州旅客鉄道	10,100	2,358.00	23,815,800	
ＳＧホールディングス	12,100	3,705.00	44,830,500	
日本郵船	9,600	1,408.00	13,516,800	
商船三井	7,300	1,871.00	13,658,300	
川崎汽船	3,500	1,031.00	3,608,500	
ＮＳユナイテッド海運	600	1,552.00	931,200	
明治海運	1,200	322.00	386,400	

飯野海運	5,400	326.00	1,760,400	
共栄タンカー	200	795.00	159,000	
乾汽船	700	807.00	564,900	
日本航空	20,400	1,894.50	38,647,800	
ＡＮＡホールディングス	21,000	2,373.00	49,833,000	
パスコ	200	1,421.00	284,200	
トランコム	300	7,270.00	2,181,000	
日新	1,000	1,539.00	1,539,000	
三菱倉庫	3,700	2,735.00	10,119,500	
三井倉庫ホールディングス	1,300	1,550.00	2,015,000	
住友倉庫	4,100	1,268.00	5,198,800	
澁澤倉庫	600	1,961.00	1,176,600	
東陽倉庫	2,100	331.00	695,100	
日本トランスシティ	2,500	499.00	1,247,500	
ケイヒン	200	1,269.00	253,800	
中央倉庫	700	1,000.00	700,000	
川西倉庫	200	1,032.00	206,400	
安田倉庫	900	921.00	828,900	
ファイズホールディングス	200	1,071.00	214,200	
東洋埠頭	400	1,437.00	574,800	
宇徳	1,000	482.00	482,000	
上組	6,400	2,038.00	13,043,200	
サンリツ	300	578.00	173,400	
キムラユニティー	300	1,033.00	309,900	
キユーソー流通システム	300	1,506.00	451,800	
近鉄エクスプレス	2,400	1,907.00	4,576,800	
東海運	600	275.00	165,000	
エーアイテイー	800	946.00	756,800	
内外トランスライン	400	1,052.00	420,800	
日本コンセプト	400	1,254.00	501,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	3,400	2,212.00	7,520,800	
クロスキャット	300	1,128.00	338,400	
システナ	4,300	1,440.00	6,192,000	
デジタルアーツ	600	9,360.00	5,616,000	
日鉄ソリューションズ	1,800	3,065.00	5,517,000	
キューブシステム	600	1,066.00	639,600	
エイジア	200	1,418.00	283,600	
コア	500	1,257.00	628,500	
ラクーンホールディングス	500	1,099.00	549,500	
ソリトンシステムズ	500	1,545.00	772,500	
ソフトクリエイトホールディングス	500	2,379.00	1,189,500	
ＴＩＳ	11,900	2,273.00	27,048,700	

ネオス	500	626.00	313,000	
電算システム	500	4,795.00	2,397,500	
グリー	7,300	453.00	3,306,900	
コーエーテクモホールディングス	2,400	3,420.00	8,208,000	
三菱総合研究所	500	4,300.00	2,150,000	
ボルテージ	300	489.00	146,700	
電算	100	2,238.00	223,800	
ＡＧＳ	700	860.00	602,000	
ファインデックス	1,000	975.00	975,000	
ブレインパッド	300	4,190.00	1,257,000	
ＫＬａｂ	2,300	714.00	1,642,200	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,400	861.00	1,205,400	
イーブックイニシアティブジャパン	200	3,315.00	663,000	
ネクソン	33,300	2,482.00	82,650,600	
アイスタイル	3,300	274.00	904,200	
エムアップホールディングス	300	2,332.00	699,600	
エイチーム	800	889.00	711,200	
エニグモ	1,100	1,322.00	1,454,200	
テクノスジャパン	900	813.00	731,700	
ｅｎｉｓｈ	700	827.00	578,900	
コロプラ	3,900	968.00	3,775,200	
オルトプラス	700	431.00	301,700	
ブロードリーフ	5,900	563.00	3,321,700	
クロス・マーケティンググループ	500	331.00	165,500	
デジタルハーツホールディングス	600	869.00	521,400	
システム情報	900	1,462.00	1,315,800	
メディアドゥ	400	5,400.00	2,160,000	
じげん	2,900	303.00	878,700	
ブイキューブ	700	1,236.00	865,200	
エンカレッジ・テクノロジ	300	787.00	236,100	
サイバーリンクス	200	2,253.00	450,600	
ディー・エル・イー	1,000	415.00	415,000	
フィックスターズ	1,300	1,181.00	1,535,300	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,336.00	801,600	
オプティム	600	3,395.00	2,037,000	
セレス	400	1,200.00	480,000	
ＳＨＩＦＴ	500	11,770.00	5,885,000	
ティーガイア	1,100	1,936.00	2,129,600	
セック	200	3,025.00	605,000	
日本アジアグループ	1,200	291.00	349,200	
テクマトリックス	1,700	1,781.00	3,027,700	
プロシップ	300	1,499.00	449,700	

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,900	1,953.00	5,663,700	
GMOペイメントゲートウェイ	2,500	11,190.00	27,975,000	
ザッパラス	500	402.00	201,000	
システムリサーチ	300	2,086.00	625,800	
インターネットイニシアティブ	1,800	3,690.00	6,642,000	
さくらインターネット	1,300	625.00	812,500	
ヴィンクス	300	1,258.00	377,400	
GMOクラウド	200	7,740.00	1,548,000	
ＳＲＡホールディングス	600	2,349.00	1,409,400	
システムインテグレータ	400	816.00	326,400	
朝日ネット	800	1,162.00	929,600	
ｅＢＡＳＥ	1,400	1,536.00	2,150,400	
アバント	1,100	1,054.00	1,159,400	
アドソル日進	400	2,346.00	938,400	
フリービット	600	803.00	481,800	
コムチュア	1,300	2,715.00	3,529,500	
サイバーコム	200	1,836.00	367,200	
アステリア	700	486.00	340,200	
アイル	700	1,577.00	1,103,900	
マークラインズ	600	2,138.00	1,282,800	
メディカル・データ・ビジョン	900	1,417.00	1,275,300	
ｇｕｍｉ	1,500	932.00	1,398,000	
ショーケース	300	696.00	208,800	
モバイルファクトリー	300	1,055.00	316,500	
テラスカイ	400	4,860.00	1,944,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,379.00	689,500	
ＰＣＩホールディングス	500	1,166.00	583,000	
パイプドＨＤ	200	1,415.00	283,000	
アイビーシー	200	939.00	187,800	
ネオジャパン	200	2,258.00	451,600	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	100	3,985.00	398,500	
ランドコンピュータ	200	990.00	198,000	
ダブルスタンダード	200	5,590.00	1,118,000	
オープンドア	600	1,055.00	633,000	
マイネット	400	1,378.00	551,200	
アカツキ	400	3,875.00	1,550,000	
ベネフィットジャパン	100	1,625.00	162,500	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	300	2,259.00	677,700	
ＬＩＮＥ	2,000	5,550.00	11,100,000	
カナミックネットワーク	1,100	917.00	1,008,700	
ノムラシステムコーポレーション	500	462.00	231,000	
チェンジ	400	8,470.00	3,388,000	

シンクロ・フード	500	339.00	169,500	
オークネット	700	1,088.00	761,600	
セグエグループ	300	913.00	273,900	
エイトレッド	200	2,000.00	400,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,200	411.00	493,200	
マクロミル	2,400	754.00	1,809,600	
ビーグリー	200	2,145.00	429,000	
オロ	300	3,030.00	909,000	
ユーザーローカル	100	3,835.00	383,500	
テモナ	300	968.00	290,400	
ニーズウェル	200	709.00	141,800	
サインポスト	200	1,385.00	277,000	
ソルクシーズ	500	755.00	377,500	
フェイス	400	698.00	279,200	
プロトコーポレーション	1,100	930.00	1,023,000	
ハイマックス	100	2,010.00	201,000	
野村総合研究所	16,900	2,804.00	47,387,600	
サイバネットシステム	800	666.00	532,800	
ＣＥホールディングス	600	585.00	351,000	
日本システム技術	200	1,770.00	354,000	
インテージホールディングス	1,500	900.00	1,350,000	
東邦システムサイエンス	300	964.00	289,200	
ソースネクスト	5,600	273.00	1,528,800	
インフォコム	1,300	3,295.00	4,283,500	
ＨＥＲＯＺ	200	3,195.00	639,000	
ラクスル	1,000	3,175.00	3,175,000	
ＦＩＧ	1,300	250.00	325,000	
システムサポート	300	1,934.00	580,200	
イーソル	600	1,106.00	663,600	
アルテリア・ネットワークス	1,300	2,000.00	2,600,000	
東海ソフト	100	1,221.00	122,100	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	1,050.00	210,000	
トビラシステムズ	100	1,898.00	189,800	
フォーカスシステムズ	700	806.00	564,200	
クレスコ	700	1,382.00	967,400	
フジ・メディア・ホールディングス	11,500	1,024.00	11,776,000	
オービック	4,100	19,060.00	78,146,000	
ジャストシステム	1,900	8,120.00	15,428,000	
ＴＤＣソフト	1,000	916.00	916,000	
Ｚホールディングス	163,800	532.00	87,141,600	
トレンドマイクロ	5,300	6,200.00	32,860,000	
ＩＤホールディングス	500	1,562.00	781,000	

日本オラクル	2,400	12,690.00	30,456,000	
アルファシステムズ	400	4,180.00	1,672,000	
フューチャー	1,400	1,791.00	2,507,400	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	800	1,235.00	988,000	
ＳＢテクノロジー	400	3,980.00	1,592,000	
トーセ	300	859.00	257,700	
オービックビジネスコンサルタント	1,200	6,130.00	7,356,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,400	4,220.00	22,788,000	
アイティフォー	1,400	745.00	1,043,000	
東計電算	200	4,000.00	800,000	
エックスネット	200	975.00	195,000	
大塚商会	6,500	5,540.00	36,010,000	
サイボウズ	1,400	3,300.00	4,620,000	
ソフトブレーン	700	431.00	301,700	
電通国際情報サービス	700	5,630.00	3,941,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,100	847.00	931,700	
デジタルガレージ	2,100	3,750.00	7,875,000	
ＥＭシステムズ	1,700	921.00	1,565,700	
ウェザーニューズ	400	4,010.00	1,604,000	
ＣＩＪ	800	800.00	640,000	
ビジネスエンジニアリング	100	2,695.00	269,500	
日本エンタープライズ	1,200	361.00	433,200	
WOWOW	600	2,478.00	1,486,800	
スカラ	800	637.00	509,600	
インテリジェント　ウェイブ	700	807.00	564,900	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	380.00	380,000	
ネットワンシステムズ	4,500	4,105.00	18,472,500	
システムソフト	2,500	99.00	247,500	
アルゴグラフィックス	1,000	3,385.00	3,385,000	
マーベラス	1,800	680.00	1,224,000	
エイベックス	2,000	906.00	1,812,000	
日本ユニシス	3,700	3,355.00	12,413,500	
兼松エレクトロニクス	600	4,315.00	2,589,000	
東京放送ホールディングス	7,300	1,648.00	12,030,400	
日本テレビホールディングス	10,000	1,208.00	12,080,000	
朝日放送グループホールディングス	1,200	745.00	894,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,300	1,559.00	5,144,700	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	7,800	420.00	3,276,000	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,318.00	2,318,000	
日本ＢＳ放送	400	1,098.00	439,200	
ビジョン	1,100	666.00	732,600	
スマートバリュー	300	1,141.00	342,300	

ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	500	1,313.00	656,500	
ワイヤレスゲート	600	851.00	510,600	
コネクシオ	700	1,403.00	982,100	
日本通信	9,300	212.00	1,971,600	
クロップス	200	731.00	146,200	
日本電信電話	159,400	2,552.50	406,868,500	
ＫＤＤＩ	87,000	3,364.00	292,668,000	
ソフトバンク	108,400	1,429.00	154,903,600	
光通信	1,200	23,260.00	27,912,000	
ＮＴＴドコモ	85,300	3,000.00	255,900,000	
エムティーアイ	1,200	809.00	970,800	
GMOインターネット	4,700	3,065.00	14,405,500	
ファイバーゲート	400	1,991.00	796,400	
アイドママーケティングコミュニケーション	400	436.00	174,400	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	3,200	2,280.00	7,296,000	
学研ホールディングス	1,600	1,432.00	2,291,200	
ゼンリン	2,400	1,178.00	2,827,200	
昭文社ホールディングス	500	447.00	223,500	
インプレスホールディングス	900	149.00	134,100	
アイネット	600	1,657.00	994,200	
松竹	800	12,890.00	10,312,000	
東宝	7,000	3,345.00	23,415,000	
東映	400	14,640.00	5,856,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	31,800	1,246.00	39,622,800	
ピー・シー・エー	200	3,910.00	782,000	
ビジネスブレイン太田昭和	400	1,266.00	506,400	
ＤＴＳ	2,700	2,412.00	6,512,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,100	5,820.00	29,682,000	
シーイーシー	1,300	1,596.00	2,074,800	
カプコン	5,600	4,005.00	22,428,000	
アイ・エス・ビー	200	2,417.00	483,400	
ジャステック	800	1,202.00	961,600	
ＳＣＳＫ	2,800	5,370.00	15,036,000	
日本システムウエア	400	2,190.00	876,000	
アイネス	1,200	1,533.00	1,839,600	
ＴＫＣ	1,000	5,950.00	5,950,000	
富士ソフト	1,500	4,640.00	6,960,000	
ＮＳＤ	3,800	2,048.00	7,782,400	
コナミホールディングス	4,300	3,440.00	14,792,000	
福井コンピュータホールディングス	500	2,602.00	1,301,000	
ＪＢＣＣホールディングス	800	1,510.00	1,208,000	
ミロク情報サービス	1,100	2,204.00	2,424,400	

ソフトバンクグループ	94,600	6,499.00	614,805,400	
ホウスイ	100	885.00	88,500	
高千穂交易	500	923.00	461,500	
カワニシホールディングス	100	1,315.00	131,500	
伊藤忠食品	300	4,785.00	1,435,500	
エレマテック	1,100	919.00	1,010,900	
ＪＡＬＵＸ	300	1,731.00	519,300	
あらた	1,000	4,855.00	4,855,000	
トーメンデバイス	200	4,020.00	804,000	
東京エレクトロン　デバイス	400	3,810.00	1,524,000	
フィールズ	900	350.00	315,000	
双日	66,100	237.00	15,665,700	
アルフレッサ　ホールディングス	13,300	2,250.00	29,925,000	
横浜冷凍	3,100	899.00	2,786,900	
神栄	200	495.00	99,000	
ラサ商事	600	949.00	569,400	
アルコニックス	1,300	1,312.00	1,705,600	
神戸物産	4,100	6,660.00	27,306,000	
ハイパー	200	563.00	112,600	
あい　ホールディングス	1,700	1,524.00	2,590,800	
ディーブイエックス	400	911.00	364,400	
ダイワボウホールディングス	1,000	7,990.00	7,990,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,900	1,661.00	4,816,900	
ラクト・ジャパン	400	3,705.00	1,482,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,061.00	2,440,300	
八洲電機	900	958.00	862,200	
メディアスホールディングス	700	893.00	625,100	
レスターホールディングス	1,200	2,009.00	2,410,800	
ジューテックホールディングス	300	1,025.00	307,500	
大光	500	676.00	338,000	
ＯＣＨＩホールディングス	300	1,532.00	459,600	
ＴＯＫＡＩホールディングス	6,300	997.00	6,281,100	
黒谷	300	518.00	155,400	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	200	683.00	136,600	
三洋貿易	1,200	979.00	1,174,800	
ビューティガレージ	200	1,911.00	382,200	
ウイン・パートナーズ	900	960.00	864,000	
ミタチ産業	400	566.00	226,400	
シップヘルスケアホールディングス	1,900	4,570.00	8,683,000	
明治電機工業	400	1,392.00	556,800	
デリカフーズホールディングス	400	628.00	251,200	
スターティアホールディングス	300	620.00	186,000	

コメダホールディングス	2,600	1,813.00	4,713,800	
ピーバンドットコム	100	938.00	93,800	
アセンテック	100	3,800.00	380,000	
富士興産	400	446.00	178,400	
協栄産業	100	1,228.00	122,800	
小野建	1,100	1,229.00	1,351,900	
南陽	300	1,566.00	469,800	
佐鳥電機	800	835.00	668,000	
エコートレーディング	300	530.00	159,000	
伯東	700	957.00	669,900	
コンドーテック	900	1,150.00	1,035,000	
中山福	700	455.00	318,500	
ナガイレーベン	1,600	2,783.00	4,452,800	
三菱食品	1,300	2,661.00	3,459,300	
松田産業	900	1,582.00	1,423,800	
第一興商	1,800	3,140.00	5,652,000	
メディパルホールディングス	12,900	2,014.00	25,980,600	
ＳＰＫ	500	1,335.00	667,500	
萩原電気ホールディングス	400	2,038.00	815,200	
アズワン	800	11,350.00	9,080,000	
スズデン	400	1,217.00	486,800	
尾家産業	300	1,500.00	450,000	
シモジマ	700	1,236.00	865,200	
ドウシシャ	1,100	1,698.00	1,867,800	
小津産業	300	1,759.00	527,700	
高速	700	1,435.00	1,004,500	
たけびし	400	1,513.00	605,200	
リックス	300	1,663.00	498,900	
丸文	1,100	509.00	559,900	
ハピネット	1,000	1,175.00	1,175,000	
橋本総業ホールディングス	200	1,970.00	394,000	
日本ライフライン	3,500	1,365.00	4,777,500	
タカショー	800	499.00	399,200	
マルカ	400	1,817.00	726,800	
ＩＤＯＭ	3,200	505.00	1,616,000	
進和	700	1,951.00	1,365,700	
エスケイジャパン	200	297.00	59,400	
ダイトロン	500	1,502.00	751,000	
シークス	1,500	949.00	1,423,500	
田中商事	400	708.00	283,200	
オーハシテクニカ	600	1,660.00	996,000	
白銅	400	1,450.00	580,000	

ダイコー通産	100	1,212.00	121,200	
伊藤忠商事	83,700	2,371.00	198,452,700	
丸紅	124,600	515.10	64,181,460	
高島	200	1,839.00	367,800	
長瀬産業	6,700	1,326.00	8,884,200	
蝶理	800	1,747.00	1,397,600	
豊田通商	13,400	2,830.00	37,922,000	
三共生興	1,800	435.00	783,000	
兼松	4,500	1,292.00	5,814,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,164.00	232,800	
三井物産	103,700	1,645.50	170,638,350	
日本紙パルプ商事	700	3,840.00	2,688,000	
カメイ	1,600	1,050.00	1,680,000	
東都水産	200	3,230.00	646,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,666.00	533,200	
スターゼン	400	4,180.00	1,672,000	
山善	4,700	1,018.00	4,784,600	
椿本興業	200	3,360.00	672,000	
住友商事	75,500	1,252.50	94,563,750	
内田洋行	500	6,800.00	3,400,000	
三菱商事	78,500	2,253.00	176,860,500	
第一実業	600	3,680.00	2,208,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,000	2,192.00	6,576,000	
西華産業	700	1,259.00	881,300	
佐藤商事	1,000	938.00	938,000	
菱洋エレクトロ	1,200	3,190.00	3,828,000	
東京産業	1,100	522.00	574,200	
ユアサ商事	1,100	2,956.00	3,251,600	
神鋼商事	300	1,929.00	578,700	
トルク	700	301.00	210,700	
阪和興業	2,200	2,157.00	4,745,400	
正栄食品工業	800	3,880.00	3,104,000	
カナデン	1,000	1,360.00	1,360,000	
菱電商事	900	1,486.00	1,337,400	
フルサト工業	700	1,430.00	1,001,000	
岩谷産業	2,700	3,805.00	10,273,500	
ナイス	500	1,017.00	508,500	
昭光通商	400	609.00	243,600	
ニチモウ	200	1,903.00	380,600	
極東貿易	300	1,358.00	407,400	
イワキ	1,600	491.00	785,600	
三愛石油	2,900	907.00	2,630,300	

稲畑産業	2,600	1,255.00	3,263,000	
ＧＳＩクレオス	300	1,188.00	356,400	
明和産業	1,100	461.00	507,100	
クワザワ	400	532.00	212,800	
ヤマエ久野	900	1,244.00	1,119,600	
ワキタ	2,600	976.00	2,537,600	
東邦ホールディングス	3,800	1,892.00	7,189,600	
サンゲツ	3,300	1,543.00	5,091,900	
ミツウロコグループホールディングス	1,800	1,164.00	2,095,200	
シナネンホールディングス	500	2,941.00	1,470,500	
伊藤忠エネクス	2,600	843.00	2,191,800	
サンリオ	3,400	1,655.00	5,627,000	
サンワテクノス	800	855.00	684,000	
リョーサン	1,300	2,148.00	2,792,400	
新光商事	1,900	875.00	1,662,500	
トーホー	500	1,901.00	950,500	
三信電気	600	1,839.00	1,103,400	
東陽テクニカ	1,300	995.00	1,293,500	
モスフードサービス	1,600	2,886.00	4,617,600	
加賀電子	1,200	2,111.00	2,533,200	
ソーダニッカ	1,200	533.00	639,600	
立花エレテック	900	1,765.00	1,588,500	
フォーバル	500	1,010.00	505,000	
ＰＡＬＴＡＣ	1,900	5,240.00	9,956,000	
三谷産業	1,600	339.00	542,400	
太平洋興発	500	613.00	306,500	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	200	2,119.00	423,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,513.00	151,300	
国際紙パルプ商事	2,800	279.00	781,200	
ヤマタネ	600	1,312.00	787,200	
丸紅建材リース	100	1,582.00	158,200	
日鉄物産	900	3,445.00	3,100,500	
泉州電業	400	2,937.00	1,174,800	
トラスコ中山	2,500	2,600.00	6,500,000	
オートバックスセブン	4,400	1,339.00	5,891,600	
モリト	900	609.00	548,100	
加藤産業	1,700	3,420.00	5,814,000	
北恵	300	960.00	288,000	
イノテック	600	1,024.00	614,400	
イエローハット	2,300	1,507.00	3,466,100	
ＪＫホールディングス	1,100	803.00	883,300	
日伝	1,100	2,414.00	2,655,400	

北沢産業	900	287.00	258,300	
杉本商事	600	1,920.00	1,152,000	
因幡電機産業	3,400	2,480.00	8,432,000	
東テク	400	2,288.00	915,200	
ミスミグループ本社	15,000	2,744.00	41,160,000	
アルテック	900	255.00	229,500	
タキヒヨー	400	1,911.00	764,400	
蔵王産業	200	1,470.00	294,000	
スズケン	5,100	3,880.00	19,788,000	
ジェコス	800	973.00	778,400	
グローセル	1,200	435.00	522,000	
ローソン	3,000	5,580.00	16,740,000	
サンエー	1,000	4,165.00	4,165,000	
カワチ薬品	900	3,190.00	2,871,000	
エービーシー・マート	1,900	6,100.00	11,590,000	
ハードオフコーポレーション	500	710.00	355,000	
アスクル	1,300	3,100.00	4,030,000	
ゲオホールディングス	2,200	1,501.00	3,302,200	
アダストリア	1,700	1,500.00	2,550,000	
ジーフット	700	525.00	367,500	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	473.00	94,600	
くら寿司	600	4,810.00	2,886,000	
キャンドゥ	600	2,439.00	1,463,400	
パルグループホールディングス	1,200	1,213.00	1,455,600	
エディオン	5,500	1,078.00	5,929,000	
サーラコーポレーション	2,400	584.00	1,401,600	
ワッツ	500	1,000.00	500,000	
ハローズ	400	3,655.00	1,462,000	
フジオフードグループ本社	1,000	1,326.00	1,326,000	
あみやき亭	300	2,783.00	834,900	
ひらまつ	2,200	177.00	389,400	
大黒天物産	300	6,020.00	1,806,000	
ハニーズホールディングス	1,100	1,137.00	1,250,700	
ファーマライズホールディングス	300	716.00	214,800	
アルペン	900	1,633.00	1,469,700	
ハブ	300	616.00	184,800	
クオールホールディングス	1,800	1,135.00	2,043,000	
ジンズホールディングス	600	7,590.00	4,554,000	
ビックカメラ	7,100	1,141.00	8,101,100	
ＤＣＭホールディングス	6,600	1,321.00	8,718,600	
ペッパーフードサービス	1,000	488.00	488,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	8,500	4,390.00	37,315,000	

東京一番フーズ	300	515.00	154,500	
ＤＤホールディングス	500	704.00	352,000	
きちりホールディングス	300	566.00	169,800	
アークランドサービスホールディングス	900	1,975.00	1,777,500	
Ｊ．フロント　リテイリング	14,300	697.00	9,967,100	
ドトール・日レスホールディングス	1,700	1,552.00	2,638,400	
マツモトキヨシホールディングス	4,900	3,785.00	18,546,500	
ブロンコビリー	600	2,119.00	1,271,400	
ＺＯＺＯ	8,200	2,498.00	20,483,600	
トレジャー・ファクトリー	400	679.00	271,600	
物語コーポレーション	300	8,720.00	2,616,000	
ココカラファイン	1,200	6,180.00	7,416,000	
三越伊勢丹ホールディングス	20,900	588.00	12,289,200	
Ｈａｍｅｅ	400	1,792.00	716,800	
ウエルシアホールディングス	3,600	9,630.00	34,668,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,000	3,735.00	7,470,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,400	394.00	551,600	
ミサワ	200	670.00	134,000	
ティーライフ	200	1,060.00	212,000	
エー・ピーカンパニー	200	429.00	85,800	
チムニー	400	1,346.00	538,400	
シュッピン	800	686.00	548,800	
オイシックス・ラ・大地	1,200	2,200.00	2,640,000	
ネクステージ	1,700	1,074.00	1,825,800	
ジョイフル本田	3,500	1,502.00	5,257,000	
鳥貴族	400	1,466.00	586,400	
キリン堂ホールディングス	500	2,853.00	1,426,500	
ホットランド	800	1,111.00	888,800	
すかいらーくホールディングス	13,400	1,620.00	21,708,000	
ＳＦＰホールディングス	700	1,372.00	960,400	
綿半ホールディングス	400	2,050.00	820,000	
ヨシックス	200	1,854.00	370,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,500	1,276.00	4,466,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	501.00	300,600	
ＢＥＥＮＯＳ	600	1,196.00	717,600	
あさひ	900	1,649.00	1,484,100	
日本調剤	700	1,664.00	1,164,800	
コスモス薬品	1,100	19,270.00	21,197,000	
トーエル	600	699.00	419,400	
オンリー	200	559.00	111,800	
セブン&アイ・ホールディングス	46,800	3,463.00	162,068,400	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,400	560.00	3,584,000	
ツルハホールディングス	2,600	14,980.00	38,948,000	
サンマルクホールディングス	900	1,615.00	1,453,500	
フェリシモ	300	1,076.00	322,800	
トリドールホールディングス	3,000	1,227.00	3,681,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,100	296.00	325,600	
ウイルプラスホールディングス	100	571.00	57,100	
ＪＭホールディングス	900	3,525.00	3,172,500	
サツドラホールディングス	200	1,974.00	394,800	
アレンザホールディングス	600	1,346.00	807,600	
串カツ田中ホールディングス	200	1,720.00	344,000	
バロックジャパンリミテッド	800	623.00	498,400	
クスリのアオキホールディングス	1,100	9,900.00	10,890,000	
力の源ホールディングス	500	666.00	333,000	
スシローグローバルホールディングス	6,600	2,450.00	16,170,000	
ＬＩＸＩＬビバ	900	2,593.00	2,333,700	
メディカルシステムネットワーク	1,200	506.00	607,200	
はるやまホールディングス	600	766.00	459,600	
ノジマ	2,100	2,671.00	5,609,100	
カッパ・クリエイト	1,700	1,393.00	2,368,100	
ライトオン	900	597.00	537,300	
ジーンズメイト	300	210.00	63,000	
良品計画	15,900	1,371.00	21,798,900	
三城ホールディングス	1,200	270.00	324,000	
アドヴァン	1,800	1,370.00	2,466,000	
アルビス	500	2,639.00	1,319,500	
コナカ	1,400	299.00	418,600	
ハウス　オブ　ローゼ	100	1,599.00	159,900	
Ｇ－７ホールディングス	700	2,487.00	1,740,900	
イオン北海道	1,600	779.00	1,246,400	
コジマ	2,100	559.00	1,173,900	
ヒマラヤ	400	805.00	322,000	
コーナン商事	1,700	3,770.00	6,409,000	
エコス	400	2,325.00	930,000	
ワタミ	1,400	914.00	1,279,600	
マルシェ	300	505.00	151,500	
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	26,300	2,382.00	62,646,600	
西松屋チェーン	2,600	1,110.00	2,886,000	
ゼンショーホールディングス	5,700	2,108.00	12,015,600	
幸楽苑ホールディングス	800	1,609.00	1,287,200	
ハークスレイ	200	997.00	199,400	

サイゼリヤ	1,800	1,818.00	3,272,400	
ＶＴホールディングス	4,900	339.00	1,661,100	
魚力	300	1,576.00	472,800	
ポプラ	300	409.00	122,700	
フジ・コーポレーション	300	2,001.00	600,300	
ユナイテッドアローズ	1,300	1,605.00	2,086,500	
ハイデイ日高	1,700	1,642.00	2,791,400	
京都きもの友禅	700	243.00	170,100	
コロワイド	4,000	1,399.00	5,596,000	
ピーシーデポコーポレーション	1,600	656.00	1,049,600	
壱番屋	800	5,150.00	4,120,000	
トップカルチャー	400	346.00	138,400	
ＰＬＡＮＴ	300	781.00	234,300	
スギホールディングス	2,400	7,730.00	18,552,000	
薬王堂ホールディングス	500	2,797.00	1,398,500	
ヴィア・ホールディングス	1,500	343.00	514,500	
スクロール	1,800	583.00	1,049,400	
ヨンドシーホールディングス	1,200	1,914.00	2,296,800	
ファミリーマート	8,600	2,360.00	20,296,000	
木曽路	1,600	2,375.00	3,800,000	
ＳＲＳホールディングス	1,400	903.00	1,264,200	
千趣会	2,200	347.00	763,400	
タカキュー	800	125.00	100,000	
リテールパートナーズ	1,600	2,190.00	3,504,000	
ケーヨー	2,500	870.00	2,175,000	
上新電機	1,400	2,240.00	3,136,000	
日本瓦斯	1,900	5,070.00	9,633,000	
ロイヤルホールディングス	2,100	1,742.00	3,658,200	
東天紅	100	956.00	95,600	
いなげや	1,500	1,887.00	2,830,500	
島忠	2,300	2,946.00	6,775,800	
チヨダ	1,300	1,074.00	1,396,200	
ライフコーポレーション	900	4,845.00	4,360,500	
リンガーハット	1,500	2,302.00	3,453,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	1,600	835.00	1,336,000	
テンアライド	1,100	369.00	405,900	
ＡＯＫＩホールディングス	2,400	615.00	1,476,000	
オークワ	1,900	1,562.00	2,967,800	
コメリ	1,800	2,900.00	5,220,000	
青山商事	2,500	646.00	1,615,000	
しまむら	1,400	7,720.00	10,808,000	
はせがわ	600	284.00	170,400	

高島屋	8,700	802.00	6,977,400	
松屋	2,400	673.00	1,615,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	5,700	712.00	4,058,400	
近鉄百貨店	500	2,785.00	1,392,500	
丸井グループ	11,000	1,715.00	18,865,000	
アクシアル　リテイリング	1,000	4,680.00	4,680,000	
井筒屋	600	179.00	107,400	
イオン	46,100	2,552.00	117,647,200	
イズミ	2,400	4,185.00	10,044,000	
平和堂	2,400	2,017.00	4,840,800	
フジ	1,400	1,900.00	2,660,000	
ヤオコー	1,400	8,340.00	11,676,000	
ゼビオホールディングス	1,400	768.00	1,075,200	
ケーズホールディングス	11,600	1,413.00	16,390,800	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	600	953.00	571,800	
日産東京販売ホールディングス	1,700	254.00	431,800	
シルバーライフ	200	1,999.00	399,800	
一家ダイニングプロジェクト	100	589.00	58,900	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	500	3,940.00	1,970,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	565.00	169,500	
ブックオフグループホールディングス	700	799.00	559,300	
アインホールディングス	1,500	6,910.00	10,365,000	
元気寿司	300	2,270.00	681,000	
ヤマダ電機	36,500	485.00	17,702,500	
アークランドサカモト	1,900	1,920.00	3,648,000	
ニトリホールディングス	5,200	22,590.00	117,468,000	
グルメ杵屋	900	972.00	874,800	
愛眼	900	224.00	201,600	
ケーユーホールディングス	600	892.00	535,200	
吉野家ホールディングス	3,900	2,089.00	8,147,100	
松屋フーズホールディングス	600	3,630.00	2,178,000	
サガミホールディングス	1,600	1,226.00	1,961,600	
関西スーパーマーケット	1,000	1,300.00	1,300,000	
王将フードサービス	900	5,810.00	5,229,000	
プレナス	1,300	1,730.00	2,249,000	
ミニストップ	900	1,550.00	1,395,000	
アークス	2,400	2,531.00	6,074,400	
バローホールディングス	2,600	2,299.00	5,977,400	
藤久	100	1,349.00	134,900	
ベルク	600	7,710.00	4,626,000	
大庄	600	1,160.00	696,000	
ファーストリテイリング	1,600	58,650.00	93,840,000	

サンドラッグ	4,500	3,640.00	16,380,000	
サックスバー　ホールディングス	1,000	555.00	555,000	
ヤマザワ	300	1,730.00	519,000	
やまや	200	2,030.00	406,000	
ベルーナ	2,600	768.00	1,996,800	
島根銀行	300	536.00	160,800	
じもとホールディングス	7,900	96.00	758,400	
めぶきフィナンシャルグループ	62,300	255.00	15,886,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,600	1,166.00	1,865,600	
九州フィナンシャルグループ	26,200	454.00	11,894,800	
ゆうちょ銀行	34,000	829.00	28,186,000	
富山第一銀行	2,800	265.00	742,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68,500	343.00	23,495,500	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,000	727.00	5,816,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	6,600	428.00	2,824,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,100	1,357.00	1,492,700	
第四北越フィナンシャルグループ	2,100	2,137.00	4,487,700	
新生銀行	8,800	1,303.00	11,466,400	
あおぞら銀行	7,100	1,914.00	13,589,400	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	820,100	415.80	340,997,580	
りそなホールディングス	130,800	376.30	49,220,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	22,700	2,939.00	66,715,300	
三井住友フィナンシャルグループ	82,900	3,027.00	250,938,300	
千葉銀行	40,000	513.00	20,520,000	
群馬銀行	23,000	350.00	8,050,000	
武蔵野銀行	1,800	1,539.00	2,770,200	
千葉興業銀行	3,300	241.00	795,300	
筑波銀行	4,900	172.00	842,800	
七十七銀行	4,000	1,530.00	6,120,000	
青森銀行	900	2,288.00	2,059,200	
秋田銀行	800	1,508.00	1,206,400	
山形銀行	1,300	1,372.00	1,783,600	
岩手銀行	800	2,627.00	2,101,600	
東邦銀行	10,700	237.00	2,535,900	
東北銀行	600	970.00	582,000	
みちのく銀行	800	1,015.00	812,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,100	1,655.00	16,715,500	
静岡銀行	29,200	699.00	20,410,800	
十六銀行	1,500	1,894.00	2,841,000	
スルガ銀行	12,300	377.00	4,637,100	
八十二銀行	28,900	417.00	12,051,300	
山梨中央銀行	1,400	841.00	1,177,400	

大垣共立銀行	2,400	2,227.00	5,344,800	
福井銀行	1,000	1,688.00	1,688,000	
北國銀行	1,200	2,989.00	3,586,800	
清水銀行	500	1,611.00	805,500	
富山銀行	200	2,359.00	471,800	
滋賀銀行	2,400	2,512.00	6,028,800	
南都銀行	2,000	2,058.00	4,116,000	
百五銀行	10,800	325.00	3,510,000	
京都銀行	4,300	4,050.00	17,415,000	
紀陽銀行	4,200	1,630.00	6,846,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,000	964.00	7,712,000	
広島銀行	17,700	522.00	9,239,400	
山陰合同銀行	7,100	526.00	3,734,600	
中国銀行	10,300	957.00	9,857,100	
鳥取銀行	400	1,163.00	465,200	
伊予銀行	17,100	647.00	11,063,700	
百十四銀行	1,300	1,858.00	2,415,400	
四国銀行	1,800	803.00	1,445,400	
阿波銀行	2,000	2,420.00	4,840,000	
大分銀行	700	2,421.00	1,694,700	
宮崎銀行	800	2,467.00	1,973,600	
佐賀銀行	700	1,249.00	874,300	
沖縄銀行	1,100	3,120.00	3,432,000	
琉球銀行	2,800	954.00	2,671,200	
セブン銀行	40,000	271.00	10,840,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,629,000	139.60	227,408,400	
高知銀行	400	682.00	272,800	
山口フィナンシャルグループ	15,000	668.00	10,020,000	
長野銀行	400	1,119.00	447,600	
名古屋銀行	900	2,430.00	2,187,000	
北洋銀行	18,000	218.00	3,924,000	
愛知銀行	400	2,830.00	1,132,000	
中京銀行	500	2,099.00	1,049,500	
大光銀行	400	1,382.00	552,800	
愛媛銀行	1,700	1,179.00	2,004,300	
トマト銀行	500	1,020.00	510,000	
京葉銀行	5,100	525.00	2,677,500	
栃木銀行	5,700	169.00	963,300	
北日本銀行	400	1,759.00	703,600	
東和銀行	2,100	692.00	1,453,200	
福島銀行	1,100	164.00	180,400	
大東銀行	600	617.00	370,200	

トモニホールディングス	9,300	353.00	3,282,900	
フィデアホールディングス	11,600	101.00	1,171,600	
池田泉州ホールディングス	13,700	165.00	2,260,500	
ＦＰＧ	3,700	539.00	1,994,300	
マーキュリアインベストメント	500	595.00	297,500	
ＳＢＩホールディングス	13,400	2,232.00	29,908,800	
日本アジア投資	1,000	220.00	220,000	
ジャフコ	1,800	3,955.00	7,119,000	
大和証券グループ本社	96,200	478.80	46,060,560	
野村ホールディングス	210,900	485.60	102,413,040	
岡三証券グループ	10,200	349.00	3,559,800	
丸三証券	3,600	435.00	1,566,000	
東洋証券	4,200	112.00	470,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,700	250.00	3,425,000	
光世証券	300	575.00	172,500	
水戸証券	3,400	208.00	707,200	
いちよし証券	2,200	424.00	932,800	
松井証券	6,800	906.00	6,160,800	
マネックスグループ	8,800	240.00	2,112,000	
極東証券	1,600	576.00	921,600	
岩井コスモホールディングス	1,100	1,279.00	1,406,900	
藍澤證券	2,200	703.00	1,546,600	
マネーパートナーズグループ	1,200	213.00	255,600	
スパークス・グループ	5,500	206.00	1,133,000	
小林洋行	300	259.00	77,700	
かんぽ生命保険	4,200	1,478.00	6,207,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	22,500	3,691.00	83,047,500	
アニコム　ホールディングス	1,000	4,460.00	4,460,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	31,300	2,844.00	89,017,200	
第一生命ホールディングス	67,800	1,309.50	88,784,100	
東京海上ホールディングス	42,400	4,762.00	201,908,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	35,800	934.00	33,437,200	
アドバンスクリエイト	200	2,032.00	406,400	
全国保証	3,400	4,015.00	13,651,000	
ジェイリース	300	316.00	94,800	
イントラスト	400	825.00	330,000	
日本モーゲージサービス	200	2,059.00	411,800	
Ｃａｓａ	400	1,136.00	454,400	
アルヒ	1,900	1,509.00	2,867,100	
プレミアグループ	700	1,820.00	1,274,000	
クレディセゾン	8,400	1,099.00	9,231,600	
芙蓉総合リース	1,300	5,950.00	7,735,000	

みずほリース	1,800	2,389.00	4,300,200	
東京センチュリー	2,400	5,920.00	14,208,000	
日本証券金融	5,300	491.00	2,602,300	
アイフル	18,200	226.00	4,113,200	
リコーリース	900	2,907.00	2,616,300	
イオンフィナンシャルサービス	7,300	901.00	6,577,300	
アコム	24,100	391.00	9,423,100	
ジャックス	1,300	1,676.00	2,178,800	
オリエントコーポレーション	32,400	110.00	3,564,000	
日立キャピタル	2,800	2,552.00	7,145,600	
アプラスフィナンシャル	5,600	64.00	358,400	
オリックス	74,400	1,210.50	90,061,200	
三菱ＵＦＪリース	30,400	475.00	14,440,000	
九州リースサービス	600	563.00	337,800	
日本取引所グループ	34,400	2,850.00	98,040,000	
イー・ギャランティ	1,300	2,638.00	3,429,400	
アサックス	600	671.00	402,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	500	1,969.00	984,500	
いちご	15,200	272.00	4,134,400	
日本駐車場開発	11,800	140.00	1,652,000	
スター・マイカ・ホールディングス	600	1,339.00	803,400	
ＡＤワークスグループ	2,200	169.00	371,800	
ヒューリック	25,600	981.00	25,113,600	
三栄建築設計	500	1,295.00	647,500	
野村不動産ホールディングス	7,300	1,907.00	13,921,100	
三重交通グループホールディングス	2,400	473.00	1,135,200	
サムティ	1,700	1,244.00	2,114,800	
ディア・ライフ	1,700	506.00	860,200	
コーセーアールイー	400	501.00	200,400	
日本商業開発	800	1,524.00	1,219,200	
プレサンスコーポレーション	2,000	1,299.00	2,598,000	
ＴＨＥグローバル社	500	216.00	108,000	
ハウスコム	200	1,320.00	264,000	
日本管理センター	800	1,224.00	979,200	
サンセイランディック	400	785.00	314,000	
エストラスト	200	629.00	125,800	
フージャースホールディングス	2,400	549.00	1,317,600	
オープンハウス	3,500	3,120.00	10,920,000	
東急不動産ホールディングス	32,600	444.00	14,474,400	
飯田グループホールディングス	10,000	1,770.00	17,700,000	
イーグランド	200	711.00	142,200	
ムゲンエステート	800	497.00	397,600	

ビーロット	600	623.00	373,800	
ファーストブラザーズ	300	750.00	225,000	
ハウスドゥ	600	835.00	501,000	
シーアールイー	300	1,588.00	476,400	
プロパティエージェント	200	1,056.00	211,200	
ケイアイスター不動産	400	1,835.00	734,000	
アグレ都市デザイン	200	519.00	103,800	
グッドコムアセット	300	1,630.00	489,000	
ジェイ・エス・ビー	300	2,821.00	846,300	
テンポイノベーション	300	635.00	190,500	
グローバル・リンク・マネジメント	200	623.00	124,600	
パーク２４	6,400	1,740.00	11,136,000	
パラカ	300	1,648.00	494,400	
三井不動産	59,100	1,813.50	107,177,850	
三菱地所	84,000	1,586.00	133,224,000	
平和不動産	2,200	2,844.00	6,256,800	
東京建物	12,600	1,209.00	15,233,400	
ダイビル	3,100	1,010.00	3,131,000	
京阪神ビルディング	1,900	1,323.00	2,513,700	
住友不動産	26,900	2,820.50	75,871,450	
テーオーシー	2,400	700.00	1,680,000	
東京楽天地	200	4,050.00	810,000	
レオパレス２１	15,700	183.00	2,873,100	
スターツコーポレーション	1,600	2,165.00	3,464,000	
フジ住宅	1,400	530.00	742,000	
空港施設	1,200	422.00	506,400	
明和地所	700	407.00	284,900	
ゴールドクレスト	900	1,463.00	1,316,700	
エスリード	500	1,373.00	686,500	
日神グループホールディングス	1,800	372.00	669,600	
日本エスコン	2,200	829.00	1,823,800	
タカラレーベン	5,500	355.00	1,952,500	
ＡＶＡＮＴＩＡ	700	872.00	610,400	
イオンモール	6,000	1,348.00	8,088,000	
毎日コムネット	300	764.00	229,200	
ファースト住建	500	992.00	496,000	
ランド	64,000	10.00	640,000	
カチタス	3,000	2,509.00	7,527,000	
トーセイ	1,700	877.00	1,490,900	
穴吹興産	300	1,509.00	452,700	
サンフロンティア不動産	1,700	858.00	1,458,600	
エフ・ジェー・ネクスト	1,000	858.00	858,000	

インテリックス	300	489.00	146,700	
ランドビジネス	400	347.00	138,800	
サンネクスタグループ	400	1,076.00	430,400	
グランディハウス	900	374.00	336,600	
日本空港ビルデング	3,800	4,070.00	15,466,000	
日本工営	800	2,942.00	2,353,600	
ＬＩＦＵＬＬ	4,100	426.00	1,746,600	
ジェイエイシーリクルートメント	800	1,094.00	875,200	
日本M&Aセンター	8,800	4,880.00	42,944,000	
メンバーズ	300	1,446.00	433,800	
中広	200	500.00	100,000	
ＵＴグループ	1,800	2,529.00	4,552,200	
アイティメディア	500	1,764.00	882,000	
タケエイ	1,100	1,073.00	1,180,300	
Ｅ・Ｊホールディングス	200	2,154.00	430,800	
ビーネックスグループ	1,500	1,085.00	1,627,500	
コシダカホールディングス	2,800	404.00	1,131,200	
アルトナー	300	859.00	257,700	
パソナグループ	1,300	1,304.00	1,695,200	
ＣＤＳ	300	1,252.00	375,600	
リンクアンドモチベーション	2,600	352.00	915,200	
ＧＣＡ	1,400	617.00	863,800	
エス・エム・エス	3,600	2,489.00	8,960,400	
サニーサイドアップグループ	400	663.00	265,200	
パーソルホールディングス	11,600	1,438.00	16,680,800	
リニカル	600	847.00	508,200	
クックパッド	4,000	328.00	1,312,000	
エスクリ	400	360.00	144,000	
アイ・ケイ・ケイ	600	530.00	318,000	
学情	400	1,009.00	403,600	
スタジオアリス	600	1,557.00	934,200	
シミックホールディングス	600	1,321.00	792,600	
エプコ	200	1,304.00	260,800	
ＮＪＳ	300	1,741.00	522,300	
綜合警備保障	4,600	5,030.00	23,138,000	
カカクコム	8,600	2,758.00	23,718,800	
アイロムグループ	400	2,327.00	930,800	
セントケア・ホールディング	700	436.00	305,200	
サイネックス	200	684.00	136,800	
ルネサンス	600	903.00	541,800	
ディップ	1,600	2,200.00	3,520,000	
デジタルホールディングス	600	1,422.00	853,200	

新日本科学	1,300	658.00	855,400	
ツクイ	2,700	492.00	1,328,400	
キャリアデザインセンター	300	855.00	256,500	
ベネフィット・ワン	4,200	2,158.00	9,063,600	
エムスリー	25,600	5,110.00	130,816,000	
ツカダ・グローバルホールディング	700	277.00	193,900	
ブラス	200	438.00	87,600	
アウトソーシング	6,600	618.00	4,078,800	
ウェルネット	1,200	618.00	741,600	
ワールドホールディングス	400	1,561.00	624,400	
ディー・エヌ・エー	4,900	1,270.00	6,223,000	
博報堂ＤＹホールディングス	16,200	1,243.00	20,136,600	
ぐるなび	2,000	635.00	1,270,000	
タカミヤ	1,200	540.00	648,000	
ジャパンベストレスキューシステム	900	811.00	729,900	
ファンコミュニケーションズ	3,200	447.00	1,430,400	
ライク	400	1,615.00	646,000	
ビジネス・ブレークスルー	500	374.00	187,000	
エスプール	3,000	723.00	2,169,000	
ＷＤＢホールディングス	500	2,703.00	1,351,500	
手間いらず	100	3,770.00	377,000	
ティア	700	458.00	320,600	
ＣＤＧ	100	1,703.00	170,300	
バリューコマース	700	3,350.00	2,345,000	
インフォマート	12,700	672.00	8,534,400	
ＪＰホールディングス	3,600	272.00	979,200	
エコナックホールディングス	2,000	92.00	184,000	
ＥＰＳホールディングス	1,600	997.00	1,595,200	
レッグス	300	880.00	264,000	
プレステージ・インターナショナル	4,300	878.00	3,775,400	
アミューズ	600	2,130.00	1,278,000	
ドリームインキュベータ	400	1,365.00	546,000	
クイック	700	1,116.00	781,200	
ＴＡＣ	600	195.00	117,000	
ケネディクス	10,800	483.00	5,216,400	
電通グループ	12,000	2,554.00	30,648,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	547.00	218,800	
ぴあ	300	3,060.00	918,000	
イオンファンタジー	400	1,569.00	627,600	
シーティーエス	1,300	836.00	1,086,800	
ネクシィーズグループ	400	856.00	342,400	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	3,200	2,458.00	7,865,600	

アルプス技研	1,000	1,926.00	1,926,000	
サニックス	2,000	267.00	534,000	
ダイオーズ	200	982.00	196,400	
日本空調サービス	1,200	742.00	890,400	
オリエンタルランド	12,400	14,000.00	173,600,000	
ダスキン	2,900	2,735.00	7,931,500	
明光ネットワークジャパン	1,500	771.00	1,156,500	
ファルコホールディングス	600	1,575.00	945,000	
秀英予備校	300	423.00	126,900	
田谷	200	530.00	106,000	
ラウンドワン	3,200	727.00	2,326,400	
リゾートトラスト	5,300	1,327.00	7,033,100	
ビー・エム・エル	1,500	2,706.00	4,059,000	
ワタベウェディング	200	277.00	55,400	
りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,164.00	2,444,400	
リソー教育	5,300	315.00	1,669,500	
早稲田アカデミー	500	975.00	487,500	
ユー・エス・エス	13,000	1,696.00	22,048,000	
東京個別指導学院	400	532.00	212,800	
サイバーエージェント	7,200	5,760.00	41,472,000	
楽天	54,100	1,004.00	54,316,400	
クリーク・アンド・リバー社	600	1,200.00	720,000	
テー・オー・ダブリュー	1,800	288.00	518,400	
山田コンサルティンググループ	800	1,277.00	1,021,600	
セントラルスポーツ	400	2,191.00	876,400	
フルキャストホールディングス	1,200	1,303.00	1,563,600	
エン・ジャパン	2,100	2,832.00	5,947,200	
リソルホールディングス	100	3,485.00	348,500	
テクノプロ・ホールディングス	2,300	5,780.00	13,294,000	
アトラ	200	240.00	48,000	
インターワークス	200	351.00	70,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	500	12,500.00	6,250,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	400	1,711.00	684,400	
ファーストロジック	200	647.00	129,400	
三機サービス	200	1,065.00	213,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	700	799.00	559,300	
デザインワン・ジャパン	300	230.00	69,000	
イー・ガーディアン	500	3,050.00	1,525,000	
リブセンス	700	295.00	206,500	
ジャパンマテリアル	3,600	1,667.00	6,001,200	
ベクトル	1,400	790.00	1,106,000	
ウチヤマホールディングス	600	297.00	178,200	

チャーム・ケア・コーポレーション	1,000	766.00	766,000	
ライクキッズ	200	1,003.00	200,600	
キャリアリンク	400	808.00	323,200	
ＩＢＪ	800	679.00	543,200	
アサンテ	500	1,473.00	736,500	
Ｎ・フィールド	800	471.00	376,800	
バリューＨＲ	500	1,400.00	700,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	900	3,650.00	3,285,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	400	2,240.00	896,000	
ＥＲＩホールディングス	300	612.00	183,600	
アビスト	200	2,695.00	539,000	
シグマクシス	800	1,584.00	1,267,200	
ウィルグループ	800	630.00	504,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,600	296.00	473,600	
リクルートホールディングス	83,200	3,558.00	296,025,600	
エラン	700	1,814.00	1,269,800	
土木管理総合試験所	500	381.00	190,500	
ネットマーケティング	400	565.00	226,000	
日本郵政	95,200	775.70	73,846,640	
ベルシステム２４ホールディングス	1,900	1,747.00	3,319,300	
鎌倉新書	900	842.00	757,800	
ＳＭＮ	200	1,013.00	202,600	
一蔵	100	379.00	37,900	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	400	2,202.00	880,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	200	660.00	132,000	
エアトリ	600	1,114.00	668,400	
アトラエ	400	2,780.00	1,112,000	
ストライク	400	4,725.00	1,890,000	
ソラスト	3,200	1,082.00	3,462,400	
セラク	400	1,318.00	527,200	
インソース	500	2,513.00	1,256,500	
ベイカレント・コンサルティング	700	12,900.00	9,030,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	200	1,662.00	332,400	
アイモバイル	400	728.00	291,200	
キャリアインデックス	500	399.00	199,500	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	400	807.00	322,800	
船場	200	940.00	188,000	
グレイステクノロジー	500	5,690.00	2,845,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,200	3,550.00	4,260,000	
フルテック	200	1,325.00	265,000	
グリーンズ	300	464.00	139,200	
ツナググループ・ホールディングス	200	411.00	82,200	

ＧａｍｅＷｉｔｈ	300	543.00	162,900	
ソウルドアウト	200	2,238.00	447,600	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	200	574.00	114,800	
ミダック	200	1,570.00	314,000	
日総工産	800	629.00	503,200	
キュービーネットホールディングス	500	1,793.00	896,500	
ＲＰＡホールディングス	900	749.00	674,100	
スプリックス	300	696.00	208,800	
マネジメントソリューションズ	500	1,348.00	674,000	
プロレド・パートナーズ	200	5,260.00	1,052,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	100	929.00	92,900	
ギークス	100	1,089.00	108,900	
カーブスホールディングス	3,200	573.00	1,833,600	
フォーラムエンジニアリング	600	747.00	448,200	
アドバンテッジリスクマネジメント	600	825.00	495,000	
リログループ	6,300	1,965.00	12,379,500	
東祥	700	1,199.00	839,300	
エイチ・アイ・エス	1,800	1,556.00	2,800,800	
ラックランド	300	2,220.00	666,000	
共立メンテナンス	1,900	3,405.00	6,469,500	
イチネンホールディングス	1,300	1,164.00	1,513,200	
建設技術研究所	800	1,708.00	1,366,400	
スペース	800	940.00	752,000	
長大	500	1,067.00	533,500	
燦ホールディングス	500	1,205.00	602,500	
スバル興業	100	7,640.00	764,000	
東京テアトル	500	1,203.00	601,500	
タナベ経営	200	1,305.00	261,000	
ナガワ	400	7,610.00	3,044,000	
よみうりランド	300	3,595.00	1,078,500	
東京都競馬	800	4,240.00	3,392,000	
常磐興産	500	1,464.00	732,000	
カナモト	1,900	2,299.00	4,368,100	
東京ドーム	4,700	733.00	3,445,100	
西尾レントオール	1,100	2,170.00	2,387,000	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	7,000	31.00	217,000	
トランス・コスモス	1,100	2,596.00	2,855,600	
乃村工藝社	5,000	808.00	4,040,000	
藤田観光	500	1,529.00	764,500	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	700	919.00	643,300	
日本管財	1,200	2,013.00	2,415,600	
トーカイ	1,100	2,264.00	2,490,400	

白洋舎	100	2,787.00	278,700	
セコム	12,300	9,366.00	115,201,800	
セントラル警備保障	600	3,575.00	2,145,000	
丹青社	2,200	703.00	1,546,600	
メイテック	1,400	5,370.00	7,518,000	
応用地質	1,200	1,449.00	1,738,800	
船井総研ホールディングス	2,400	2,369.00	5,685,600	
進学会ホールディングス	500	421.00	210,500	
オオバ	800	689.00	551,200	
いであ	300	1,831.00	549,300	
学究社	300	1,108.00	332,400	
ベネッセホールディングス	3,900	2,934.00	11,442,600	
イオンディライト	1,400	3,245.00	4,543,000	
ナック	600	930.00	558,000	
ニチイ学館	1,200	1,605.00	1,926,000	
ダイセキ	1,900	2,411.00	4,580,900	
ステップ	400	1,540.00	616,000	
合　計	14,392,000		26,845,238,190	

(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。

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	13,046,656,926
コール・ローン	62,366,485
株式	44,096,852,265
投資証券	1,091,488,777
派生商品評価勘定	512,858,830

	2020年 7月27日現在
未収入金	1,036,403
未収配当金	38,506,389
差入委託証拠金	2,702,643,039
流動資産合計	61,552,409,114
資産合計	61,552,409,114
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,714,632
未払解約金	57,501,000
未払利息	169
流動負債合計	62,215,801
負債合計	62,215,801
純資産の部	
元本等	
元本	46,174,135,861
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,316,057,452
元本等合計	61,490,193,313
純資産合計	61,490,193,313
負債純資産合計	61,552,409,114

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 7月27日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	20,696,961,350円
期中追加設定元本額	67,134,669,045円
期中一部解約元本額	41,657,494,534円
期末元本額	46,174,135,861円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,773,641,367円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	5,642,825,422円
りそなラップ型ファンド（成長型）	4,134,251,270円
ＤＣりそな　グローバルバランス	36,358,347円
つみたてバランスファンド	1,144,518,133円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	669,132,633円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	328,133,054円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	197,046,314円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	12,985,862円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	10,897,128円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	3,819,401円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	6,300,647円
リスクコントロール・オープン	27,838,287円
ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	287,169,265円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	163,101,258円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	20,414,784,997円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	2,995,432,541円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	92,158,169円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	251,486,392円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	268,696,370円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	1,687,766,274円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,228,644,680円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	784,225,961円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	505,044,426円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	1,570,014,671円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	255,520,616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）	5,640,320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）	385,727,212円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,250,163,169円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	40,811,675円
２．　計算日における受益権の総数	
	46,174,135,861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	1.3317円
(10,000口当たり純資産額)	(13,317円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△979,302,733
投資証券	△147,767,061
合計	△1,127,069,794

(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 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	15,751,953,654	－	16,260,097,852	508,144,198
合計		15,751,953,654	－	16,260,097,852	508,144,198

（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。

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	IAC/INTERACTIVECORP	691	125.79	86,920.89	
	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	16.37	117,618.45	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,861	19.04	54,473.44	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	48.99	123,160.86	
	CHEVRON CORP	20,064	90.13	1,808,368.32	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	53.46	96,067.62	
	CONOCOPHILLIPS	11,641	40.28	468,899.48	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	40.73	67,489.61	
	EOG RESOURCES INC	6,306	49.04	309,246.24	
	EXXON MOBIL CORP	45,166	43.43	1,961,559.38	
	HALLIBURTON CO	7,683	14.71	113,016.93	
	HESS CORP	3,020	50.46	152,389.20	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	26.98	46,054.86	
	KINDER MORGAN INC	22,071	14.25	314,511.75	
	MARATHON PETROLEUM CORP	7,066	38.70	273,454.20	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	12.74	38,895.22	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,822	16.74	164,420.28	
	ONEOK INC	4,830	28.72	138,717.60	
	PHILLIPS 66	4,762	65.06	309,815.72	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,821	99.68	181,517.28	
	SCHLUMBERGER LTD	15,077	19.48	293,699.96	
	VALERO ENERGY CORP	4,460	57.98	258,590.80	
	WILLIAMS COS INC	13,196	19.21	253,495.16	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,378	291.52	693,234.56	
	ALBEMARLE CORP	1,183	87.04	102,968.32	
	AMCOR PLC	17,805	10.67	189,979.35	
	AVERY DENNISON CORP	928	120.41	111,740.48	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	22.74	38,339.64	
	BALL CORP	3,574	73.16	261,473.84	

CELANESE CORP	1,332	92.43	123,116.76	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	30.58	47,551.90	
CORTEVA INC	8,263	28.52	235,660.76	
CROWN HOLDINGS INC	1,510	70.70	106,757.00	
DOW INC	8,080	42.61	344,288.80	
DUPONT DE NEMOURS INC	8,014	54.55	437,163.70	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	76.64	95,263.52	
ECOLAB INC	2,752	210.06	578,085.12	
FMC CORP	1,444	107.34	154,998.96	
FREEPORT-MCMORAN INC	16,054	13.12	210,628.48	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,150	36.32	150,728.00	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	708	126.82	89,788.56	
LINDE PLC	5,713	244.07	1,394,371.91	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,955	68.50	202,417.50	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	693	223.65	154,989.45	
MOSAIC CO/THE	3,288	13.67	44,946.96	
NEWMONT CORP	8,719	66.75	581,993.25	
NUCOR CORP	3,362	42.85	144,061.70	
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	102.79	87,165.92	
PPG INDUSTRIES INC	2,581	110.56	285,355.36	
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	79.69	115,231.74	
SEALED AIR CORP	1,397	37.25	52,038.25	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	897	620.02	556,157.94	
STEEL DYNAMICS INC	2,352	27.83	65,456.16	
VULCAN MATERIALS CO	1,473	127.28	187,483.44	
WESTROCK CO	2,274	30.21	68,697.54	
3M CO	6,170	159.84	986,212.80	
AERCAP HOLDINGS NV	853	28.23	24,080.19	
ALLEGION PLC	1,026	101.02	103,646.52	
AMETEK INC	2,517	92.90	233,829.30	
BOEING CO/THE	5,732	173.76	995,992.32	
CARRIER GLOBAL CORP	9,015	26.58	239,618.70	
CATERPILLAR INC	5,909	137.58	812,960.22	
CUMMINS INC	1,639	188.24	308,525.36	
DEERE & CO	3,214	175.35	563,574.90	

DOVER CORP	1,600	105.51	168,816.00	
EATON CORP PLC	4,479	93.61	419,279.19	
EMERSON ELECTRIC CO	6,625	63.36	419,760.00	
FASTENAL CO	6,269	45.74	286,744.06	
FORTIVE CORP	3,320	71.00	235,720.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	71.00	78,384.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,668	150.15	400,600.20	
GENERAL ELECTRIC CO	94,041	6.86	645,121.26	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	35.66	54,345.84	
HEICO CORP	242	95.45	23,098.90	
HEICO CORP-CLASS A	819	75.69	61,990.11	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,631	149.43	1,140,300.33	
HOWMET AEROSPACE INC	3,134	15.55	48,733.70	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	177.06	51,170.34	
IDEX CORP	845	167.67	141,681.15	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,433	184.79	634,384.07	
INGERSOLL-RAND INC	3,920	31.60	123,872.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	83.94	90,571.26	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	40.04	112,112.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	19.72	45,356.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,332	36.80	306,617.60	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,394	171.24	409,948.56	
LENNOX INTERNATIONAL INC	245	265.78	65,116.10	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,720	386.21	1,050,491.20	
MASCO CORP	3,079	54.10	166,573.90	
NORDSON CORP	495	192.23	95,153.85	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,718	312.69	537,201.42	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,485	58.13	260,713.05	
OWENS CORNING	860	61.76	53,113.60	
PACCAR INC	3,778	85.74	323,925.72	
PARKER HANNIFIN CORP	1,404	182.86	256,735.44	
PENTAIR PLC	1,289	42.38	54,627.82	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	16,242	62.07	1,008,140.94	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,269	226.19	287,035.11	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,147	415.27	476,314.69	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	40.42	67,986.44	
SMITH (A.O.) CORP	1,507	51.31	77,324.17	
SNAP-ON INC	437	141.75	61,944.75	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,689	152.91	258,264.99	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	406	308.95	125,433.70	
TEXTRON INC	1,613	34.35	55,406.55	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,613	103.76	271,124.88	
TRANSDIGM GROUP INC	559	425.56	237,888.04	
UNITED RENTALS INC	621	160.88	99,906.48	
WABTEC CORP	2,019	61.87	124,915.53	
WW GRAINGER INC	506	341.39	172,743.34	
XYLEM INC	1,998	74.25	148,351.50	
CINTAS CORP	955	302.60	288,983.00	
COPART INC	2,291	89.52	205,090.32	
COSTAR GROUP INC	421	703.77	296,287.17	
EQUIFAX INC	1,317	167.16	220,149.72	
IHS MARKIT LTD	4,101	79.56	326,275.56	
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	14.93	40,803.69	
REPUBLIC SERVICES INC	2,433	85.03	206,877.99	
ROBERT HALF INTL INC	673	52.73	35,487.29	
ROLLINS INC	1,190	48.68	57,929.20	
TRANSUNION	2,060	89.73	184,843.80	
VERISK ANALYTICS INC	1,675	179.78	301,131.50	
WASTE CONNECTIONS INC	2,855	99.43	283,872.65	
WASTE MANAGEMENT INC	4,563	107.28	489,518.64	
AMERCO	106	316.47	33,545.82	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	86.07	127,900.02	
CSX CORP	8,321	71.34	593,620.14	
DELTA AIR LINES INC	1,316	25.96	34,163.36	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,870	80.19	149,955.30	
FEDEX CORP	2,677	165.04	441,812.08	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	130.79	95,999.86	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,059	154.70	163,827.30	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	45.11	47,094.84	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,778	187.01	519,513.78	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,051	182.24	191,534.24	
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	31.66	28,747.28	
UBER TECHNOLOGIES INC	10,289	31.18	320,811.02	
UNION PACIFIC CORP	7,380	176.12	1,299,765.60	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,523	118.35	890,347.05	
XPO LOGISTICS INC	977	79.25	77,427.25	
APTIV PLC	2,927	82.25	240,745.75	
AUTOLIV INC	743	68.49	50,888.07	
BORGWARNER INC	2,199	38.36	84,353.64	
FORD MOTOR CO	42,318	6.88	291,147.84	
GENERAL MOTORS CO	13,900	26.25	364,875.00	
LEAR CORP	352	116.59	41,039.68	
TESLA INC	1,574	1,417.00	2,230,358.00	
DR HORTON INC	3,907	63.75	249,071.25	
GARMIN LTD	1,303	96.74	126,052.22	
HASBRO INC	1,095	77.59	84,961.05	
LENNAR CORP-A	3,110	69.79	217,046.90	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,355	321.50	435,632.50	
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	85.01	47,945.64	
NEWELL RUBBERMAID INC	2,767	17.14	47,426.38	
NIKE INC -CL B	13,339	98.43	1,312,957.77	
NVR INC	40	3,810.39	152,415.60	
PULTEGROUP INC	2,237	42.62	95,340.94	
RALPH LAUREN CORP	478	71.45	34,153.10	
VF CORP	3,763	59.90	225,403.70	
WHIRLPOOL CORP	714	157.95	112,776.30	
ARAMARK	2,216	22.66	50,214.56	
CARNIVAL CORP	3,704	14.80	54,819.20	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	290	1,130.26	327,775.40	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	78.64	86,739.92	
DOMINO'S PIZZA INC	438	386.91	169,466.58	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,098	77.43	239,878.14	
LAS VEGAS SANDS CORP	3,893	44.36	172,693.48	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,056	87.50	267,400.00	
MCDONALD'S CORP	7,991	198.72	1,587,971.52	

MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	15.25	16,775.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	15.79	72,444.52	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	50.83	79,701.44	
STARBUCKS CORP	12,635	75.78	957,480.30	
VAIL RESORTS INC	293	193.90	56,812.70	
WYNN RESORTS LTD	1,017	73.41	74,657.97	
YUM! BRANDS INC	3,325	93.14	309,690.50	
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,296	79.99	663,597.04	
ALPHABET INC-CL A	3,198	1,508.21	4,823,255.58	
ALPHABET INC-CL C	3,272	1,511.87	4,946,838.64	
ALTICE USA INC- A	2,974	24.09	71,643.66	
CABLE ONE INC	41	1,797.54	73,699.14	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,582	561.72	888,641.04	
COMCAST CORP-CLASS A	48,588	43.35	2,106,289.80	
DISCOVERY INC - A	1,722	21.15	36,420.30	
DISCOVERY INC-C	3,336	18.93	63,150.48	
DISH NETWORK CORP-A	2,183	33.36	72,824.88	
ELECTRONIC ARTS INC	3,153	135.24	426,411.72	
FACEBOOK INC-A	25,641	230.71	5,915,635.11	
FOX CORP - CLASS A	3,877	26.66	103,360.82	
FOX CORP- CLASS B	1,836	26.49	48,635.64	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	18.55	68,430.95	
LIBERTY BROADBAND-A	223	130.63	29,130.49	
LIBERTY BROADBAND-C	1,204	132.77	159,855.08	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	35.08	75,527.24	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	34.41	60,458.37	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	34.27	32,419.42	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	47.92	74,946.88	
MATCH GROUP INC	2,699	90.36	243,881.64	
NETFLIX INC	4,689	480.45	2,252,830.05	
NEWS CORP - CLASS A	2,810	12.71	35,715.10	
OMNICOM GROUP	2,439	56.56	137,949.84	
PINTEREST INC- CLASS A	4,088	24.54	100,319.52	
ROKU INC	1,052	151.17	159,030.84	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.90	61,335.23	

SNAP INC - A	9,678	22.15	214,367.70	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,271	156.02	198,301.42	
TWITTER INC	8,612	37.54	323,294.48	
VIACOMCBS INC - CLASS B	6,314	24.75	156,271.50	
WALT DISNEY CO/THE	19,296	117.61	2,269,402.56	
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	65.72	92,533.76	
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	147.27	86,447.49	
AMAZON.COM INC	4,506	3,008.91	13,558,148.46	
AUTOZONE INC	258	1,168.59	301,496.22	
BEST BUY CO INC	2,568	96.99	249,070.32	
BOOKING HOLDINGS INC	442	1,701.30	751,974.60	
BURLINGTON STORES INC	580	186.92	108,413.60	
CARMAX INC	1,819	97.46	177,279.74	
DOLLAR GENERAL CORP	2,750	191.70	527,175.00	
DOLLAR TREE INC	2,604	95.60	248,942.40	
EBAY INC	8,607	55.12	474,417.84	
EXPEDIA GROUP INC	1,497	83.72	125,328.84	
GENUINE PARTS CO	1,255	88.64	111,243.20	
HOME DEPOT INC	11,640	265.31	3,088,208.40	
LKQ CORP	2,845	27.96	79,546.20	
LOWE'S COS INC	8,214	147.03	1,207,704.42	
MERCADOLIBRE INC	484	988.99	478,671.16	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	815	442.34	360,507.10	
ROSS STORES INC	3,908	86.16	336,713.28	
TARGET CORP	5,458	123.71	675,209.18	
TIFFANY & CO	1,214	121.41	147,391.74	
TJX COMPANIES INC	12,956	52.89	685,242.84	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,305	146.53	191,221.65	
ULTA BEAUTY INC	498	203.71	101,447.58	
WAYFAIR INC- CLASS A	567	222.79	126,321.93	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,723	325.78	1,538,658.94	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	4.23	423.00	
KROGER CO	8,728	34.71	302,948.88	
SYSCO CORP	5,273	54.94	289,698.62	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,179	40.51	331,331.29	

WALMART INC	15,151	131.24	1,988,417.24	
ALTRIA GROUP INC	19,925	41.85	833,861.25	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,088	42.09	256,243.92	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,379	68.00	229,772.00	
BUNGE LTD	1,423	44.33	63,081.59	
CAMPBELL SOUP CO	1,995	49.40	98,553.00	
COCA-COLA CO/THE	43,505	48.49	2,109,557.45	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,555	41.02	63,786.10	
CONAGRA BRANDS INC	5,346	36.61	195,717.06	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,815	179.85	326,427.75	
GENERAL MILLS INC	6,531	64.23	419,486.13	
HERSHEY CO/THE	1,622	145.68	236,292.96	
HORMEL FOODS CORP	3,241	50.27	162,925.07	
INGREDION INC	744	87.35	64,988.40	
JM SMUCKER CO/THE	1,257	108.14	135,931.98	
KELLOGG CO	2,819	68.68	193,608.92	
KEURIG DR PEPPER INC	3,147	30.34	95,479.98	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,334	34.68	254,343.12	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	67.79	88,127.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,348	193.52	260,864.96	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	36.49	53,384.87	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	15,364	54.87	843,022.68	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,374	74.88	327,525.12	
PEPSICO INC	14,832	136.06	2,018,041.92	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,639	76.85	1,278,707.15	
TYSON FOODS INC-CL A	3,241	60.82	197,117.62	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,623	85.87	225,237.01	
CLOROX COMPANY	1,334	227.04	302,871.36	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,654	74.32	643,165.28	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,370	191.75	454,447.50	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,642	147.34	536,612.28	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	26,285	125.96	3,310,858.60	
ABBOTT LABORATORIES	18,821	98.95	1,862,337.95	
ABIOMED INC	494	292.94	144,712.36	
ALIGN TECHNOLOGY INC	815	298.14	242,984.10	

AMERISOURCEBERGEN CORP	1,693	103.76	175,665.68	
ANTHEM INC	2,704	270.49	731,404.96	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,493	89.26	490,305.18	
BECTON DICKINSON AND CO	2,906	271.89	790,112.34	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,005	38.60	579,193.00	
CARDINAL HEALTH INC	3,200	56.50	180,800.00	
CENTENE CORP	6,322	67.51	426,798.22	
CERNER CORP	3,392	71.79	243,511.68	
CIGNA CORP	3,992	181.02	722,631.84	
COOPER COS INC/THE	539	283.58	152,849.62	
CVS HEALTH CORP	13,958	63.34	884,099.72	
DANAHER CORP	6,696	195.27	1,307,527.92	
DAVITA INC	653	87.33	57,026.49	
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	43.24	88,555.52	
DEXCOM INC	987	421.75	416,267.25	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,751	78.13	527,455.63	
HCA HEALTHCARE INC	2,934	125.51	368,246.34	
HENRY SCHEIN INC	1,305	67.03	87,474.15	
HOLOGIC INC	2,888	61.75	178,334.00	
HUMANA INC	1,419	392.14	556,446.66	
IDEXX LABORATORIES INC	923	359.23	331,569.29	
INSULET CORP	689	196.69	135,519.41	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,243	675.33	839,435.19	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,064	198.74	211,459.36	
MASIMO CORP	462	233.46	107,858.52	
MCKESSON CORP	1,755	155.34	272,621.70	
MEDTRONIC PLC	14,324	96.35	1,380,117.40	
MOLINA HEALTHCARE INC	546	184.25	100,600.50	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,464	124.99	182,985.36	
RESMED INC	1,566	202.44	317,021.04	
STERIS PLC	740	156.35	115,699.00	
STRYKER CORP	3,616	198.83	718,969.28	
TELADOC HEALTH INC	632	212.85	134,521.20	
TELEFLEX INC	508	387.66	196,931.28	
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,112	300.79	3,041,588.48	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	108.08	70,576.24	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	994	127.16	126,397.04	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,428	251.95	359,784.60	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	808	262.66	212,229.28	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,240	134.11	300,406.40	
ABBVIE INC	18,852	97.11	1,830,717.72	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,370	94.81	319,509.70	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,406	101.49	244,184.94	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,233	153.10	188,772.30	
AMGEN INC	6,299	247.98	1,562,026.02	
AVANTOR INC	3,867	18.48	71,462.16	
BEIGENE LTD-ADR	500	224.44	112,220.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	515.75	126,874.50	
BIOGEN INC	1,873	272.33	510,074.09	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,957	122.95	240,613.15	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24,116	57.85	1,395,110.60	
CATALENT INC	1,400	81.64	114,296.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,830	23.59	90,349.70	
ELI LILLY & CO	9,193	159.54	1,466,651.22	
EXACT SCIENCES CORP	1,627	95.39	155,199.53	
GILEAD SCIENCES INC	13,520	73.64	995,612.80	
ILLUMINA INC	1,579	382.25	603,572.75	
INCYTE CORP	2,012	99.42	200,033.04	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	958	58.95	56,474.10	
IQVIA HOLDINGS INC	2,091	157.88	330,127.08	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	406	112.89	45,833.34	
JOHNSON & JOHNSON	28,077	148.12	4,158,765.24	
MERCK & CO. INC.	27,061	77.10	2,086,403.10	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	263	862.72	226,895.36	
MODERNA INC	2,441	73.21	178,705.61	
MYLAN NV	4,542	15.96	72,490.32	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	125.20	120,692.80	
PERKINELMER INC	1,224	110.37	135,092.88	
PERRIGO CO PLC	998	55.80	55,688.40	
PFIZER INC	59,057	37.66	2,224,086.62	

REGENERON PHARMACEUTICALS	1,082	608.94	658,873.08	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	158.63	128,966.19	
SEATTLE GENETICS INC	1,315	168.81	221,991.72	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	11.49	147,290.31	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,259	406.38	1,730,772.42	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,778	278.49	773,645.22	
WATERS CORP	535	223.05	119,331.75	
ZOETIS INC	5,094	144.22	734,656.68	
BANK OF AMERICA CORP	83,806	24.35	2,040,676.10	
CITIGROUP INC	22,512	51.67	1,163,195.04	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	25.58	92,599.60	
COMERICA INC	1,325	37.42	49,581.50	
EAST WEST BANCORP INC	1,540	35.61	54,839.40	
FIFTH THIRD BANCORP	7,761	19.54	151,649.94	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,868	114.82	214,483.76	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	9.60	86,323.20	
JPMORGAN CHASE & CO	32,764	98.28	3,220,045.92	
KEYCORP	8,597	12.25	105,313.25	
M & T BANK CORP	1,428	105.13	150,125.64	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	12.00	41,076.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,656	106.84	497,447.04	
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	10.92	94,731.00	
SIGNATURE BANK	590	109.59	64,658.10	
SVB FINANCIAL GROUP	416	230.43	95,858.88	
TRUIST FINANCIAL CORP	14,419	37.74	544,173.06	
US BANCORP	14,716	36.92	543,314.72	
WELLS FARGO & CO	41,644	26.26	1,093,571.44	
ZIONS BANCORPORATION	1,197	33.63	40,255.11	
ALLY FINANCIAL INC	3,571	21.18	75,633.78	
AMERICAN EXPRESS CO	7,407	95.33	706,109.31	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,374	155.26	213,327.24	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	52.02	80,891.10	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,766	36.23	317,592.18	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	14,800	194.52	2,878,896.00	
BLACKROCK INC	1,639	570.62	935,246.18	

BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	7,338	55.70	408,726.60	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,016	65.06	326,340.96	
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	28.71	35,887.50	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	89.46	110,840.94	
CME GROUP INC	3,868	168.75	652,725.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	50.82	142,296.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	51.77	100,589.11	
EQUITABLE HOLDINGS INC	2,938	20.30	59,641.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	347.94	119,691.36	
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	20.60	56,402.80	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,540	201.47	713,203.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,988	96.32	576,764.16	
INVESCO LTD	2,612	10.44	27,269.28	
KKR & CO INC	5,635	34.69	195,478.15	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	421	505.81	212,946.01	
MOODY'S CORP	1,827	289.68	529,245.36	
MORGAN STANLEY	12,955	50.18	650,081.90	
MSCI INC	928	385.65	357,883.20	
NASDAQ INC	1,296	130.56	169,205.76	
NORTHERN TRUST CORP	2,230	76.03	169,546.90	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	72.12	75,942.36	
S&P GLOBAL INC	2,621	349.97	917,271.37	
SCHWAB (CHARLES) CORP	12,586	34.94	439,754.84	
SEI INVESTMENTS COMPANY	896	52.97	47,461.12	
STATE STREET CORP	3,914	62.35	244,037.90	
SYNCHRONY FINANCIAL	6,195	23.56	145,954.20	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,586	133.97	346,446.42	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,033	37.77	114,556.41	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	54.49	39,995.66	
VOYA FINANCIAL INC	845	49.19	41,565.55	
AFLAC INC	7,568	36.77	278,275.36	
ALLEGHANY CORP	101	537.00	54,237.00	
ALLSTATE CORP	3,471	94.36	327,523.56	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	61.90	48,034.40	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,607	31.31	300,795.17	

AON PLC	2,512	207.17	520,411.04	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,552	30.85	140,429.20	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,097	103.93	217,941.21	
ASSURANT INC	506	106.79	54,035.74	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	33.39	42,405.30	
BROWN & BROWN INC	2,686	45.40	121,944.40	
CHUBB LTD	4,881	134.91	658,495.71	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	83.23	144,320.82	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	206.25	30,112.50	
EVEREST RE GROUP LTD	313	224.01	70,115.13	
FNF GROUP	3,124	33.39	104,310.36	
GLOBE LIFE INC	921	80.37	74,020.77	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,020	41.48	166,749.60	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	37.21	76,652.60	
LOEWS CORP	2,906	36.87	107,144.22	
MARKEL CORP	155	1,015.44	157,393.20	
MARSH & MCLENNAN COS	5,447	114.62	624,335.14	
METLIFE INC	8,537	38.22	326,284.14	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	44.77	109,641.73	
PROGRESSIVE CORP	6,345	87.86	557,471.70	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,378	64.91	284,175.98	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	87.29	41,026.30	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	180.14	101,238.68	
TRAVELERS COS INC/THE	2,795	118.28	330,592.60	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,416	211.52	299,512.32	
WR BERKLEY CORP	1,291	63.96	82,572.36	
CBRE GROUP INC - A	3,058	43.16	131,983.28	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	8,400	3.88	32,592.00	
JONES LANG LASALLE INC	468	100.06	46,828.08	
ACCENTURE PLC-CL A	6,783	221.44	1,502,027.52	
ADOBE INC	5,143	430.31	2,213,084.33	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,773	111.74	198,115.02	
ANSYS INC	933	293.51	273,844.83	
AUTODESK INC	2,364	232.88	550,528.32	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,632	145.43	673,631.76	

AVALARA INC	656	123.93	81,298.08	
BLACK KNIGHT INC	1,644	73.17	120,291.48	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	74.34	114,557.94	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,262	131.28	165,675.36	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,037	102.59	311,565.83	
CDK GLOBAL INC	1,236	43.95	54,322.20	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,222	123.48	150,892.56	
CITRIX SYSTEMS INC	1,273	142.49	181,389.77	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,936	61.80	366,844.80	
COUPA SOFTWARE INC	728	292.11	212,656.08	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	916	100.03	91,627.48	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	279	113.52	31,672.08	
DATADOG INC - CLASS A	933	84.84	79,155.72	
DOCUSIGN INC	1,842	190.95	351,729.90	
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	21.35	57,538.25	
DYNATRACE INC	1,119	41.28	46,192.32	
EPAM SYSTEMS INC	480	274.10	131,568.00	
FAIR ISAAC CORP	258	414.33	106,897.14	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,599	143.70	948,276.30	
FISERV INC	6,206	100.63	624,509.78	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	930	258.08	240,014.40	
FORTINET INC	1,600	133.04	212,864.00	
GARTNER INC	792	124.69	98,754.48	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,221	172.63	556,041.23	
GODADDY INC - CLASS A	1,543	68.61	105,865.23	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	116.64	105,909.12	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9,501	125.79	1,195,130.79	
INTUIT INC	2,790	288.68	805,417.20	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	179.59	151,394.37	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,476	91.07	134,419.32	
MASTERCARD INC-CLASS A	9,541	306.92	2,928,323.72	
MICROSOFT CORP	76,921	201.30	15,484,197.30	
MONGODB INC	444	204.64	90,860.16	
NORTONLIFELOCK INC	6,268	20.38	127,773.18	
OKTA INC	1,233	205.64	253,554.12	

ORACLE CORP	23,992	55.65	1,335,154.80	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,084	243.77	264,246.68	
PAYCHEX INC	3,506	72.19	253,098.14	
PAYCOM SOFTWARE INC	550	286.97	157,833.50	
PAYPAL HOLDINGS INC	11,889	172.56	2,051,565.84	
PTC INC	1,110	81.46	90,420.60	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	788	268.25	211,381.00	
SALESFORCE.COM INC	8,995	188.49	1,695,467.55	
SERVICENOW INC	2,033	425.19	864,411.27	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	2,725	29.72	80,987.00	
SPLUNK INC	1,688	199.57	336,874.16	
SQUARE INC - A	3,819	121.41	463,664.79	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	55.75	111,555.75	
SYNOPSYS INC	1,626	193.37	314,419.62	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	447	426.07	190,453.29	
TWILIO INC - A	1,283	248.29	318,556.07	
TYLER TECHNOLOGIES INC	433	357.19	154,663.27	
VERISIGN INC	1,141	208.53	237,932.73	
VISA INC-CLASS A SHARES	18,183	195.15	3,548,412.45	
VMWARE INC-CLASS A	730	140.82	102,798.60	
WESTERN UNION CO	2,957	22.47	66,443.79	
WIX.COM LTD	591	267.47	158,074.77	
WORKDAY INC-CLASS A	1,806	182.78	330,100.68	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	1,174	246.56	289,461.44	
AMPHENOL CORP-CL A	3,259	104.39	340,207.01	
APPLE INC	46,585	370.46	17,257,879.10	
ARISTA NETWORKS INC	519	236.81	122,904.39	
ARROW ELECTRONICS INC	902	67.35	60,749.70	
CDW CORP/DE	1,592	114.56	182,379.52	
CISCO SYSTEMS INC	45,313	46.40	2,102,523.20	
COGNEX CORP	1,928	64.22	123,816.16	
CORNING INC	8,440	29.29	247,207.60	
DELL TECHNOLOGIES -C	2,187	60.80	132,969.60	
F5 NETWORKS INC	613	152.34	93,384.42	
FLIR SYSTEMS INC	1,041	40.97	42,649.77	

HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	14,447	9.62	138,980.14	
HP INC	15,754	17.50	275,695.00	
IPG PHOTONICS CORP	259	175.29	45,400.11	
JUNIPER NETWORKS INC	2,337	24.48	57,209.76	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,082	96.85	201,641.70	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,879	141.73	266,310.67	
NETAPP INC	2,471	43.20	106,747.20	
SEAGATE TECHNOLOGY	2,020	48.04	97,040.80	
TE CONNECTIVITY LTD	3,659	87.27	319,320.93	
TRIMBLE INC	2,244	44.03	98,803.32	
WESTERN DIGITAL CORP	2,541	42.85	108,881.85	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	603	269.98	162,797.94	
AT&T INC	76,714	29.57	2,268,432.98	
CENTURYLINK INC	7,172	10.09	72,365.48	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	22.46	29,332.76	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	22.11	77,451.33	
T-MOBILE US INC	5,997	104.93	629,265.21	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	44,223	56.85	2,514,077.55	
AES CORP	7,346	15.40	113,128.40	
ALLIANT ENERGY CORP	2,711	53.12	144,008.32	
AMEREN CORPORATION	2,709	79.52	215,419.68	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,339	88.05	470,098.95	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,977	144.52	285,716.04	
ATMOS ENERGY CORP	1,353	103.00	139,359.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	19.74	78,012.48	
CMS ENERGY CORP	3,133	63.53	199,039.49	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,643	75.58	275,337.94	
DOMINION ENERGY INC	9,007	80.41	724,252.87	
DTE ENERGY COMPANY	2,108	114.57	241,513.56	
DUKE ENERGY CORP	7,883	82.79	652,633.57	
EDISON INTERNATIONAL	3,980	56.02	222,959.60	
ENTERGY CORP	2,195	102.66	225,338.70	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	45.70	112,650.50	
EVERGY INC	2,522	64.06	161,559.32	
EVERSOURCE ENERGY	3,590	89.48	321,233.20	

	EXELON CORP	10,548	37.80	398,714.40	
	FIRSTENERGY CORP	5,919	29.48	174,492.12	
	NEXTERA ENERGY INC	5,230	280.25	1,465,707.50	
	NISOURCE INC	4,230	24.54	103,804.20	
	NRG ENERGY INC	1,800	34.19	61,542.00	
	OGE ENERGY CORP	1,432	32.97	47,213.04	
	PINNACLE WEST CAPITAL	828	81.38	67,382.64	
	PPL CORP	8,432	25.71	216,786.72	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,507	52.27	287,850.89	
	SEMPRA ENERGY	3,167	125.62	397,838.54	
	SOUTHERN CO/THE	11,345	54.85	622,273.25	
	UGI CORP	1,566	32.83	51,411.78	
	VISTRA CORP	4,854	18.88	91,643.52	
	WEC ENERGY GROUP INC	3,432	93.59	321,200.88	
	XCEL ENERGY INC	5,688	67.88	386,101.44	
	ADVANCED MICRO DEVICES	12,498	69.40	867,361.20	
	ANALOG DEVICES INC	3,940	112.21	442,107.40	
	APPLIED MATERIALS INC	9,816	60.62	595,045.92	
	BROADCOM INC	4,260	305.79	1,302,665.40	
	INTEL CORP	45,561	50.59	2,304,930.99	
	KLA CORP	1,682	188.21	316,569.22	
	LAM RESEARCH CORP	1,557	345.72	538,286.04	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,213	34.99	252,382.87	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,911	67.13	195,415.43	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,575	100.21	258,040.75	
	MICRON TECHNOLOGY INC	11,877	50.02	594,087.54	
	NVIDIA CORP	6,520	407.78	2,658,725.60	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,992	115.75	346,324.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	20.47	65,483.53	
	QORVO INC	1,251	111.92	140,011.92	
	QUALCOMM INC	12,193	88.89	1,083,835.77	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,831	131.61	240,977.91	
	TERADYNE INC	1,812	83.53	151,356.36	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	9,960	129.63	1,291,114.80	
	XILINX INC	2,675	102.66	274,615.50	

米ドル 小計		3,097,648		295,064,912.23 (31,223,769,012)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	16.00	39,424.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	13,084	24.39	319,118.76	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	6.73	69,568.01	
	ENBRIDGE INC	21,825	41.96	915,777.00	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	22.43	64,531.11	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	12.93	44,880.03	
	KEYERA CORP	2,259	20.88	47,167.92	
	PARKLAND CORP	1,790	34.77	62,238.30	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,181	33.39	206,383.59	
	SUNCOR ENERGY INC	16,785	22.42	376,319.70	
	TC ENERGY CORP	10,192	60.29	614,475.68	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,708	96.41	261,078.28	
	B2GOLD CORP	10,119	8.76	88,642.44	
	BARRICK GOLD CORP	19,312	38.18	737,332.16	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	44.28	74,080.44	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	12.06	51,701.22	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,082	212.99	443,445.18	
	KINROSS GOLD CORP	10,281	11.30	116,175.30	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	64.74	203,348.34	
	LUNDIN MINING CORP	7,300	7.96	58,108.00	
	NUTRIEN LTD	6,406	44.00	281,864.00	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	49.25	100,962.50	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,246	15.01	48,722.46	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,994	71.93	359,218.42	
	YAMANA GOLD INC	9,288	8.47	78,669.36	
	CAE INC	3,196	19.73	63,057.08	
	WSP GLOBAL INC	1,340	82.85	111,019.00	
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,068	59.17	63,193.56	
	THOMSON REUTERS CORP	1,971	91.62	180,583.02	
	AIR CANADA	840	16.47	13,834.80	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	7,691	129.53	996,215.23	
	CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,489	367.70	547,505.30	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	3,272	64.11	209,767.92	

GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	22.39	40,302.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	3,265	76.31	249,152.15	
QUEBECOR INC -CL B	1,274	29.11	37,086.14	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	23.71	135,882.01	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	119.92	59,960.00	
DOLLARAMA INC	3,451	47.29	163,197.79	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,538	45.83	437,126.54	
EMPIRE CO LTD 'A'	864	34.75	30,024.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	69.13	146,140.82	
METRO INC	2,930	58.36	170,994.80	
WESTON (GEORGE) LTD	817	103.47	84,534.99	
SAPUTO INC	1,654	32.12	53,126.48	
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	22.88	74,977.76	
CANOPY GROWTH CORP	1,137	22.12	25,150.44	
CRONOS GROUP INC	1,000	8.48	8,480.00	
BANK OF MONTREAL	6,950	73.73	512,423.50	
BANK OF NOVA SCOTIA	13,091	55.55	727,205.05	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,853	93.38	453,173.14	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,743	62.09	232,402.87	
ROYAL BANK OF CANADA	15,266	93.72	1,430,729.52	
TORONTO-DOMINION BANK	19,449	60.58	1,178,220.42	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	14,601	44.97	656,606.97	
CI FINANCIAL CORP	775	18.21	14,112.75	
IGM FINANCIAL INC	81	33.24	2,692.44	
ONEX CORPORATION	908	60.32	54,770.56	
TMX GROUP LTD	540	140.85	76,059.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	425.35	138,664.10	
GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	23.91	44,137.86	
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	44.73	56,091.42	
INTACT FINANCIAL CORP	1,647	137.36	226,231.92	
MANULIFE FINANCIAL CORP	21,582	18.68	403,151.76	
POWER CORP OF CANADA	4,873	23.91	116,513.43	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,585	53.20	350,322.00	
BLACKBERRY LTD	1,407	6.23	8,765.61	
CGI INC	2,689	86.69	233,109.41	

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	221	1,546.32	341,736.72	
	OPEN TEXT CORP	3,074	59.71	183,548.54	
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,120	1,247.01	1,396,651.20	
	BCE INC	1,116	55.88	62,362.08	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,128	54.33	224,274.24	
	TELUS CORP	4,085	22.91	93,587.35	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	4,426	17.78	78,694.28	
	ALTAGAS LTD	2,930	16.73	49,018.90	
	ATCO LTD -CLASS I	863	40.51	34,960.13	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	33.43	32,995.41	
	EMERA INC	2,818	54.27	152,932.86	
	FORTIS INC	5,178	52.56	272,155.68	
	HYDRO ONE LTD	2,283	27.67	63,170.61	
カナダドル 小計		394,066		19,466,015.76 (1,538,009,905)	
ユーロ	ENI SPA	27,906	8.52	237,759.12	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	10.35	76,693.50	
	NESTE OYJ	4,759	41.39	196,975.01	
	OMV AG	1,475	29.56	43,601.00	
	REPSOL SA	16,357	7.39	120,878.23	
	TENARIS SA	5,062	5.63	28,509.18	
	TOTAL SE	26,503	32.65	865,322.95	
	VOPAK	762	47.57	36,248.34	
	AIR LIQUIDE SA	5,102	139.10	709,688.20	
	AKZO NOBEL	2,205	82.02	180,854.10	
	ARCELORMITTAL	8,506	9.87	83,996.75	
	ARKEMA	822	88.56	72,796.32	
	BASF SE	10,010	52.20	522,522.00	
	COVESTRO AG	1,223	35.95	43,966.85	
	CRH PLC	8,512	32.81	279,278.72	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	24.42	43,785.06	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	37.84	2,119.04	
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	52.28	72,250.96	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,888	130.30	246,006.40	
	LANXESS AG	745	46.98	35,000.10	

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	27.00	61,722.00	
SOLVAY SA	925	70.60	65,305.00	
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	11.18	62,792.59	
SYMRISE AG	1,484	107.25	159,159.00	
THYSSENKRUPP AG	2,040	7.11	14,512.56	
UMICORE	2,388	44.77	106,910.76	
UPM-KYMMENE OYJ	6,116	24.63	150,637.08	
VOESTALPINE AG	712	19.41	13,819.92	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	22.28	64,055.00	
AIRBUS SE	6,372	63.93	407,361.96	
ALSTOM	2,236	49.36	110,368.96	
ANDRITZ AG	1,260	31.34	39,488.40	
BOUYGUES SA	1,779	31.41	55,878.39	
BRENNTAG AG	1,535	54.60	83,811.00	
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	6.45	61,913.04	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,754	33.32	191,723.28	
DASSAULT AVIATION SA	11	782.00	8,602.00	
EIFFAGE	782	77.80	60,839.60	
FERROVIAL SA	5,381	22.40	120,534.40	
GEA GROUP AG	1,676	32.28	54,101.28	
HOCHTIEF AG	17	78.00	1,326.00	
KINGSPAN GROUP PLC	1,226	63.30	77,605.80	
KION GROUP AG	740	70.00	51,800.00	
KNORR-BREMSE AG	297	106.60	31,660.20	
KONE OYJ-B	3,785	66.46	251,551.10	
LEGRAND SA	2,956	70.38	208,043.28	
LEONARDO SPA	3,148	6.14	19,341.31	
MTU AERO ENGINES AG	622	147.60	91,807.20	
PRYSMIAN SPA	2,867	22.85	65,510.95	
SAFRAN SA	3,499	88.54	309,801.46	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,966	99.18	591,707.88	
SIEMENS AG-REG	8,245	112.20	925,089.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	19.08	43,780.99	
THALES SA	1,244	66.80	83,099.20	
VINCI SA	5,581	79.40	443,131.40	

WARTSILA OYJ ABP	2,705	7.45	20,157.66	
BUREAU VERITAS SA	2,067	20.20	41,753.40	
RANDSTAD NV	825	43.14	35,590.50	
TELEPERFORMANCE	652	237.60	154,915.20	
WOLTERS KLUWER	2,960	67.36	199,385.60	
ADP	314	91.00	28,574.00	
AENA SME SA	754	116.00	87,464.00	
ATLANTIA SPA	3,792	13.57	51,457.44	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	8.20	11,537.40	
DEUTSCHE POST AG-REG	10,833	34.70	375,905.10	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	35.94	13,836.90	
GETLINK	4,655	13.30	61,911.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,692	60.45	223,181.40	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	46.96	29,068.24	
CONTINENTAL AG	1,275	90.30	115,132.50	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,370	40.04	375,221.65	
FAURECIA	800	34.75	27,800.00	
FERRARI NV	1,388	154.50	214,446.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,480	9.07	113,268.48	
MICHELIN (CGDE)	1,878	92.38	173,489.64	
PEUGEOT SA	5,130	14.83	76,103.55	
PIRELLI & C SPA	1,734	3.61	6,275.34	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	53.66	95,246.50	
RENAULT SA	1,817	25.24	45,861.08	
VALEO SA	2,418	22.68	54,840.24	
VOLKSWAGEN AG	194	150.10	29,119.40	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,047	141.12	288,872.64	
ADIDAS AG	2,090	239.50	500,555.00	
ESSILORLUXOTTICA	3,129	114.80	359,209.20	
HERMES INTERNATIONAL	353	741.60	261,784.80	
KERING	831	495.00	411,345.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,986	399.10	1,191,712.60	
MONCLER SPA	2,414	33.62	81,158.68	
PUMA SE	750	66.70	50,025.00	
SEB SA	151	146.40	22,106.40	

ACCOR SA	2,330	22.62	52,704.60	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,706	126.00	214,956.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	27.24	21,955.44	
SODEXO	1,088	60.24	65,541.12	
ALTICE EUROPE NV	7,300	3.70	27,031.90	
BOLLORE	3,240	2.95	9,583.92	
JC DECAUX SA	60	15.15	909.00	
PUBLICIS GROUPE	1,962	29.65	58,173.30	
SCOUT24 AG	1,002	74.45	74,598.90	
SES	2,232	6.13	13,686.62	
TELENET GROUP HOLDING NV	192	36.48	7,004.16	
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	71.04	77,788.80	
VIVENDI	9,266	22.75	210,801.50	
DELIVERY HERO SE	1,478	90.00	133,020.00	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,861	22.88	271,379.68	
JUST EAT TAKEAWAY	1,360	89.84	122,182.40	
PROSUS NV	5,265	82.20	432,783.00	
ZALANDO SE	1,415	63.36	89,654.40	
CARREFOUR SA	7,042	13.55	95,419.10	
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	26.90	16,812.50	
COLRUYT SA	290	49.05	14,224.50	
JERONIMO MARTINS	2,258	14.37	32,458.75	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	11,963	25.00	299,075.00	
METRO AG	1,970	8.63	17,005.04	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,347	46.96	392,016.85	
DANONE	6,690	60.74	406,350.60	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	3,500	8.16	28,577.50	
HEINEKEN HOLDING NV	1,282	74.80	95,893.60	
HEINEKEN NV	2,819	82.88	233,638.72	
KERRY GROUP PLC-A	1,722	108.70	187,181.40	
PERNOD RICARD SA	2,311	144.25	333,361.75	
REMY COINTREAU	264	135.00	35,640.00	
BEIERSDORF AG	1,128	101.70	114,717.60	
HENKEL AG & CO KGAA	966	75.60	73,029.60	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,965	85.82	168,636.30	

L'OREAL	2,682	284.90	764,101.80	
UNILEVER NV	15,554	50.54	786,099.16	
BIOMERIEUX	402	129.30	51,978.60	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	88.15	21,596.75	
DIASORIN SPA	256	162.70	41,651.20	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,391	76.50	182,911.50	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,660	44.24	206,158.40	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,839	44.60	438,868.59	
ORPEA	501	108.00	54,108.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	339	327.00	110,853.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	43.82	68,498.47	
BAYER AG-REG	10,613	60.76	644,845.88	
EUROFINS SCIENTIFIC	153	554.80	84,884.40	
GALAPAGOS NV	507	167.60	84,973.20	
GRIFOLS SA	3,329	25.09	83,524.61	
IPSEN	158	78.20	12,355.60	
MERCK KGAA	1,467	111.80	164,010.60	
ORION OYJ-CLASS B	739	43.40	32,072.60	
QIAGEN N.V.	2,679	41.85	112,116.15	
RECORDATI SPA	830	46.96	38,976.80	
SANOFI	12,084	88.81	1,073,180.04	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	259.60	77,360.80	
UCB SA	1,446	109.95	158,987.70	
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	7.69	29,283.36	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	72,029	3.11	224,514.39	
BANCO SANTANDER SA	178,371	2.12	379,216.74	
BANKINTER SA	2,829	4.63	13,101.09	
BNP PARIBAS	12,137	37.14	450,768.18	
CAIXABANK S.A	25,249	2.10	53,199.64	
COMMERZBANK AG	5,632	4.57	25,743.87	
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	8.90	90,469.64	
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	21.10	82,733.10	
FINECOBANK SPA	7,003	12.82	89,778.46	
ING GROEP NV-CVA	42,087	6.39	268,978.01	
INTESA SANPAOLO	162,128	1.81	294,327.17	

KBC GROEP NV	2,393	52.52	125,680.36	
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.08	48,547.56	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	15.97	19,419.52	
SOCIETE GENERALE SA	9,028	14.69	132,621.32	
UNICREDIT SPA	23,350	8.68	202,701.35	
AMUNDI SA	618	70.90	43,816.20	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22,388	8.24	184,544.28	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,100	166.50	349,650.00	
EURAZEO	403	45.66	18,400.98	
EXOR NV	1,318	49.55	65,306.90	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,384	75.00	103,800.00	
NATIXIS	3,105	2.21	6,874.47	
SOFINA	168	233.00	39,144.00	
WENDEL	294	80.45	23,652.30	
AEGON NV	16,557	2.65	43,876.05	
AGEAS	1,697	33.05	56,085.85	
ALLIANZ SE-REG	4,511	183.76	828,941.36	
ASSICURAZIONI GENERALI	10,310	13.59	140,112.90	
AXA SA	21,127	17.90	378,342.31	
CNP ASSURANCES	1,015	10.54	10,698.10	
HANNOVER RUECK SE	718	151.70	108,920.60	
MAPFRE SA	942	1.64	1,544.88	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,592	233.60	371,891.20	
NN GROUP NV	2,804	31.94	89,559.76	
POSTE ITALIANE SPA	5,374	8.14	43,787.35	
SAMPO OYJ-A SHS	5,388	32.77	176,564.76	
SCOR SE	1,565	23.50	36,777.50	
AROUNDTOWN SA	10,475	4.92	51,557.95	
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,021	40.87	164,338.27	
LEG IMMOBILIEN AG	667	116.60	77,772.20	
VONOVIA SE	5,762	54.42	313,568.04	
ADYEN NV	195	1,355.00	264,225.00	
AMADEUS IT GROUP SA	4,673	46.23	216,032.79	
ATOS SE	1,004	75.00	75,300.00	
CAPGEMINI SA	1,778	104.00	184,912.00	

DASSAULT SYSTEMES SA	1,443	145.80	210,389.40	
EDENRED	2,756	43.30	119,334.80	
NEMETSCHEK SE	536	62.75	33,634.00	
NEXI SPA	3,732	14.97	55,886.70	
SAP SE	11,190	135.44	1,515,573.60	
TEAMVIEWER AG	1,207	45.82	55,304.74	
WORLDLINE SA	1,544	73.74	113,854.56	
INGENICO GROUP	708	138.50	98,058.00	
NOKIA OYJ	63,040	3.72	234,760.96	
CELLNEX TELECOM SA	2,835	58.42	165,620.70	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	36,498	14.90	543,820.20	
ELISA OYJ	1,241	52.50	65,152.50	
ILIAD SA	98	176.40	17,287.20	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	8.97	22,186.20	
KONINKLIJKE KPN NV	41,469	2.39	99,359.72	
ORANGE	22,373	10.64	238,048.72	
PROXIMUS	918	17.98	16,510.23	
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.38	27,498.76	
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.37	26,968.62	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.48	31,325.52	
TELEFONICA SA	54,127	3.86	209,254.98	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	39.58	30,318.28	
(Right)EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL-RTS	23,881	0.10	2,390.48	
E.ON SE	24,963	10.34	258,117.42	
EDF	6,102	9.48	57,846.96	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	23,881	4.44	106,246.56	
ELIA GROUP SA/NV	345	94.30	32,533.50	
ENAGAS SA	2,667	22.00	58,674.00	
ENDESA SA	3,177	23.88	75,866.76	
ENEL SPA	87,598	7.94	695,878.51	
ENGIE	20,132	10.92	219,841.44	
FORTUM OYJ	3,981	18.03	71,777.43	
IBERDROLA SA	63,685	11.04	703,400.82	
NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	16.65	35,724.97	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.86	82,732.02	

	RWE AG	6,560	32.89	215,758.40	
	SNAM SPA	23,547	4.62	108,951.96	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	10.26	23,044.92	
	TERNA SPA	16,305	6.29	102,656.28	
	UNIPER SE	1,464	29.94	43,832.16	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,127	19.65	120,395.55	
	VERBUND AG	797	44.60	35,546.20	
	ASML HOLDING NV	4,536	322.55	1,463,086.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,665	21.68	296,257.20	
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	25.89	156,996.96	
ユーロ 小計		1,963,957		40,436,050.71 (5,001,939,472)	
英ポンド	BP PLC	217,822	2.98	649,327.38	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	44,346	12.42	551,043.39	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	40,202	11.93	479,690.26	
	ANGLO AMERICAN PLC	13,552	19.56	265,158.43	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	10.29	44,452.80	
	BHP GROUP PLC	23,014	17.09	393,493.37	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,494	57.26	85,546.44	
	EVRAZ PLC	3,072	3.05	9,375.74	
	GLENCORE PLC	111,426	1.82	203,686.72	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	22.90	41,288.70	
	MONDI PLC	5,627	14.42	81,141.34	
	RIO TINTO PLC	12,131	47.47	575,919.22	
	ASHTEAD GROUP PLC	4,156	25.81	107,266.36	
	BAE SYSTEMS PLC	35,791	4.77	171,045.18	
	BUNZL PLC	3,344	22.33	74,671.52	
	DCC PLC	823	70.08	57,675.84	
	FERGUSON PLC	2,523	69.92	176,408.16	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	1.04	46,500.44	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	22,239	2.68	59,622.75	
	SMITHS GROUP PLC	3,824	14.36	54,912.64	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	105.05	89,082.40	
	EXPERIAN PLC	9,883	27.76	274,352.08	
	INTERTEK GROUP PLC	1,825	54.16	98,842.00	

RELX PLC	20,911	16.71	349,422.81	
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.44	113,656.17	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	5.18	62,883.74	
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	44.52	66,690.96	
BURBERRY GROUP PLC	3,298	13.08	43,154.33	
PERSIMMON PLC	3,796	24.63	93,495.48	
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.30	56,384.90	
COMPASS GROUP PLC	19,967	11.20	223,630.40	
GVC HOLDINGS PLC	6,950	7.41	51,541.20	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	37.68	62,925.60	
WHITBREAD PLC	1,474	22.90	33,754.60	
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.27	59,764.96	
INFORMA PLC	17,619	4.00	70,634.57	
ITV PLC	42,960	0.61	26,394.62	
PEARSON PLC	7,332	5.44	39,930.07	
WPP PLC	14,514	6.17	89,609.43	
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	5.98	29,700.48	
KINGFISHER PLC	12,732	2.48	31,613.55	
NEXT PLC	1,278	51.46	65,765.88	
OCADO GROUP PLC	4,239	20.83	88,298.37	
SAINSBURY (J) PLC	9,573	1.91	18,289.21	
TESCO PLC	107,991	2.20	238,336.13	
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.88	43,278.04	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	18.33	60,157.13	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	24,652	26.92	663,631.84	
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	20.59	37,803.24	
DIAGEO PLC	25,139	27.96	702,886.44	
IMPERIAL BRANDS PLC	10,573	13.95	147,546.21	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,596	77.12	585,803.52	
UNILEVER PLC	12,511	46.78	585,264.58	
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00	
SMITH & NEPHEW PLC	9,733	16.11	156,798.63	
ASTRAZENECA PLC	14,047	86.52	1,215,346.44	
GLAXOSMITHKLINE PLC	53,822	15.80	850,495.24	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	21.52	29,095.04	

	BARCLAYS PLC	189,992	1.13	215,830.91	
	HSBC HOLDINGS PLC	217,809	3.64	794,676.13	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	768,979	0.29	228,348.31	
	NATWEST GROUP PLC	42,392	1.15	48,750.80	
	STANDARD CHARTERED PLC	30,372	4.26	129,475.83	
	3I GROUP PLC	8,862	8.70	77,099.40	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	17.07	52,386.10	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,469	83.68	290,285.92	
	M&G PLC	21,579	1.62	35,152.19	
	SCHRODERS PLC	1,161	29.60	34,365.60	
	ST JAMES'S PLACE PLC	3,582	9.52	34,129.29	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	2.59	48,563.71	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,104	23.46	25,899.84	
	AVIVA PLC	45,209	2.81	127,037.29	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	2.93	21,871.12	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	67,979	2.16	147,310.49	
	PRUDENTIAL PLC	28,477	11.50	327,485.50	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	4.41	41,445.75	
	AVEVA GROUP PLC	700	41.15	28,805.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	9,110	7.48	68,161.02	
	HALMA PLC	4,416	22.30	98,476.80	
	BT GROUP PLC	82,529	1.12	92,721.33	
	VODAFONE GROUP PLC	294,236	1.22	359,438.69	
	NATIONAL GRID PLC	38,223	9.03	345,153.69	
	SEVERN TRENT PLC	2,734	24.22	66,217.48	
	SSE PLC	11,557	13.28	153,476.96	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	8.82	69,120.37	
英ポンド 小計		3,088,056		15,546,172.49 (2,109,149,221)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	18.15	10,527.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	797.50	62,205.00	
	GIVAUDAN-REG	101	3,768.00	380,568.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	5,780	44.10	254,898.00	
	SIKA AG-REG	1,557	203.00	316,071.00	
	ABB LTD-REG	19,969	23.78	474,862.82	

	GEBERIT AG-REG	411	506.20	208,048.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	231.00	49,665.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	231.10	106,999.30	
	ADECCO SA-REG	1,516	45.77	69,387.32	
	SGS SA-REG	67	2,423.00	162,341.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	609	159.70	97,257.30	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5,752	59.02	339,483.04	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	198	188.70	37,362.60	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	36.26	9,101.26	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	21	1,911.00	40,131.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	7,190.00	57,520.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	78,900.00	78,900.00	
	NESTLE SA-REG	31,738	109.48	3,474,676.24	
	ALCON INC	5,350	55.10	294,785.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	614	203.80	125,133.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	917.00	106,372.00	
	LONZA GROUP AG-REG	806	563.20	453,939.20	
	NOVARTIS AG-REG	22,944	78.07	1,791,238.08	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7,497	318.90	2,390,793.30	
	VIFOR PHARMA AG	329	134.15	44,135.35	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	97.00	26,481.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	26,865	9.82	263,868.03	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,587	41.45	107,231.15	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	211	889.60	187,705.60	
	UBS GROUP AG-REG	39,921	11.26	449,710.06	
	BALOISE HOLDING AG - REG	344	142.30	48,951.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	348.50	128,248.00	
	SWISS RE AG	3,271	74.44	243,493.24	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,622	347.70	563,969.40	
	SWISS PRIME SITE-REG	620	83.30	51,646.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	737	146.20	107,749.40	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,569	63.70	99,945.30	
	SWISSCOM AG-REG	301	494.10	148,724.10	
スイスフラン 小計		185,660		13,864,122.69 (1,595,344,597)	

スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	221.00	242,879.00	
	BOLIDEN AB	1,948	245.00	477,260.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	6,034	105.90	639,000.60	
	ALFA LAVAL AB	2,277	217.30	494,792.10	
	ASSA ABLOY AB-B	11,374	202.70	2,305,509.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,490	400.20	2,997,498.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,771	350.50	1,321,735.50	
	EPIROC AB-A	5,706	124.05	707,829.30	
	EPIROC AB-B	4,649	121.10	562,993.90	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	179.50	262,788.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,084	216.00	666,144.00	
	SANDVIK AB	12,786	168.00	2,148,048.00	
	SKANSKA AB-B SHS	2,462	183.40	451,530.80	
	SKF AB-B SHARES	4,538	168.05	762,610.90	
	VOLVO AB-B SHS	16,718	157.65	2,635,592.70	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	129.65	496,948.45	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	167.25	256,227.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	81.12	230,137.44	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,225	603.00	738,675.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	135.00	1,294,785.00	
	ICA GRUPPEN AB	510	431.40	220,014.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	679.80	1,358,920.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,724	287.30	1,931,805.20	
	NORDEA BANK ABP	36,261	71.04	2,575,981.44	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,719	88.26	1,652,138.94	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,862	86.08	1,537,560.96	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,556	145.96	1,540,753.76	
	EQT AB	2,344	205.80	482,395.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	218.80	138,500.40	
	INVESTOR AB-B SHS	5,160	522.80	2,697,648.00	
	KINNEVIK AB - B	2,331	305.80	712,819.80	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	419.80	386,216.00	
	ERICSSON LM-B SHS	32,774	100.65	3,298,703.10	
	HEXAGON AB-B SHS	3,268	572.40	1,870,603.20	
	TELE2 AB-B SHS	3,777	130.10	491,387.70	

	TELIA CO AB	31,100	35.52	1,104,672.00	
スウェーデンクローナ 小計		279,356		41,693,105.39 (501,151,126)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	9,617	144.50	1,389,656.50	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	26.74	216,754.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	377.80	644,904.60	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	288.60	159,307.20	
	MOWI ASA	5,643	167.55	945,484.65	
	ORKLA ASA	6,749	87.78	592,427.22	
	DNB ASA	9,301	144.50	1,343,994.50	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	190.30	508,862.20	
	TELENOR ASA	9,278	149.15	1,383,813.70	
ノルウェークローネ 小計		53,627		7,185,205.01 (83,563,934)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	722.20	879,639.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,451	387.00	948,537.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,207	848.00	1,871,536.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	7,780.00	303,420.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	74	8,390.00	620,860.00	
	DSV PANALPINA A S	2,319	863.20	2,001,760.80	
	PANDORA A/S	1,082	400.40	433,232.80	
	CARLSBERG AS-B	1,203	935.00	1,124,805.00	
	AMBU A/S-B	1,526	219.50	334,957.00	
	COLOPLAST-B	1,315	1,058.00	1,391,270.00	
	DEMANT A/S	550	195.30	107,415.00	
	GN STORE NORD A/S	1,197	380.40	455,338.80	
	GENMAB A/S	717	2,234.00	1,601,778.00	
	H LUNDBECK A/S	120	223.50	26,820.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	18,959	424.35	8,045,251.65	
	DANSKE BANK A/S	6,042	105.95	640,149.90	
	TRYG A/S	694	191.70	133,039.80	
	ORSTED A/S	2,091	905.20	1,892,773.20	
デンマーククローネ 小計		43,804		22,812,584.55 (379,145,155)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	27.53	82,920.36	
	OIL SEARCH LTD	14,702	3.14	46,164.28	

ORIGIN ENERGY LTD	14,373	5.71	82,069.83	
SANTOS LTD	14,669	5.58	81,853.02	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	20.28	7,239.96	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	8,473	20.99	177,848.27	
BHP GROUP LTD	31,786	37.08	1,178,624.88	
BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	11.75	73,508.00	
EVOLUTION MINING LTD	16,140	5.82	93,934.80	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	19,086	16.29	310,910.94	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	28.37	110,671.37	
NEWCREST MINING LTD	9,074	34.60	313,960.40	
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	15.50	114,343.50	
ORICA LTD	2,575	17.34	44,650.50	
RIO TINTO LTD	4,114	102.92	423,412.88	
SOUTH32 LTD	38,772	2.19	84,910.68	
CIMIC GROUP LTD	682	22.64	15,440.48	
BRAMBLES LTD	17,428	10.67	185,956.76	
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	4.66	107,347.76	
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	3.64	31,668.00	
SYDNEY AIRPORT	12,027	5.40	64,945.80	
TRANSURBAN GROUP	30,019	13.70	411,260.30	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,885	25.99	178,941.15	
CROWN RESORTS LTD	773	9.07	7,011.11	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	3.64	77,288.12	
REA GROUP LTD	563	107.32	60,421.16	
SEEK LTD	3,309	22.02	72,864.18	
WESFARMERS LTD	12,403	46.36	575,003.08	
COLES GROUP LTD	15,036	17.78	267,340.08	
WOOLWORTHS GROUP LTD	13,807	38.63	533,364.41	
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	8.83	45,642.27	
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	11.14	78,537.00	
COCHLEAR LTD	742	193.96	143,918.32	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	63.41	90,105.61	
SONIC HEALTHCARE LTD	5,181	32.05	166,051.05	
CSL LTD	4,873	277.02	1,349,918.46	
AUST AND NZ BANKING GROUP	30,789	18.29	563,130.81	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	18,999	72.86	1,384,267.14	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	34,635	17.98	622,737.30	
	WESTPAC BANKING CORP	39,063	17.76	693,758.88	
	AMP LTD	36,656	1.71	62,681.76	
	ASX LTD	2,263	83.44	188,824.72	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,726	125.79	468,693.54	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	58.56	91,177.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,356	5.32	102,973.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.95	99,173.10	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	17,256	10.40	179,462.40	
	SUNCORP GROUP LTD	11,553	8.98	103,745.94	
	LENDLEASE GROUP	8,292	11.93	98,923.56	
	AFTERPAY LTD	2,039	69.81	142,342.59	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	13.51	75,710.04	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	20.74	33,184.00	
	TELSTRA CORP LTD	50,525	3.33	168,248.25	
	TPG TELECOM LTD	287	8.02	2,301.74	
	AGL ENERGY LTD	7,599	17.23	130,930.77	
	APA GROUP	13,816	11.11	153,495.76	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.76	2,529.12	
オーストラリアドル 小計		725,674		13,058,342.03 (984,207,238)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	6.34	51,430.08	
	A2 MILK CO LTD	7,857	20.84	163,739.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	35.24	233,852.64	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	13.35	73,505.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.85	111,147.45	
	MERCURY NZ LTD	7,200	4.69	33,768.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	4.75	44,659.50	
ニュージーランドドル 小計		67,630		712,102.65 (50,160,510)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	31,500	49.80	1,568,700.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	6.59	65,900.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	16,500	82.10	1,354,650.00	
	MTR CORP	19,500	38.30	746,850.00	

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	26,000	50.05	1,301,300.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	29.25	906,750.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	8.27	16,540.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	12.98	67,496.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	23.75	522,500.00	
	WH GROUP LTD	91,500	6.79	621,285.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	17.58	63,288.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	21.90	963,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	124.30	1,118,700.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,200	360.40	4,757,280.00	
	AIA GROUP LTD	130,600	71.90	9,390,140.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	26,000	43.30	1,125,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	19.02	513,540.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	28.60	397,997.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	18.50	9,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	15,000	37.25	558,750.00	
	SINO LAND CO	18,000	9.34	168,120.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	15,700	92.45	1,451,465.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	38.10	160,020.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	17.52	87,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	28.00	644,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	11.50	379,500.00	
	PCCW LTD	4,000	4.36	17,440.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	38.30	168,520.00	
	CLP HOLDINGS LTD	16,000	71.50	1,144,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.95	246,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	104,874	11.04	1,157,808.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	42.35	762,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	98.05	156,880.00	
香港ドル 小計		816,790		32,614,420.56 (445,186,840)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.71	108,490.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.25	39,000.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,500	0.92	1,387.50	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	9,600	3.62	34,752.00	

	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.75	60,600.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	20.00	2,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.29	108,108.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	19,900	20.64	410,736.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	37,200	8.98	334,056.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	13,400	20.23	271,082.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	8.32	95,680.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	2.82	59,784.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	8.26	24,780.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.67	14,007.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	16.98	69,618.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	80,700	2.48	200,136.00	
シンガポールドル 小計		341,300		1,834,216.50 (140,592,694)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	4,122	11.06	45,589.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	463.00	176,403.00	
	BANK HAPOALIM BM	9,996	19.83	198,220.68	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	17.19	308,113.56	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	10.63	79,926.97	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	70.58	99,800.12	
	AZRIELI GROUP	234	158.80	37,159.20	
	NICE SYSTEMS LTD	731	675.90	494,082.90	
イスラエルシュケル 小計		42,321		1,439,295.75 (44,632,561)	
合　計		11,099,889		44,096,852,265 (44,096,852,265)	

(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	65,206.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,379	232,430.45	
		AMERICAN TOWER CORP	4,757	1,219,361.81	

ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN		16,047	114,736.05	
AVALONBAY COMMUNITIES INC		1,572	230,848.20	
BOSTON PROPERTIES INC		1,674	151,781.58	
CAMDEN PROPERTY TRUST		1,108	99,199.24	
CROWN CASTLE INTL CORP		4,493	748,983.10	
DIGITAL REALTY TRUST INC		2,875	422,596.25	
DUKE REALTY CORP		4,194	156,268.44	
EQUINIX INC		925	682,085.75	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		1,548	101,502.36	
EQUITY RESIDENTIAL		4,162	226,163.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		753	161,232.36	
EXTRA SPACE STORAGE INC		1,476	140,810.40	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		617	45,034.83	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		5,755	151,011.20	
HOST HOTELS & RESORTS INC		6,508	68,334.00	
INVITATION HOMES INC		4,955	136,411.15	
IRON MOUNTAIN INC		2,044	55,678.56	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		5,932	112,233.44	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		1,301	144,762.27	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		1,474	50,705.60	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS		2,330	72,696.00	
PROLOGIS INC		7,985	797,781.35	
PUBLIC STORAGE		1,734	321,414.24	
REALTY INCOME CORP		3,751	215,382.42	
REGENCY CENTERS CORP		1,514	60,499.44	
SBA COMMUNICATIONS CORP		1,229	367,077.72	
SIMON PROPERTY GROUP INC		3,443	208,542.51	
SUN COMMUNITIES INC		1,063	150,818.44	
UDR INC		3,355	119,068.95	
VENTAS INC		4,246	151,879.42	
VEREIT INC		11,100	68,931.00	
VICI PROPERTIES INC		5,335	112,195.05	
VORNADO REALTY TRUST		1,259	44,077.59	
WELLTOWER INC		4,601	236,583.42	
WEYERHAEUSER CO		8,460	220,890.60	

	WP CAREY INC	1,458	96,811.20	
米ドル 小計		143,235	8,762,026.43 (927,197,636)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	45,182.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	25,055.18	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	22,812.30	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,075.37	
カナダドル 小計		4,434	94,124.85 (7,436,804)	
ユーロ	COVIVIO	522	32,076.90	
	GECINA SA	569	61,679.60	
	ICADE	30	1,701.00	
	KLEPIERRE	1,289	20,437.09	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	57,790.72	
ユーロ 小計		3,606	173,685.31 (21,484,872)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	20,567.14	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	36,138.52	
	SEGRO PLC	13,859	128,195.75	
英ポンド 小計		26,244	184,901.41 (25,085,574)	
オーストラリアドル	DEXUS	13,745	123,430.10	
	GOODMAN GROUP	18,868	306,793.68	
	GPT GROUP	15,542	64,033.04	
	MIRVAC GROUP	32,387	67,688.83	
	SCENTRE GROUP	51,996	109,711.56	
	STOCKLAND	29,890	96,544.70	
	VICINITY CENTRES	42,168	57,770.16	
オーストラリアドル 小計		204,596	825,972.07 (62,253,514)	
香港ドル	LINK REIT	24,600	1,448,940.00	
香港ドル 小計		24,600	1,448,940.00 (19,778,031)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	143,724.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	43,860.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	22,000	43,560.00	

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	43,240.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	82,390.00	
		SUNTEC REIT	8,500	11,815.00	
	シンガポールドル 小計		158,800	368,589.00 (28,252,346)	
合計				1,091,488,777 (1,091,488,777)	

(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	589銘柄	97.1%	—	69.1%
	投資証券	39銘柄	—	2.9%	2.1%
カナダドル	株式	81銘柄	99.5%	—	3.4%
	投資証券	4銘柄	—	0.5%	0.0%
ユーロ	株式	240銘柄	99.6%	—	11.1%
	投資証券	5銘柄	—	0.4%	0.0%
英ポンド	株式	85銘柄	98.8%	—	4.7%
	投資証券	3銘柄	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	—	3.5%
スウェーデンクローナ	株式	36銘柄	100.0%	—	1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%	—	0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%	—	0.8%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	94.1%	—	2.2%
	投資証券	7銘柄	—	5.9%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式	33銘柄	95.7%	—	1.0%
	投資証券	1銘柄	—	4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	83.3%	—	0.3%
	投資証券	6銘柄	—	16.7%	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。

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	1,582,580,750
コール・ローン	33,558,014
株式	6,562,354,201
投資証券	5,606,676
派生商品評価勘定	180,252,524
未収入金	531,423
未収配当金	26,163,198
差入委託証拠金	492,748,714
流動資産合計	8,883,795,500
資産合計	8,883,795,500
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	684,865
未払解約金	2,756,000
未払利息	91
流動負債合計	3,440,956
負債合計	3,440,956
純資産の部	
元本等	
元本	6,916,953,326
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,963,401,218
元本等合計	8,880,354,544
純資産合計	8,880,354,544
負債純資産合計	8,883,795,500

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
２.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
３.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
４.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
５.その他財務諸表作成のための基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 7月27日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	5,621,258,113円
期中追加設定元本額	9,872,215,520円
期中一部解約元本額	8,576,520,307円
期末元本額	6,916,953,326円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	467,124,977円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	986,354,630円
りそなラップ型ファンド（成長型）	967,570,455円
ＤＣりそな　グローバルバランス	9,331,064円
つみたてバランスファンド	299,837,531円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	245,415,727円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	120,602,466円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	71,930,092円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	4,798,132円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	4,027,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,428,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	2,317,501円
リスクコントロール・オープン	4,408,067円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	51,526,635円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	1,528,919,087円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	896,443,719円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	29,007,992円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	86,519,492円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	100,907,658円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	291,379,776円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	210,003,653円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	132,897,894円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	85,578,569円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	273,245,665円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	44,385,757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）	991,375円
２．　計算日における受益権の総数	
	6,916,953,326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	1.2839円
(10,000口当たり純資産額)	(12,839円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	42,194,598
投資証券	△2,759,435
合計	39,435,163

(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 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,112,800,532	－	2,292,764,373	179,963,841
合計		2,112,800,532	－	2,292,764,373	179,963,841

（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 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	28,864,757	－	28,467,194	△397,563
	米ドル	19,457,277	－	19,197,194	△260,083
	香港ドル	5,534,000	－	5,460,000	△74,000
	南アフリカランド	3,873,480	－	3,810,000	△63,480
	売建	47,000	－	45,619	1,381
	コロンビアペソ	43,574	－	42,244	1,330
	オフショア人民元	3,426	－	3,375	51
合計		28,911,757	－	28,512,813	△396,182

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	62,002	5.14	319,186.29	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.71	5,846.60	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,306	69.00	297,114.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	987	152.10	150,122.70	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	13,717	4.96	68,091.18	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	5.23	77,006.85	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,578	46.92	120,959.76	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	6.66	12,654.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,090	11.06	23,115.40	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	7.09	22,333.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	6,724	26.43	177,715.32	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,251	20.06	25,095.06	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,201	12.04	14,460.04	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	723	104.70	75,698.10	
	SEVERSTAL - GDR REG S	1,901	12.40	23,572.40	
	SOUTHERN COPPER CORP	785	43.08	33,817.80	
	51JOB INC-ADR	300	66.48	19,944.00	
	BEST INC - ADR	1,500	4.16	6,240.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,900	34.88	136,032.00	
	NIO INC - ADR	9,400	11.82	111,108.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	800	81.20	64,960.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,400	33.56	46,984.00	

	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,450	138.05	200,172.50	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	3,900	75.74	295,386.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	3,650	52.64	192,136.00	
	58.COM INC-ADR	960	55.06	52,857.60	
	AUTOHOME INC-ADR	620	77.76	48,211.20	
	BAIDU INC - SPON ADR	2,750	119.02	327,305.00	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,000	40.10	40,100.00	
	HUYA INC-ADR	500	22.47	11,235.00	
	IQIYI INC-ADR	2,300	20.40	46,920.00	
	JOYY INC	620	76.60	47,492.00	
	MOMO INC-SPON ADR	1,350	17.61	23,773.50	
	NETEASE INC-ADR	782	448.33	350,594.06	
	SINA CORP	630	40.02	25,212.60	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,800	15.62	59,356.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	630	33.72	21,243.60	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	18,930	249.00	4,713,570.00	
	BAOZUN INC-SPN ADR	500	37.81	18,905.00	
	JD.COM INC-ADR	8,620	60.88	524,785.60	
	PINDUODUO INC-ADR	2,600	78.95	205,270.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	4,950	27.10	134,145.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,600	20.43	93,978.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,288	15.66	67,150.08	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,456	38.74	56,405.44	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	25.80	15,480.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	500	76.02	38,010.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	15,674	3.85	60,344.90	
	CREDICORP LTD	644	127.27	81,961.88	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	28,306	12.02	340,379.65	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.00	22,256.71	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	29.54	14,770.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.83	8,406.72	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	800	78.15	62,520.00	
	GLOBANT SA	340	164.69	55,994.60	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,500	8.91	49,005.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	10.05	8,743.50	

米ドル 小計		300,327		10,146,134.14 (1,073,663,914)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	142,300	6.24	887,952.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	32,300	58.98	1,905,054.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	315.06	433,207.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	7,800	34.21	266,838.00	
	ALFA S.A.B.-A	34,600	11.14	385,444.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	44.67	151,878.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,700	145.54	538,498.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,070	219.86	455,110.20	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	159.92	439,780.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	26,000	23.65	614,900.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	70.01	154,022.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	53,400	56.49	3,016,566.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	108.60	521,280.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	43.21	229,013.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	5,600	92.96	520,576.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	19,800	134.00	2,653,200.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,115	260.27	550,471.05	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,000	38.94	584,100.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	35.27	581,955.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	26,700	79.78	2,130,126.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	17,800	15.94	283,732.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	341,600	14.64	5,001,024.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	62.62	388,244.00	
メキシコペソ 小計		773,310		22,692,970.75 (108,018,540)	
ブラジルレアル	COSAN SA	1,200	82.44	98,928.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	37,700	23.33	879,541.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	48,200	22.73	1,095,586.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,600	19.15	145,540.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	24.14	55,522.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	11.61	84,753.00	
	GERDAU SA-PREF	11,500	17.14	197,110.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,400	21.45	158,730.00	

SUZANO SA	5,007	42.30	211,796.10	
VALE SA	37,400	58.60	2,191,640.00	
WEG SA	8,650	66.71	577,041.50	
CCR SA	13,400	14.64	196,176.00	
LOCALIZA RENT A CAR	6,610	44.70	295,467.00	
RUMO SA	10,100	22.30	225,230.00	
COGNA EDUCACAO	18,400	8.28	152,352.00	
B2W CIA DIGITAL	2,100	121.59	255,339.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	9,200	35.53	326,876.00	
LOJAS RENNER S.A.	8,100	41.20	333,720.00	
MAGAZINE LUIZA SA	7,400	79.67	589,558.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	7,000	22.95	160,650.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.63	61,890.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	74.90	127,330.00	
RAIA DROGASIL SA	2,200	114.15	251,130.00	
AMBEV SA	47,800	14.93	713,654.00	
BRF SA	5,900	20.33	119,947.00	
JBS SA	9,700	22.07	214,079.00	
NATURA &CO HOLDING SA	7,000	42.60	298,200.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,400	65.69	157,656.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	5,000	68.06	340,300.00	
HYPERA SA	4,000	34.25	137,000.00	
BANCO BRADESCO S.A.	13,720	20.72	284,278.40	
BANCO BRADESCO SA-PREF	44,890	22.64	1,016,309.60	
BANCO DO BRASIL S.A.	8,900	33.95	302,155.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	29.03	127,732.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	49,000	26.47	1,297,030.00	
ITAUSA SA	45,100	10.45	471,295.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	21,200	65.35	1,385,420.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	86.92	225,992.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,300	28.00	204,400.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,200	8.34	43,368.00	
PORTO SEGURO SA	700	53.64	37,548.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	3,100	51.03	158,193.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,000	10.30	61,800.00	

	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	21.37	47,014.00	
	CIELO SA	11,700	5.27	61,659.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,100	49.27	202,007.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,000	14.41	129,690.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,000	39.05	78,100.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,200	38.10	121,920.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,200	12.01	122,502.00	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	63.03	69,333.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,600	61.54	221,544.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	32.22	74,106.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	48.00	96,000.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	44.19	100,532.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,900	24.64	219,296.00	
ブラジルレアル 小計		619,952		17,811,965.85 (360,336,069)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,205	6,200.00	26,071,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	10,523	1,700.00	17,889,100.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,062	23,370.00	24,818,940.00	
	FALABELLA SA	6,932	2,610.10	18,093,213.20	
	CENCOSUD SA	13,424	1,245.00	16,712,880.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,830.00	10,115,050.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,859.00	5,298,150.00	
	BANCO DE CHILE	481,649	73.55	35,425,283.95	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	565	27,990.00	15,814,350.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	716,617	32.70	23,433,375.90	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,389.90	7,234,429.50	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,858	5,490.00	10,200,420.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	269.13	4,845,954.78	
	COLBUN SA	83,944	136.50	11,458,356.00	
	ENEL AMERICAS SA	362,665	119.01	43,160,761.65	
	ENEL CHILE SA	262,172	61.13	16,026,574.36	
チリペソ 小計		1,973,412		286,597,839.34 (39,091,945)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	49,667	2,220.00	110,260,740.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	25,480.00	64,770,160.00	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,580	25,700.00	117,706,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	20,180.00	52,225,840.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,890	19,800.00	96,822,000.00	
コロンビアペソ 小計		64,267		441,784,740.00 (12,635,043)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	12.12	9,502.08	
	OPAP SA	2,135	8.02	17,122.70	
	JUMBO SA	765	16.73	12,798.45	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,534	12.64	32,029.76	
ユーロ 小計		6,218		71,452.99 (8,838,734)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	917	87.35	80,099.95	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,119	8.37	134,916.03	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,955	35.08	138,741.40	
	KOC HOLDING AS	8,691	17.45	151,657.95	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	17.92	26,880.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	11.74	64,570.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	77.50	41,152.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,769	73.85	352,190.65	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	20.70	39,744.00	
	AKBANK T.A.S.	29,649	5.78	171,371.22	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	21,853	7.91	172,857.23	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	5.29	64,009.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.36	69,884.32	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	9.13	110,098.67	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,983	16.06	192,446.98	
トルコリラ 小計		161,158		1,810,619.90 (27,974,077)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	550.00	411,950.00	
	MONETA MONEY BANK AS	3,886	53.30	207,123.80	
	CEZ AS	1,547	465.00	719,355.00	
チェココルナ 小計		6,182		1,338,428.80 (6,303,999)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,029	1,729.00	5,237,141.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,497	6,455.00	9,663,135.00	

	OTP BANK PLC	2,319	11,000.00	25,509,000.00	
ハンガリーフォリント 小計		6,845		40,409,276.00 (14,458,438)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	682	51.58	35,177.56	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,810	57.82	162,474.20	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	19,031	5.36	102,044.22	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,355	119.20	161,516.00	
	LPP SA	14	6,210.00	86,940.00	
	CD PROJEKT SA	697	388.00	270,436.00	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	29.30	93,525.60	
	DINO POLSKA SA	528	200.00	105,600.00	
	BANK PEKAO SA	1,997	54.88	109,595.36	
	MBANK SA	165	206.00	33,990.00	
	PKO BANK POLSKI SA	9,155	23.10	211,480.50	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	161.40	42,771.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	5,729	28.25	161,844.25	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.97	32,775.52	
	PGE SA	9,929	7.34	72,958.29	
ポーランドズロチ 小計		60,248		1,683,128.50 (47,295,910)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	6.24	74,880.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	250,000	3.45	862,500.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	35,500	13.12	465,760.00	
	CNOOC LTD	182,000	8.52	1,550,640.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.55	35,500.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	220,000	2.86	629,200.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	5.97	83,580.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	1.97	59,100.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	13,000	57.10	742,300.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	4.55	59,150.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	27,000	2.97	80,190.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	9.10	382,200.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	28,000	10.10	282,800.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.12	136,800.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	4.67	46,700.00	

NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	7.55	151,000.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	1.78	60,520.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	10.02	130,260.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	54,000	4.68	252,720.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	4.45	115,700.00	
BOC AVIATION LTD	2,200	45.95	101,090.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	42,000	4.43	186,060.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	4.97	139,160.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	17,000	33.65	572,050.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	14.08	183,040.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	23,500	6.20	145,700.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	4.06	178,640.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	16,000	4.70	75,200.00	
CITIC LTD	62,000	7.30	452,600.00	
CRRC CORP LTD - H	51,000	3.43	174,930.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	24,500	9.45	231,525.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	17.50	140,000.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	2.36	47,200.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	11.40	45,600.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	3.75	65,625.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	23.85	190,800.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	19,000	16.90	321,100.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	6.70	40,200.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	6,700	26.80	179,560.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	10,400	7.97	82,888.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	4,750	45.50	216,125.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	4.46	182,860.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	14,000	43.85	613,900.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	10.68	106,800.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	4.72	84,960.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.32	106,400.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	2.76	38,640.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	8.86	159,480.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	12,000	3.56	42,720.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	18,500	2.70	49,950.00	

COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	4.10	73,800.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	8.72	104,640.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	7.29	29,160.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	10,500	12.64	132,720.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	5.84	105,120.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	3.79	47,375.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.69	261,460.00	
BYD CO LTD-H	6,000	72.45	434,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	5.07	162,240.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	22.30	115,960.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	61,000	15.88	968,680.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	8.16	285,600.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	28,000	6.24	174,720.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	11,000	70.75	778,250.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	2.11	50,640.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	14,000	24.80	347,200.00	
LI NING CO LTD	22,000	24.80	545,600.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	8,500	91.00	773,500.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	18.68	112,080.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	4,000	13.50	54,000.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.11	85,320.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	8,000	35.10	280,800.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	37.10	92,750.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.11	155,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	2,800	51.55	144,340.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	57,700	528.00	30,465,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	72,000	1.10	79,200.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	35,900	190.70	6,846,130.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	13.40	112,560.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	9.04	126,560.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	46.70	280,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	25,500	11.18	285,090.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	79.15	87,065.00	
CHINA FEIHE LTD	9,000	15.58	140,220.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	28,000	34.65	970,200.00	

CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	16,000	51.60	825,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	14,500	4.67	67,715.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	18,000	13.52	243,360.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	65.50	262,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	8.20	123,000.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	5.79	306,870.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	5,000	93.70	468,500.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	7,000	66.95	468,650.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	28.90	115,600.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	24.90	99,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	38,000	20.85	792,300.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	3,900	117.20	457,080.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	24,000	19.24	461,760.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,400	13.40	85,760.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	12,400	18.64	231,136.00	
3SBIO INC	13,000	9.98	129,740.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	215.00	129,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	9.47	151,520.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.36	47,960.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.93	94,320.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	58,000	15.34	889,720.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	16.84	168,400.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	6,000	36.00	216,000.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	10,000	50.05	500,500.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	4.73	82,775.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	35.85	215,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	107,250	9.94	1,066,065.00	
SSY GROUP LTD	10,000	5.07	50,700.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	2,324	112.40	261,217.60	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	9,500	145.20	1,379,400.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	285,000	2.78	792,300.00	
BANK OF CHINA LTD-H	806,000	2.64	2,127,840.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	92,000	4.35	400,200.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	96,000	3.39	325,440.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	971,000	5.86	5,690,060.00	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	24,000	2.93	70,320.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	40,000	36.80	1,472,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	54,100	4.92	266,172.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.14	56,520.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	615,000	4.68	2,878,200.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	104,000	4.41	458,640.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.48	155,400.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	12.90	103,200.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	41,000	4.70	192,700.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.93	95,790.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,600	17.84	242,624.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	21,000	17.68	371,280.00	
FAR EAST HORIZON LTD	17,000	6.66	113,220.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	9.06	141,336.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	13.16	100,016.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	30,400	7.06	214,624.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	13.70	238,380.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	76,000	18.00	1,368,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	28,800	22.65	652,320.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.85	46,750.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	17,800	14.02	249,556.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	9,000	30.95	278,550.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	92,000	2.48	228,160.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	72,000	6.13	441,360.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	60,000	83.40	5,004,000.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,600	42.30	152,280.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	10,000	9.80	98,000.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	9.60	134,400.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	20,000	20.65	413,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	56,000	5.14	287,840.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	39,500	23.60	932,200.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	8.40	126,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	32,000	33.15	1,060,800.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	17,900	25.10	449,290.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	30,000	6.60	198,000.00	

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	79,000	9.89	781,310.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	15,200	9.10	138,320.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	18,000	3.33	59,940.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	12.92	180,880.00	
LOGAN GROUP CO LTD	14,000	13.44	188,160.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	18,500	37.85	700,225.00	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	1,200	83.75	100,500.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	7.34	176,160.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.47	59,280.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	13,000	31.80	413,400.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.18	33,040.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	1.88	43,240.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	2.91	34,920.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	26,000	35.40	920,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	14,000	13.08	183,120.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	52,000	1.46	75,920.00	
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	14,000	3.35	46,900.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.67	56,040.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	25,000	18.64	466,000.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	35.75	286,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	13.52	121,680.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	7,000	57.45	402,150.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,000	22.20	111,000.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	3.45	51,750.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	5,000	22.35	111,750.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	8,000	8.32	66,560.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	10.00	34,000.00	
LENOVO GROUP LTD	66,000	4.57	301,620.00	
SUNNY OPTICAL TECH	7,400	138.10	1,021,940.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	107,200	15.10	1,618,720.00	
ZTE CORP-H	8,800	22.15	194,920.00	
CHINA MOBILE LTD	62,000	53.50	3,317,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	142,000	2.29	325,180.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	460,000	1.42	653,200.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	56,000	4.33	242,480.00	

	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	27.00	162,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.13	181,540.00	
	CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.63	179,300.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	27,400	23.40	641,160.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	38,000	4.51	171,380.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.43	84,370.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	10,000	37.95	379,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	20,000	9.63	192,600.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	8,300	92.35	766,505.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	32,000	13.04	417,280.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	30,000	3.34	100,200.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	38,000	6.51	247,380.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	28.35	141,750.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	34,000	25.65	872,100.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	42,000	8.24	346,080.00	
香港ドル 小計		9,004,224		114,484,149.60 (1,562,708,642)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	36,700	3.79	139,093.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	20.62	59,798.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	22,500	6.26	140,850.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	4.70	78,490.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.45	72,450.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.62	65,512.00	
	IJM CORP BHD	20,200	1.65	33,330.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.13	70,503.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.20	67,080.00	
	MISC BHD	13,100	7.90	103,490.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.65	24,820.00	
	GENTING BHD	23,100	3.96	91,476.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.33	75,958.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	25.50	25,500.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,000	32.00	32,000.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	10.24	30,720.00	
	IOI CORP BHD	23,300	4.47	104,151.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,700	22.70	106,690.00	

	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	700	140.00	98,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,920	19.00	112,480.00	
	QL RESOURCES BHD	7,100	9.63	68,373.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	22,400	5.18	116,032.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	17,700	17.68	312,936.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.39	129,899.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	16,100	25.44	409,584.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	12,700	3.03	38,481.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	67,500	3.57	240,975.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	15.00	108,000.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	13.90	25,020.00	
	MALAYAN BANKING BHD	40,900	7.85	321,065.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	29,900	17.72	529,828.00	
	RHB BANK BHD	18,100	4.97	89,957.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.23	98,192.00	
	DIGI.COM BHD	28,400	4.19	118,996.00	
	MAXIS BHD	21,600	5.25	113,400.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	3.97	32,157.00	
	PETRONAS GAS BHD	7,500	16.28	122,100.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	24,300	11.24	273,132.00	
	YTL CORP BHD	19,380	0.74	14,438.10	
マレーシアリンギット 小計		694,000		4,694,956.10 (116,763,558)	
タイバーツ	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.62	360,774.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,000	93.25	1,398,750.00	
	PTT PCL-NVDR	117,400	38.50	4,519,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	43.25	570,900.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	26.25	433,125.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	25,000	48.50	1,212,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	8,100	382.00	3,094,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	45,100	55.25	2,491,775.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	8.95	801,025.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	75,200	10.50	789,600.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.02	250,044.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	35,100	19.60	687,960.00	

	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	28.75	592,968.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	64,600	15.10	975,460.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	8,800	38.75	341,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	60,100	67.00	4,026,700.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	41,700	33.00	1,376,100.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	41.75	271,375.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	13.40	324,280.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	100,800	21.70	2,187,360.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	3,300	114.50	377,850.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	104.00	426,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,300	85.75	1,140,475.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.10	252,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	70.75	700,425.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	1.02	219,300.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	24.40	446,520.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	32.50	266,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	51.00	387,600.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	51.75	465,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	20,800	49.00	1,019,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	7.55	727,820.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	12,500	185.00	2,312,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	56.75	1,044,200.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	3,100	39.25	121,675.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.40	289,340.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	51.50	489,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	2,800	245.00	686,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	47.75	854,725.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	71.75	523,775.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	20,500	34.50	707,250.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	3,200	62.50	200,000.00	
タイバーツ 小計		1,578,525		40,364,851.75 (134,818,604)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	50.00	1,168,000.00	
	AYALA CORPORATION	2,690	742.00	1,995,980.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	437.80	306,460.00	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	27,220	65.00	1,769,300.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,595	900.50	2,336,797.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	97.00	1,134,900.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	128.50	578,250.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	48.00	456,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,750	122.00	1,189,500.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	69.50	460,785.00	
	BDO UNIBANK INC	21,220	93.05	1,974,521.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	36.05	479,897.60	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.15	456,750.00	
	AYALA LAND INC	85,400	32.50	2,775,500.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	3.07	300,860.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	15.90	389,550.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,800	30.50	3,226,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	250	2,090.00	522,500.00	
	PLDT INC	980	1,340.00	1,313,200.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	25.90	414,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,660	261.00	433,260.00	
フィリピンペソ 小計		610,767		23,683,311.10 (50,919,118)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,090.00	164,481,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	12,700	19,450.00	247,015,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	254,100	1,175.00	298,567,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	7,675.00	206,457,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	12,225.00	162,592,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	9,275.00	298,655,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	208,300	5,050.00	1,051,915,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,640.00	82,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	78,300	6,000.00	469,800,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	3,300	47,700.00	157,410,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,685.00	153,503,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	17,300	9,175.00	158,727,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	6,475.00	312,095,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	78,700	8,050.00	633,535,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,570.00	355,605,000.00	

	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	100,000	30,500.00	3,050,000,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	191,200	5,600.00	1,070,720,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	78,800	4,610.00	363,268,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	563,900	3,090.00	1,742,451,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	508,200	3,020.00	1,534,764,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	2,760.00	77,280,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,220.00	160,430,000.00	
インドネシアルピア 小計		2,893,400		12,751,272,500.00 (93,084,289)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	35,350.00	17,321,500.00	
	S-OIL CORP	483	61,700.00	29,801,100.00	
	SK INNOVATION CO LTD	573	132,000.00	75,636,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,199	25,950.00	31,114,050.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	25,450.00	20,029,150.00	
	KOREA ZINC CO LTD	93	395,500.00	36,781,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	89,300.00	19,467,400.00	
	LG CHEM LTD	469	516,000.00	242,004,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	253,500.00	22,308,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	188	173,000.00	32,524,000.00	
	POSCO	761	194,000.00	147,634,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	161	71,300.00	11,479,300.00	
	CJ CORP	193	85,200.00	16,443,600.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	313	86,500.00	27,074,500.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	1,310	3,450.00	4,519,500.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	23,650.00	12,156,100.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	27,500.00	15,950,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	439	26,800.00	11,765,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	35,350.00	30,683,800.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	233,000.00	25,630,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	540	24,550.00	13,257,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	393	88,300.00	34,701,900.00	
	LG CORP	994	72,100.00	71,667,400.00	
	LOTTE CORP	242	31,750.00	7,683,500.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	500	14,200.00	7,100,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	883	106,000.00	93,598,000.00	

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	12,100.00	19,408,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,232	5,620.00	29,403,840.00	
SK HOLDINGS CO LTD	364	224,500.00	81,718,000.00	
S-1 CORPORATION	120	85,000.00	10,200,000.00	
CJ LOGISTICS	65	152,500.00	9,912,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	115,000.00	25,185,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	18,400.00	17,572,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	3,580.00	11,731,660.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	552	25,650.00	14,158,800.00	
HANON SYSTEMS	1,394	9,130.00	12,727,220.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	689	203,500.00	140,211,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,541	122,500.00	188,772,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	273	67,500.00	18,427,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	66,200.00	11,254,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,715	36,900.00	100,183,500.00	
COWAY CO LTD	531	74,500.00	39,559,500.00	
FILA HOLDINGS CORP	364	33,800.00	12,303,200.00	
HLB INC	411	87,600.00	36,003,600.00	
LG ELECTRONICS INC	1,102	74,100.00	81,658,200.00	
KANGWON LAND INC	869	22,950.00	19,943,550.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	499	17,300.00	8,632,700.00	
KAKAO CORP	573	324,500.00	185,938,500.00	
NAVER CORP	1,247	281,000.00	350,407,000.00	
NCSOFT CORP	168	802,000.00	134,736,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	193	124,500.00	24,028,500.00	
PEARL ABYSS CORP	70	189,200.00	13,244,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	116,000.00	13,108,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	233	70,100.00	16,333,300.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	100	59,800.00	5,980,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	78,200.00	6,256,000.00	
SHINSEGAE INC	54	208,000.00	11,232,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	128,000.00	7,296,000.00	
E-MART INC	157	110,500.00	17,348,500.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	35,250.00	6,873,750.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	369,000.00	32,472,000.00	

KT&G CORP	1,195	80,400.00	96,078,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	133,000.00	33,383,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	552,000.00	7,176,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	302	163,500.00	49,377,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	209	53,400.00	11,160,600.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	96	1,323,000.00	127,008,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	698,000.00	10,470,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	708	102,300.00	72,428,400.00	
CELLTRION INC	956	319,000.00	304,964,000.00	
CELLTRION PHARM INC	150	126,700.00	19,005,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	46	250,000.00	11,500,000.00	
HELIXMITH CO LTD	165	56,900.00	9,388,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	169	755,000.00	127,595,000.00	
YUHAN CORP	514	56,500.00	29,041,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	5,080.00	12,928,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	3,100	28,850.00	89,435,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	8,250.00	21,375,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,037	35,400.00	142,909,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	4,683	30,500.00	142,831,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	5,693	8,800.00	50,098,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	317	50,200.00	15,913,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,145.00	7,286,965.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	7,530.00	22,567,410.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	8,630.00	13,290,200.00	
SAMSUNG CARD CO	217	28,100.00	6,097,700.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	28,800.00	23,731,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	482	45,800.00	22,075,600.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	23,150.00	10,440,650.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	322	177,000.00	56,994,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	752	46,300.00	34,817,600.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	190	105,500.00	20,045,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	366	170,500.00	62,403,000.00	
KMW CO LTD	187	71,900.00	13,445,300.00	
LG DISPLAY CO LTD	2,534	12,350.00	31,294,900.00	
LG INNOTEK CO LTD	153	156,000.00	23,868,000.00	

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	584	137,500.00	80,300,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	48,081	54,200.00	2,605,990,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	8,329	47,150.00	392,712,350.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	564	375,500.00	211,782,000.00	
	LG UPLUS CORP	2,330	11,300.00	26,329,000.00	
	SK TELECOM	213	208,000.00	44,304,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,411	19,500.00	47,014,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	25,500.00	5,737,500.00	
	SK HYNIX INC	5,510	83,700.00	461,187,000.00	
韓国ウォン 小計		148,997		8,380,332,245.00 (741,659,403)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	10,000	84.70	847,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	41.85	920,700.00	
	CHINA STEEL CORP	120,000	20.15	2,418,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	36,000	69.80	2,512,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	39,000	79.70	3,108,300.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	52,000	63.10	3,281,200.00	
	TAIWAN CEMENT	47,121	45.00	2,120,445.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	559.00	559,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	25,000	29.20	730,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,111	304.50	642,799.50	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	7.98	135,660.00	
	EVA AIRWAYS CORP	26,023	11.00	286,253.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	10.70	337,585.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	34.60	761,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	15,000	34.50	517,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	326.00	658,520.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	177.00	601,800.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	31.25	312,500.00	
	GIANT MANUFACTURING	3,000	304.00	912,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	316.50	633,000.00	
	POU CHEN	24,000	29.30	703,200.00	
	TATUNG CO LTD	15,000	20.60	309,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,000	710.00	2,130,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	288.00	1,728,000.00	

STANDARD FOODS CORP	3,120	63.00	196,560.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	49,000	71.30	3,493,700.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	51,554	19.10	984,681.40	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	179,000	19.50	3,490,500.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	106,425	28.95	3,081,003.75	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	102,551	23.25	2,384,310.75	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	82,778	20.00	1,655,560.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	110,000	32.15	3,536,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	102,995	10.80	1,112,346.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	85,785	13.45	1,153,808.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	44,672	10.35	462,355.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	91,626	21.05	1,928,727.30	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	43.55	1,524,250.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,997	123.00	1,475,631.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	98,000	18.00	1,764,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	80,000	40.10	3,208,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	129,000	8.75	1,128,750.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	21.00	552,720.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	68,000	42.00	2,856,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	111,835	8.52	952,834.20	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	42.80	256,800.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	48.50	306,520.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	5,000	236.50	1,182,500.00	
ACER INC	22,000	19.85	436,700.00	
ADVANTECH CO LTD	3,000	328.50	985,500.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	7,000	218.00	1,526,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	9.42	810,120.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	215.00	1,505,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	87.00	436,305.00	
COMPAL ELECTRONICS	46,000	18.45	848,700.00	
DELTA ELECTRONICS INC	20,000	184.50	3,690,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	54.20	379,400.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	125,800	80.00	10,064,000.00	
INNOLUX CORP	90,000	8.18	736,200.00	
INVENTEC CORP	28,000	24.80	694,400.00	

	LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,800.00	3,800,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	19,000	46.50	883,500.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	134.50	941,500.00	
	PEGATRON CORP	18,000	61.20	1,101,600.00	
	QUANTA COMPUTER INC	30,000	79.90	2,397,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	43.50	435,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	177.00	531,000.00	
	WISTRON CORP	29,951	34.10	1,021,329.10	
	WIWYNN CORP	1,000	773.00	773,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	17,960	44.50	799,220.00	
	YAGEO CORPORATION	4,198	389.50	1,635,121.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	127.50	765,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	38,000	109.00	4,142,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	63.50	1,079,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	17,000	106.00	1,802,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	33,000	69.90	2,306,700.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	408.00	816,000.00	
	MEDIATEK INC	15,000	675.00	10,125,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	60.40	724,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	6,000	271.50	1,629,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	317.00	317,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	104.50	627,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	360.50	1,802,500.00	
	SILERGY CORP	1,000	1,735.00	1,735,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	248,000	386.00	95,728,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	114,000	19.75	2,251,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	7,000	89.00	623,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	321.00	963,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	13.20	290,400.00	
新台湾ドル 小計		3,262,127		230,012,515.45 (825,744,930)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,798	448.40	3,048,223.20	
	COAL INDIA LTD	9,401	131.60	1,237,171.60	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,566	228.40	1,042,874.40	
	INDIAN OIL CORP LTD	14,264	92.80	1,323,699.20	

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	81.00	2,145,690.00	
PETRONET LNG LTD	4,527	241.25	1,092,138.75	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,830	2,146.15	61,873,504.50	
AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	200.95	1,555,353.00	
ASIAN PAINTS LTD	3,027	1,712.05	5,182,375.35	
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	524.10	1,383,099.90	
GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	582.70	1,883,286.40	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	12,818	156.20	2,002,171.60	
JSW STEEL LTD	9,306	205.00	1,907,730.00	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,165	1,378.65	1,606,127.25	
SHREE CEMENT LTD	83	21,332.75	1,770,618.25	
TATA STEEL LTD	3,946	346.10	1,365,710.60	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,198	3,782.50	4,531,435.00	
UPL LTD	5,324	454.15	2,417,894.60	
VEDANTA LTD	19,986	112.05	2,239,431.30	
HAVELLS INDIA LTD	2,780	606.70	1,686,626.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	4,499	904.40	4,068,895.60	
SIEMENS LTD	766	1,161.10	889,402.60	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,572	309.40	1,414,576.80	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	448.40	700,400.80	
INTERGLOBE AVIATION LTD	699	948.25	662,826.75	
BAJAJ AUTO LTD	881	2,985.50	2,630,225.50	
BHARAT FORGE LTD	1,595	384.10	612,639.50	
BOSCH LTD	73	13,199.35	963,552.55	
EICHER MOTORS LTD	140	20,800.35	2,912,049.00	
HERO MOTOCORP LTD	1,024	2,740.70	2,806,476.80	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	7,702	598.70	4,611,187.40	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,249	6,000.70	7,494,874.30	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,207	95.45	687,908.15	
TATA MOTORS LTD	18,122	103.75	1,880,157.50	
PAGE INDUSTRIES LTD	54	19,454.75	1,050,556.50	
TITAN CO LTD	2,882	1,057.60	3,048,003.20	
JUBILANT FOODWORKS LTD	681	1,725.85	1,175,303.85	
INFO EDGE INDIA LTD	655	3,165.80	2,073,599.00	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	151.70	1,413,388.90	

AVENUE SUPERMARTS LTD	1,602	2,031.40	3,254,302.80	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	626	3,818.45	2,390,349.70	
ITC LTD	35,192	199.60	7,024,323.20	
NESTLE INDIA LTD	238	17,251.85	4,105,940.30	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	4,017	408.45	1,640,743.65	
UNITED SPIRITS LTD	3,058	598.80	1,831,130.40	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,384.20	968,940.00	
DABUR INDIA LTD	5,557	471.50	2,620,125.50	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,680	680.00	2,502,400.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	8,321	2,209.30	18,383,585.30	
MARICO LTD	4,834	357.10	1,726,221.40	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,600	810.65	2,107,690.00	
BIOCON LTD	2,750	415.15	1,141,662.50	
CIPLA LTD	3,668	666.05	2,443,071.40	
DIVI'S LABORATORIES LTD	854	2,349.10	2,006,131.40	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,211	4,065.95	4,923,865.45	
LUPIN LTD	2,363	853.80	2,017,529.40	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	728	1,492.00	1,086,176.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	8,695	485.60	4,222,292.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,325.30	1,116,144.00	
AXIS BANK LTD	21,278	445.60	9,481,476.80	
BANDHAN BANK LTD	3,094	341.35	1,056,136.90	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	16,605	1,841.30	30,574,786.50	
ICICI BANK LTD	48,487	381.80	18,512,336.60	
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	272.60	634,340.20	
STATE BANK OF INDIA	16,134	191.95	3,096,921.30	
BAJAJ FINANCE LTD	1,885	3,251.85	6,129,737.25	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	330	2,465.25	813,532.50	
REC LTD	7,000	106.45	745,150.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	706.85	462,279.90	
BAJAJ FINSERV LTD	402	6,270.30	2,520,660.60	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	6,678	622.40	4,156,387.20	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,977	1,297.55	2,565,256.35	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	440.00	1,639,880.00	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,755	867.40	3,257,087.00	

	DLF LTD	4,542	138.90	630,883.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,236	679.95	7,639,918.20	
	INFOSYS LTD	34,508	922.85	31,845,707.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	9,183	2,157.40	19,811,404.20	
	TECH MAHINDRA LTD	4,862	652.60	3,172,941.20	
	WIPRO LTD	11,992	270.55	3,244,435.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	24,902	559.45	13,931,423.90	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	195.70	469,680.00	
	GAIL INDIA LTD	17,471	99.55	1,739,238.05	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	2,160	407.55	880,308.00	
	NTPC LTD	25,698	89.40	2,297,401.20	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	17,317	182.00	3,151,694.00	
インドルピー 小計		623,578		384,364,815.05 (545,798,037)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	3,800	16.23	61,674.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.09	101,574.00	
	INDUSTRIES QATAR	17,213	8.08	139,149.89	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	3.91	85,190.40	
	MASRAF AL RAYAN	33,102	3.88	128,435.76	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	5,838	8.25	48,198.52	
	QATAR ISLAMIC BANK	12,416	16.00	198,656.00	
	QATAR NATIONAL BANK	46,167	18.09	835,161.03	
	BARWA REAL ESTATE CO	14,730	3.25	47,872.50	
	OOREDOO QPSC	5,987	6.68	40,005.13	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,015	16.80	101,052.00	
カタールリアル 小計		215,628		1,786,969.23 (51,875,716)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	136.92	383,376.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	500	1,433.16	716,580.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	4,253	577.38	2,455,597.14	
	GOLD FIELDS LTD	9,048	210.00	1,900,080.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,260	155.00	1,280,300.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	703	540.01	379,627.03	
	NORTHAM PLATINUM LTD	3,813	139.00	530,007.00	
	SASOL LTD	5,312	137.73	731,621.76	

	SIBANYE STILLWATER LTD	23,563	46.91	1,105,340.33	
	BIDVEST GROUP LTD	2,876	137.70	396,025.20	
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,613	107.00	493,591.00	
	MR PRICE GROUP LTD	2,802	126.29	353,864.58	
	NASPERS LTD-N SHS	4,489	3,079.50	13,823,875.50	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	10.54	104,883.54	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	7,365	30.67	225,884.55	
	BID CORP LTD	3,419	278.54	952,328.26	
	CLICKS GROUP LTD	2,589	216.90	561,554.10	
	PICK N PAY STORES LTD	2,743	44.95	123,297.85	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,619	100.48	464,117.12	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	1,441	165.41	238,355.81	
	TIGER BRANDS LTD	1,150	175.00	201,250.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	18.71	238,795.73	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,574	138.09	493,533.66	
	ABSA GROUP LTD	7,463	84.93	633,832.59	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	486	869.32	422,489.52	
	NEDBANK GROUP LTD	3,923	113.00	443,299.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	13,209	109.00	1,439,781.00	
	FIRSTRAND LTD	49,293	39.00	1,922,427.00	
	PSG GROUP LTD	1,806	159.95	288,869.70	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,613	319.76	515,772.88	
	REMGRO LTD	5,030	91.90	462,257.00	
	DISCOVERY LTD	4,144	108.94	451,447.36	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	17.50	176,435.00	
	OLD MUTUAL LTD	48,784	12.26	598,091.84	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,580	31.25	174,375.00	
	SANLAM LTD	19,161	61.30	1,174,569.30	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,106	91.52	375,781.12	
	MTN GROUP LTD	17,388	66.40	1,154,563.20	
	VODACOM GROUP LTD	6,615	128.29	848,638.35	
南アフリカランド 小計		321,329		39,236,516.02 (249,544,241)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	28,809	5.11	147,213.99	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	3.78	77,263.20	

	EMIRATES NBD PJSC	11,600	8.93	103,588.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	27,831	10.68	297,235.08	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	29,017	1.72	49,909.24	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.38	42,330.12	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	36,755	2.60	95,563.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	17,750	16.90	299,975.00	
アラブディルハム 小計		202,876		1,113,077.63 (32,123,420)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.20	12,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.00	47,200.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	15.48	23,220.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.84	3,124.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.80	2,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.50	22,950.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	7.94	19,850.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.27	1,881.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.54	24,198.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	520	4.17	2,168.40	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	30.30	27,270.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.10	9,018.10	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.23	6,783.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.64	2,059.20	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	58.85	164,780.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	4.91	39,280.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.15	2,835.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	51.97	62,364.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	11.75	34,075.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.22	28,696.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	12.34	6,170.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	5.02	17,570.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	7.76	10,864.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	51.30	25,650.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	15.80	57,196.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.52	20,514.00	
	HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.20	3,300.00	

HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	25.70	28,270.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.42	15,470.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.16	20,764.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	4.86	17,010.00	
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	10.69	20,311.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	87.49	26,247.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	15.23	4,569.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	55.33	11,066.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.45	2,580.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	22.43	38,131.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.72	1,904.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.14	15,408.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	16.31	55,454.00	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	6.94	14,574.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,120	40.45	45,304.00	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	22.09	30,926.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.33	23,300.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	34.38	27,504.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.69	25,718.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	99.60	29,880.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.47	16,656.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.67	2,202.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	18.43	20,273.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	24.75	4,950.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.20	21,300.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.16	3,240.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.76	7,488.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	62.11	142,853.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	73.32	29,328.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	14.96	17,952.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	18.75	31,875.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	69.57	41,742.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	38.68	10,056.80	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	7.08	16,284.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	14.35	5,740.00	

ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	10.93	4,372.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	8,800	5.63	49,544.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	18.97	18,970.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	34.21	47,894.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	23.08	9,232.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.49	31,470.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	65.80	6,580.00	
AVICOPTER PLC-A	500	54.30	27,150.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	30.18	42,252.00	
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	3.03	30,300.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.60	17,480.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	17.44	1,744.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	7.94	2,382.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.62	3,310.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	15.48	13,932.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.73	2,865.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	7,400	9.02	66,748.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.59	51,428.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	10,300	5.06	52,118.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	33.99	3,399.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.06	150,788.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,300	198.68	258,284.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.05	3,075.00	
CRRC CORP LTD-A	18,500	5.86	108,410.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	9.64	5,784.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	56.08	85,241.60	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.65	2,773.05	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	24.06	24,060.00	
GUOCHENG MINING CO LTD-A	900	22.00	19,800.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	53.25	31,950.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	37.52	11,256.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	11.29	15,806.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	59.19	61,320.84	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	11.15	28,990.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.79	5,022.00	

NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	900	23.57	21,213.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	20.91	74,000.49	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	4.25	17,000.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	21.10	130,820.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.12	17,472.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.37	4,296.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	6.02	1,806.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	48.69	34,083.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	15.80	20,540.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	20.88	27,144.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	9.17	3,668.00	
TBEA CO LTD-A	400	8.20	3,280.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	2,700	16.16	43,632.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	6.32	6,952.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	9.30	2,790.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	10.93	4,372.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	27.18	5,436.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	82.28	34,557.60	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	21.80	65,182.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	13.61	17,693.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	13.09	2,618.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	8.24	7,416.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	8.59	22,334.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	23.07	32,298.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	60.40	48,320.00	
AIR CHINA LTD-A	800	6.96	5,568.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.42	5,746.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.42	49,322.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.09	4,908.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.44	71,484.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	14.19	11,352.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	9.25	6,475.00	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.99	21,945.00	
S F HOLDING CO LTD-A	1,800	63.55	114,390.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	68.37	20,511.00	

SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.41	4,410.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	8.60	16,340.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.31	6,620.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	38.83	3,883.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	24.00	28,080.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	6.51	20,832.00	
BYD CO LTD -A	800	83.00	66,400.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	135.05	27,010.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	11.13	5,565.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	23.32	4,664.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	20.62	28,868.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	22.11	26,532.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	32.91	26,328.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	3,510	17.96	63,039.60	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	23.04	2,304.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	21.22	2,122.00	
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	6.79	13,580.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	57.16	80,024.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,800	16.57	46,396.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	35.43	3,543.00	
JOYOUNG CO LTD -A	600	35.22	21,132.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	18.46	16,614.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	87.09	12,192.60	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	22.58	9,032.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	6.10	37,820.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	59.55	17,865.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	8.30	3,320.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	84.00	25,200.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	18.63	14,904.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	31.45	31,450.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	37.55	22,530.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.17	7,887.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	18.40	19,872.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	13.80	17,940.00	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	24.35	19,480.00	

CHINA FILM CO LTD-A	200	14.70	2,940.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.45	2,090.00	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.38	1,238.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	5.98	72,358.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	573.98	57,398.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	20.15	4,030.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.43	14,063.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	64.66	84,704.60	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	19.13	21,043.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.98	2,994.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	37.77	50,989.50	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	17.72	15,948.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	43.14	38,826.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	21.00	8,400.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	11.33	33,990.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,300	204.54	265,902.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	27.91	5,582.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.99	49,950.00	
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	10.29	33,957.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.50	27,000.00	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	104.45	20,890.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	86.00	36,120.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	9.28	28,768.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	61.56	43,092.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	181.25	54,375.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	48.40	24,200.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.87	4,935.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	62.29	37,374.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	7.71	18,504.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	48.60	19,440.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	69.60	27,840.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	36.68	25,676.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,800	137.07	246,726.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	27.71	24,939.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	54.46	70,798.00	

HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	18.80	47,000.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	51.30	61,560.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	34.03	142,926.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	41.90	41,900.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,000	130.14	130,140.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	19.33	38,660.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	64.58	19,374.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	80.17	24,051.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	800	1,595.30	1,276,240.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	113.98	113,980.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,040	89.25	182,070.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	31.43	81,718.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	400	162.88	65,152.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	66.00	26,400.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	500	56.02	28,010.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,300	23.61	77,913.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	80.33	8,033.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	2,760	23.43	64,666.80	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,400	201.39	483,336.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	16.97	18,667.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	21.06	27,378.00	
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	23.98	23,980.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	166.47	16,647.00	
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	43.31	25,986.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	2,221	44.00	97,724.00	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	156.78	15,678.00	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	45.15	9,030.00	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	38.68	15,472.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	91.35	18,270.00	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	300	93.50	28,050.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	26.12	6,268.80	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	69.00	26,220.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	34.43	17,215.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	17.60	3,520.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	42.01	29,407.00	

MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	14.99	7,195.20	
OVCTEK CHINA INC-A	300	60.27	18,081.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	19.00	3,800.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	332.39	232,673.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	165.88	16,588.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	22.59	23,493.60	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	23.30	20,970.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	220.00	44,000.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,080	42.27	45,651.60	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	26.34	5,268.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	135.16	40,548.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	151.16	45,348.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	200	447.22	89,444.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	45.46	27,276.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	29.13	2,913.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	900	149.10	134,190.00	
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	32.98	19,788.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	34.52	3,452.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	34.28	6,856.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	104.99	31,497.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	53.88	42,026.40	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	24.62	17,234.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	2,980	94.79	282,474.20	
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	16.78	16,780.00	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	26.07	23,463.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	19.41	31,056.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	51.23	25,615.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	45.65	29,672.50	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	26.76	6,957.60	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	48.12	57,744.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	9.27	26,883.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	23.88	21,492.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	206.50	61,950.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	32.26	3,226.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	29.08	29,080.00	

SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	21.35	4,270.00	
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	5.23	11,506.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.90	2,580.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	65.80	39,480.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	1,440	107.05	154,152.00	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	29.02	29,020.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	105.75	52,875.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	188.99	56,697.00	
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.65	12,430.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	37.27	45,096.70	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	28.55	50,819.00	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	63.00	25,200.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.23	162,469.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	4.79	35,925.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	8.21	12,315.00	
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.35	54,605.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.77	129,744.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	9.36	4,680.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.97	19,104.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	7.76	18,624.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	30.08	102,272.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.13	71,625.30	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.12	3,072.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.12	18,360.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	18,400	3.78	69,552.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	13,000	34.60	449,800.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	16,400	5.52	90,528.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.33	27,852.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	4.98	180,276.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	15.66	214,542.00	
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	13.50	176,850.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	10.42	202,148.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.76	4,284.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	13.05	19,575.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	8.63	6,904.00	

CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	12.75	35,700.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,600	20.70	53,820.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,900	28.50	196,650.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	1,300	45.83	59,579.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	12.89	2,578.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,920	25.01	148,059.20	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	23.46	75,072.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	10.01	5,005.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.36	60,192.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	15.15	40,905.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	12.90	7,740.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,500	18.35	64,225.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	9.97	4,985.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	3,700	13.80	51,060.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	140.40	28,080.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	7.80	3,120.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	20.53	112,915.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	12.03	3,609.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	7.87	5,509.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	15.16	24,256.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	10.59	31,770.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	11.27	58,604.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	4.16	13,312.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	14.32	8,592.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.51	13,775.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.99	3,196.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	5.49	83,448.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	13.63	4,089.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.79	2,937.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.43	20,634.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	7.01	30,143.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.74	4,870.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	15.69	20,397.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,200	35.40	42,480.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	29.37	129,228.00	

HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.62	3,372.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	51.89	46,701.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	7.06	24,710.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	6,800	77.00	523,600.00	
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	6.70	14,740.00	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.17	14,178.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	17.84	25,511.20	
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	35.26	24,682.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	17.08	61,488.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	6,500	27.03	175,695.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.79	2,716.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	32.79	26,232.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	13.80	45,540.00	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	5.44	14,688.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	7.69	9,228.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.82	30,442.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	9.10	6,370.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	4.17	5,004.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	15.87	131,721.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	8.26	4,956.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	20.31	18,279.00	
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	5.37	13,425.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.32	3,984.00	
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.97	23,698.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.51	20,181.00	
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	3.47	17,697.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	18.84	5,652.00	
AISINO CORP-A	200	17.49	3,498.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	400	49.46	19,784.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	36.29	3,629.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	25.16	17,612.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	90.85	18,170.00	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	22.70	15,890.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	11.82	4,728.00	
GLODON CO LTD-A	500	70.85	35,425.00	

HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	102.31	70,491.59	
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	35.95	35,950.00	
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	16.66	8,330.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	215.00	21,500.00	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	2.98	2,324.40	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	70.49	28,196.00	
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	19.14	7,656.00	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	94.03	28,209.00	
VENUSTECH GROUP INC-A	400	39.07	15,628.00	
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	8.58	7,722.00	
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	900	27.55	24,795.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	43.75	100,975.00	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	32.10	19,260.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	44.24	39,816.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	4.52	92,660.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	26.66	18,662.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	16.01	41,626.00	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	41.95	46,984.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	28.01	30,811.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	14.16	53,808.00	
GOERTEK INC -A	2,000	32.95	65,900.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	13.46	29,612.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	10.51	26,275.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	13.54	4,062.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	102.36	51,180.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	5,500	33.63	184,965.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	16.08	3,216.00	
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	5.09	14,252.00	
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	13.26	11,934.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	36.87	22,122.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	28.37	36,881.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.33	14,559.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	4,133	53.10	219,462.30	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	178.59	35,718.00	
NINESTAR CORP-A	100	35.80	3,580.00	

OFILM GROUP CO LTD-A	400	18.00	7,200.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	27.17	27,170.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	151.50	42,420.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	23.40	23,400.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	49.09	44,181.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	26.00	18,200.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	39.66	27,762.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	15.77	4,731.00	
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	2.73	2,184.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,340	42.60	57,084.00	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	20.15	26,195.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	21.59	17,272.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	135.85	95,095.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	39.16	53,257.60	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	23.49	37,584.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	43.15	17,260.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	61.73	18,519.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	19.59	47,016.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	56.30	28,150.00	
ZTE CORP-A	2,700	37.92	102,384.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	5.10	70,380.00	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	4.97	12,425.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.31	18,533.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	12,400	18.20	225,680.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	1.98	5,544.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.79	4,927.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.66	3,728.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.71	2,226.00	
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.62	12,838.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.43	9,273.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.54	16,588.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.59	3,913.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.51	3,306.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.31	6,517.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	2.96	12,728.00	

	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	225.59	31,582.60	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	17.04	34,080.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	51.20	133,120.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	24.29	38,864.00	
	SG MICRO CORP-A	100	345.15	34,515.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	206.11	51,527.50	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	23.67	54,441.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	15.19	28,861.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	24.00	19,200.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	116.75	58,375.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	16.10	17,710.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	400	199.35	79,740.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	11.24	16,860.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	23.38	21,042.00	
オフショア人民元 小計		1,101,144		19,346,391.47 (292,323,975)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	12.82	20,858.14	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	12,204	32.75	399,681.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	52.00	61,048.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	10.30	38,954.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	14.68	51,380.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	2,161	77.40	167,261.40	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	4,523	35.70	161,471.10	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	9,130	87.60	799,788.00	
	SAUDI CEMENT	565	56.30	31,809.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	1,544	18.04	27,853.76	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	8.14	66,243.32	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,789	51.20	142,796.80	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	80.20	33,844.40	
	JARIR MARKETING CO	611	149.00	91,039.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	116.00	47,096.00	
	ALMARAI CO	2,209	53.70	118,623.30	
	SAVOLA	2,712	46.85	127,057.20	
	AL RAJHI BANK	12,412	58.90	731,066.80	
	ALINMA BANK	8,696	14.64	127,309.44	

	ARAB NATIONAL BANK	6,307	19.24	121,346.68	
	BANK AL-JAZIRA	3,069	12.16	37,319.04	
	BANK ALBILAD	3,925	23.50	92,237.50	
	BANQUE SAUDI FRANSI	6,113	30.10	184,001.30	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	14,926	35.90	535,843.40	
	RIYAD BANK	13,885	16.80	233,268.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	10,048	26.40	265,267.20	
	SAUDI BRITISH BANK	6,357	24.32	154,602.24	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	536	117.00	62,712.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	80.80	53,408.80	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	7.26	28,618.92	
	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	7.09	30,451.55	
	ETIHAD ETISALAT CO	3,984	27.05	107,767.20	
	SAUDI TELECOM CO	6,089	97.10	591,241.90	
	SAUDI ELECTRICITY CO	9,159	15.72	143,979.48	
サウジアラビアリアル 小計		171,901		5,887,246.97 (166,373,599)	
合　計		24,800,415		6,562,354,201 (6,562,354,201)	

(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	34,100	606,298.00	
	メキシコペソ 小計		34,100	606,298.00 (2,885,978)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	31,594	427,782.76	
	南アフリカランド 小計		31,594	427,782.76 (2,720,698)	
合計				5,606,676 (5,606,676)	

(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	57銘柄	100.0%	—	16.3%
メキシコペソ	株式	23銘柄	97.4%	—	1.6%
	投資証券	1銘柄	—	2.6%	0.0%
ブラジルレアル	株式	56銘柄	100.0%	—	5.5%
チリペソ	株式	16銘柄	100.0%	—	0.6%
コロンビアペソ	株式	5銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式	4銘柄	100.0%	—	0.1%
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	15銘柄	100.0%	—	0.7%
香港ドル	株式	205銘柄	100.0%	—	23.9%
マレーシアリンギット	株式	39銘柄	100.0%	—	1.8%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%	—	2.1%
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	22銘柄	100.0%	—	1.4%
韓国ウォン	株式	105銘柄	100.0%	—	11.3%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%	—	12.6%
インドルピー	株式	86銘柄	100.0%	—	8.3%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%	—	0.8%
南アフリカランド	株式	39銘柄	98.9%	—	3.8%
	投資証券	1銘柄	—	1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式	8銘柄	100.0%	—	0.5%
オフショア人民元	株式	461銘柄	100.0%	—	4.5%
サウジアラビアリアル	株式	34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。

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	707,891
コール・ローン	607,497,408
国債証券	70,823,456,760
地方債証券	4,464,013,900
特殊債券	5,422,360,819
社債券	3,506,701,000
未収利息	140,457,076
前払費用	14,452,731
流動資産合計	84,979,647,585
資産合計	84,979,647,585
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,256,000
未払利息	1,647
流動負債合計	10,257,647
負債合計	10,257,647
純資産の部	
元本等	
元本	80,757,065,940
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,212,323,998
元本等合計	84,969,389,938
純資産合計	84,969,389,938
負債純資産合計	84,979,647,585

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 7月27日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	67,774,379,684円
期中追加設定元本額	76,762,565,706円
期中一部解約元本額	63,779,879,450円
期末元本額	80,757,065,940円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	5,980,983,874円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,964,043,553円
りそなラップ型ファンド（成長型）	350,101,001円
ＤＣりそな　グローバルバランス	400,696,997円
つみたてバランスファンド	1,474,116,724円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,099,549,046円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	220,947,305円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	51,553,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,226,977円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	4,532,123円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	475,408円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	153,646円
リスクコントロール・オープン	51,075,428円
ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	758,551,102円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	45,642,293,152円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	785,467,874円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	341,188,044円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	236,133,349円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	85,132,911円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	3,417,471,336円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	2,449,822,255円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	1,555,728,332円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	1,001,854,612円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	3,195,138,463円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	519,535,603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）	9,231,726円
りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	8,010,693,098円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	137,368,584円
２．　計算日における受益権の総数	
	80,757,065,940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	1.0522円
(10,000口当たり純資産額)	(10,522円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在
1.金融商品に対する取組方針 **当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。** **2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク** **当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。** **これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。** **3.金融商品に係るリスク管理体制** **運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。** **また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。**

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△902,153,760
地方債証券	△24,011,100
特殊債券	△33,464,083
社債券	△26,991,000
合計	△986,619,943

(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４０３回利付国債（２年）	280,000,000	280,736,400	
	第４０４回利付国債（２年）	420,000,000	421,197,000	
	第４０５回利付国債（２年）	200,000,000	200,624,000	
	第４０６回利付国債（２年）	250,000,000	250,822,500	
	第４０７回利付国債（２年）	330,000,000	331,155,000	
	第４０８回利付国債（２年）	610,000,000	612,269,200	
	第４０９回利付国債（２年）	180,000,000	180,709,200	
	第４１０回利付国債（２年）	410,000,000	411,664,600	
	第４１１回利付国債（２年）	440,000,000	441,958,000	

第４１２回利付国債（２年）	330,000,000	331,481,700	
第４１３回利付国債（２年）	550,000,000	552,486,000	
第１２９回利付国債（５年）	450,000,000	451,318,500	
第１３０回利付国債（５年）	240,000,000	240,856,800	
第１３１回利付国債（５年）	360,000,000	361,479,600	
第１３２回利付国債（５年）	40,000,000	40,186,000	
第１３３回利付国債（５年）	1,280,000,000	1,286,745,600	
第１３４回利付国債（５年）	1,060,000,000	1,066,243,400	
第１３５回利付国債（５年）	860,000,000	865,590,000	
第１３６回利付国債（５年）	850,000,000	856,179,500	
第１３７回利付国債（５年）	510,000,000	514,029,000	
第１３８回利付国債（５年）	860,000,000	867,335,800	
第１３９回利付国債（５年）	780,000,000	786,996,600	
第１４０回利付国債（５年）	1,070,000,000	1,080,058,000	
第１４１回利付国債（５年）	620,000,000	626,076,000	
第１４２回利付国債（５年）	680,000,000	686,915,600	
第１４３回利付国債（５年）	450,000,000	454,725,000	
第１回利付国債（４０年）	40,000,000	59,031,200	
第２回利付国債（４０年）	100,000,000	143,493,000	
第３回利付国債（４０年）	110,000,000	158,892,800	
第４回利付国債（４０年）	150,000,000	218,338,500	
第５回利付国債（４０年）	150,000,000	211,761,000	
第６回利付国債（４０年）	170,000,000	236,789,600	
第７回利付国債（４０年）	190,000,000	254,926,800	
第８回利付国債（４０年）	200,000,000	251,296,000	
第９回利付国債（４０年）	270,000,000	254,142,900	
第１０回利付国債（４０年）	300,000,000	331,515,000	
第１１回利付国債（４０年）	240,000,000	257,505,600	
第１２回利付国債（４０年）	250,000,000	242,537,500	
第１３回利付国債（４０年）	50,000,000	48,476,000	
第３１７回利付国債（１０年）	40,000,000	40,577,200	
第３１８回利付国債（１０年）	366,000,000	370,860,480	
第３１９回利付国債（１０年）	240,000,000	244,216,800	
第３２０回利付国債（１０年）	202,000,000	205,266,340	
第３２１回利付国債（１０年）	241,000,000	245,566,950	
第３２２回利付国債（１０年）	220,000,000	223,806,000	
第３２３回利付国債（１０年）	340,000,000	346,752,400	
第３２４回利付国債（１０年）	183,000,000	186,286,680	
第３２５回利付国債（１０年）	330,000,000	336,718,800	
第３２６回利付国債（１０年）	280,000,000	285,689,600	
第３２７回利付国債（１０年）	387,000,000	395,796,510	
第３２８回利付国債（１０年）	411,000,000	419,125,470	

	第３２９回利付国債（１０年）	297,000,000	305,161,560	
	第３３０回利付国債（１０年）	257,000,000	264,720,280	
	第３３１回利付国債（１０年）	90,000,000	92,134,800	
	第３３２回利付国債（１０年）	532,000,000	545,619,200	
	第３３３回利付国債（１０年）	225,000,000	231,140,250	
	第３３４回利付国債（１０年）	261,000,000	268,563,780	
	第３３５回利付国債（１０年）	345,000,000	354,135,600	
	第３３６回利付国債（１０年）	210,000,000	215,896,800	
	第３３７回利付国債（１０年）	170,000,000	173,270,800	
	第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	646,472,120	
	第３３９回利付国債（１０年）	385,000,000	394,856,000	
	第３４０回利付国債（１０年）	814,000,000	836,140,800	
	第３４１回利付国債（１０年）	520,000,000	532,006,800	
	第３４２回利付国債（１０年）	190,000,000	192,428,200	
	第３４３回利付国債（１０年）	680,000,000	689,084,800	
	第３４４回利付国債（１０年）	690,000,000	699,618,600	
	第３４５回利付国債（１０年）	640,000,000	649,280,000	
	第３４６回利付国債（１０年）	870,000,000	883,110,900	
	第３４７回利付国債（１０年）	190,000,000	192,973,500	
	第３４８回利付国債（１０年）	470,000,000	477,454,200	
	第３４９回利付国債（１０年）	390,000,000	396,255,600	
	第３５０回利付国債（１０年）	620,000,000	629,789,800	
	第３５１回利付国債（１０年）	470,000,000	477,289,700	
	第３５２回利付国債（１０年）	790,000,000	801,660,400	
	第３５３回利付国債（１０年）	510,000,000	517,104,300	
	第３５４回利付国債（１０年）	640,000,000	648,332,800	
	第３５５回利付国債（１０年）	680,000,000	688,187,200	
	第３５６回利付国債（１０年）	910,000,000	920,428,600	
	第３５７回利付国債（１０年）	760,000,000	767,858,400	
	第３５８回利付国債（１０年）	590,000,000	595,687,600	
	第１回利付国債（３０年）	60,000,000	75,471,600	
	第７回利付国債（３０年）	40,000,000	50,242,800	
	第１１回利付国債（３０年）	50,000,000	59,766,500	
	第１２回利付国債（３０年）	40,000,000	49,992,400	
	第１３回利付国債（３０年）	90,000,000	111,573,900	
	第１４回利付国債（３０年）	60,000,000	77,789,400	
	第１５回利付国債（３０年）	160,000,000	210,179,200	
	第１６回利付国債（３０年）	100,000,000	131,735,000	
	第１７回利付国債（３０年）	50,000,000	65,348,000	
	第１８回利付国債（３０年）	60,000,000	77,760,000	
	第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	129,906,000	
	第２０回利付国債（３０年）	100,000,000	133,228,000	
	第２１回利付国債（３０年）	90,000,000	117,529,200	

第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	66,987,000	
第２３回利付国債（３０年）	160,000,000	214,873,600	
第２４回利付国債（３０年）	100,000,000	134,713,000	
第２５回利付国債（３０年）	100,000,000	131,771,000	
第２６回利付国債（３０年）	145,000,000	193,883,850	
第２７回利付国債（３０年）	215,000,000	292,617,150	
第２８回利付国債（３０年）	110,000,000	150,425,000	
第２９回利付国債（３０年）	70,000,000	94,972,500	
第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	255,513,900	
第３１回利付国債（３０年）	130,000,000	173,313,400	
第３２回利付国債（３０年）	215,000,000	292,058,150	
第３３回利付国債（３０年）	210,000,000	274,438,500	
第３４回利付国債（３０年）	255,000,000	344,497,350	
第３５回利付国債（３０年）	316,000,000	415,799,120	
第３６回利付国債（３０年）	285,000,000	376,205,700	
第３７回利付国債（３０年）	320,000,000	417,232,000	
第３８回利付国債（３０年）	220,000,000	283,067,400	
第３９回利付国債（３０年）	210,000,000	275,205,000	
第４０回利付国債（３０年）	155,000,000	199,914,350	
第４１回利付国債（３０年）	195,000,000	247,646,100	
第４２回利付国債（３０年）	190,000,000	241,528,000	
第４３回利付国債（３０年）	60,000,000	76,346,400	
第４４回利付国債（３０年）	180,000,000	229,257,000	
第４５回利付国債（３０年）	220,000,000	270,483,400	
第４６回利付国債（３０年）	220,000,000	270,943,200	
第４７回利付国債（３０年）	250,000,000	314,012,500	
第４８回利付国債（３０年）	253,000,000	306,259,030	
第４９回利付国債（３０年）	230,000,000	278,530,000	
第５０回利付国債（３０年）	250,000,000	267,045,000	
第５１回利付国債（３０年）	230,000,000	217,704,200	
第５２回利付国債（３０年）	230,000,000	228,677,500	
第５３回利付国債（３０年）	220,000,000	223,823,600	
第５４回利付国債（３０年）	230,000,000	245,357,100	
第５５回利付国債（３０年）	120,000,000	127,927,200	
第５６回利付国債（３０年）	220,000,000	234,374,800	
第５７回利付国債（３０年）	230,000,000	245,147,800	
第５８回利付国債（３０年）	350,000,000	372,785,000	
第５９回利付国債（３０年）	220,000,000	228,533,800	
第６０回利付国債（３０年）	190,000,000	207,217,800	
第６１回利付国債（３０年）	220,000,000	228,384,200	
第６２回利付国債（３０年）	220,000,000	216,739,600	
第６３回利付国債（３０年）	210,000,000	201,142,200	

	第６４回利付国債（３０年）	180,000,000	172,135,800	
	第６５回利付国債（３０年）	150,000,000	143,398,500	
	第６６回利付国債（３０年）	230,000,000	219,525,800	
	第５２回利付国債（２０年）	190,000,000	194,938,100	
	第５３回利付国債（２０年）	20,000,000	20,630,000	
	第５４回利付国債（２０年）	180,000,000	185,922,000	
	第５５回利付国債（２０年）	100,000,000	103,548,000	
	第５６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,407,700	
	第５７回利付国債（２０年）	110,000,000	114,275,700	
	第５８回利付国債（２０年）	100,000,000	104,406,000	
	第５９回利付国債（２０年）	40,000,000	41,775,200	
	第６０回利付国債（２０年）	30,000,000	31,114,800	
	第６１回利付国債（２０年）	50,000,000	51,519,000	
	第６２回利付国債（２０年）	80,000,000	82,198,400	
	第６３回利付国債（２０年）	60,000,000	63,393,600	
	第６４回利付国債（２０年）	120,000,000	127,760,400	
	第６５回利付国債（２０年）	380,000,000	406,527,800	
	第６７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,494,200	
	第６８回利付国債（２０年）	90,000,000	97,713,000	
	第６９回利付国債（２０年）	60,000,000	64,922,400	
	第７０回利付国債（２０年）	110,000,000	120,920,800	
	第７１回利付国債（２０年）	100,000,000	109,145,000	
	第７２回利付国債（２０年）	210,000,000	229,576,200	
	第７３回利付国債（２０年）	180,000,000	196,956,000	
	第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	110,392,000	
	第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	109,458,000	
	第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,985,000	
	第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	54,960,500	
	第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	22,082,600	
	第８０回利付国債（２０年）	90,000,000	99,814,500	
	第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	33,294,300	
	第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	189,548,300	
	第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	11,206,000	
	第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	133,819,200	
	第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	168,921,000	
	第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	113,751,000	
	第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	101,863,800	
	第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	211,582,650	
	第８９回利付国債（２０年）	120,000,000	136,530,000	
	第９０回利付国債（２０年）	170,000,000	194,427,300	
	第９１回利付国債（２０年）	80,000,000	91,990,400	
	第９２回利付国債（２０年）	255,000,000	291,493,050	
	第９３回利付国債（２０年）	80,000,000	91,358,400	

第９４回利付国債（２０年）	140,000,000	160,813,800	
第９５回利付国債（２０年）	185,000,000	216,129,950	
第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	80,805,200	
第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	151,689,200	
第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	81,174,100	
第９９回利付国債（２０年）	85,000,000	99,009,700	
第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	177,751,160	
第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	23,851,200	
第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	173,711,450	
第１０３回利付国債（２０年）	100,000,000	119,006,000	
第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	11,741,500	
第１０５回利付国債（２０年）	12,000,000	14,139,600	
第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	47,460,000	
第１０７回利付国債（２０年）	80,000,000	94,583,200	
第１０８回利付国債（２０年）	220,000,000	256,390,200	
第１０９回利付国債（２０年）	80,000,000	93,501,600	
第１１０回利付国債（２０年）	195,000,000	231,295,350	
第１１１回利付国債（２０年）	50,000,000	59,972,000	
第１１２回利付国債（２０年）	205,000,000	244,056,600	
第１１３回利付国債（２０年）	85,000,000	101,560,550	
第１１４回利付国債（２０年）	160,000,000	191,753,600	
第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	120,787,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	169,702,400	
第１１７回利付国債（２０年）	225,000,000	270,567,000	
第１１８回利付国債（２０年）	131,000,000	156,694,340	
第１１９回利付国債（２０年）	150,000,000	176,455,500	
第１２０回利付国債（２０年）	200,000,000	231,322,000	
第１２１回利付国債（２０年）	205,000,000	243,906,950	
第１２２回利付国債（２０年）	190,000,000	224,137,300	
第１２３回利付国債（２０年）	265,000,000	321,521,850	
第１２４回利付国債（２０年）	140,000,000	168,411,600	
第１２５回利付国債（２０年）	120,000,000	147,315,600	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	120,645,000	
第１２７回利付国債（２０年）	70,000,000	83,710,200	
第１２８回利付国債（２０年）	225,000,000	269,669,250	
第１２９回利付国債（２０年）	180,000,000	213,787,800	
第１３０回利付国債（２０年）	180,000,000	214,326,000	
第１３１回利付国債（２０年）	170,000,000	200,540,500	
第１３２回利付国債（２０年）	170,000,000	200,989,300	
第１３３回利付国債（２０年）	245,000,000	292,427,100	
第１３４回利付国債（２０年）	205,000,000	245,110,300	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	47,366,000	

	第１３６回利付国債（２０年）	40,000,000	46,905,600	
	第１３７回利付国債（２０年）	170,000,000	201,739,000	
	第１３８回利付国債（２０年）	90,000,000	104,688,900	
	第１３９回利付国債（２０年）	210,000,000	246,739,500	
	第１４０回利付国債（２０年）	380,000,000	451,614,800	
	第１４１回利付国債（２０年）	185,000,000	220,301,700	
	第１４２回利付国債（２０年）	150,000,000	180,451,500	
	第１４３回利付国債（２０年）	245,000,000	289,259,250	
	第１４４回利付国債（２０年）	230,000,000	268,692,900	
	第１４５回利付国債（２０年）	405,000,000	484,108,650	
	第１４６回利付国債（２０年）	400,000,000	479,012,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	335,000,000	397,487,550	
	第１４８回利付国債（２０年）	405,000,000	475,870,950	
	第１４９回利付国債（２０年）	380,000,000	447,089,000	
	第１５０回利付国債（２０年）	370,000,000	430,791,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	445,000,000	506,209,750	
	第１５２回利付国債（２０年）	460,000,000	523,581,200	
	第１５３回利付国債（２０年）	290,000,000	334,448,300	
	第１５４回利付国債（２０年）	188,000,000	214,222,240	
	第１５５回利付国債（２０年）	350,000,000	388,342,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	430,000,000	437,731,400	
	第１５７回利付国債（２０年）	240,000,000	236,536,800	
	第１５８回利付国債（２０年）	300,000,000	309,477,000	
	第１５９回利付国債（２０年）	330,000,000	345,199,800	
	第１６０回利付国債（２０年）	350,000,000	371,602,000	
	第１６１回利付国債（２０年）	190,000,000	198,527,200	
	第１６２回利付国債（２０年）	280,000,000	292,504,800	
	第１６３回利付国債（２０年）	300,000,000	313,068,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	490,000,000	502,627,300	
	第１６５回利付国債（２０年）	290,000,000	297,073,100	
	第１６６回利付国債（２０年）	490,000,000	518,821,800	
	第１６７回利付国債（２０年）	290,000,000	296,493,100	
	第１６８回利付国債（２０年）	350,000,000	351,218,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	280,000,000	275,564,800	
	第１７０回利付国債（２０年）	370,000,000	363,739,600	
	第１７１回利付国債（２０年）	250,000,000	245,497,500	
	第１７２回利付国債（２０年）	310,000,000	310,000,000	
	国債証券合計	65,483,000,000	70,823,456,760	
地方債証券	第１４回東京都公募公債	100,000,000	117,022,000	
	第７０５回東京都公募公債	100,000,000	101,698,000	
	第７２３回東京都公募公債	100,000,000	102,314,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	102,319,000	

	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	100,061,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	99,844,000	
	平成２９年度第６回北海道公募公債	100,000,000	99,930,000	
	第２１１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,817,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,140,000	
	第１６４回大阪府公募公債	100,000,000	99,843,000	
	第３７６回大阪府公募公債	110,000,000	112,715,900	
	第４５１回大阪府公募公債	100,000,000	99,414,000	
	平成２７年度第１３回京都府公募公債	100,000,000	100,309,000	
	平成２９年度第４回京都府公募公債	100,000,000	100,858,000	
	平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	100,759,000	
	平成２６年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	102,206,000	
	平成３０年度第１４回静岡県公募公債	100,000,000	100,584,000	
	平成２４年度第５回愛知県公募公債	100,000,000	101,652,000	
	平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	99,999,000	
	平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	101,118,000	
	平成２９年度第３回広島県公募公債	100,000,000	100,570,000	
	平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	101,012,000	
	第８回埼玉県公募公債	100,000,000	119,009,000	
	第１６回埼玉県公募公債	100,000,000	112,376,000	
	平成２６年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	102,202,000	
	平成２７年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,715,000	
	第１９回千葉県公募公債	100,000,000	111,712,000	
	平成２９年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,305,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,669,000	
	第１２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,454,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,484,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,253,000	
	第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,939,000	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,238,000	
	第１７回名古屋市公募公債	100,000,000	112,100,000	
	第２６回横浜市公募公債	100,000,000	118,579,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	100,000,000	102,185,000	
	平成２９年度第２回福岡市公募公債	100,000,000	99,971,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,207,000	
	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	121,284,000	
	平成２９年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,989,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	100,925,000	
	平成２９年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	101,233,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,464,013,900	
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	102,035,000	

第４９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,372,000	
第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,285,000	
第１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,795,000	
第２７回道路債券	100,000,000	108,647,000	
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	116,832,900	
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	129,832,100	
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	102,016,000	
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	102,334,000	
第２５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,822,200	
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	135,271,640	
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	100,683,000	
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	100,989,000	
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	101,288,000	
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	100,735,000	
第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	127,105,000	
第１３回公営企業債券	100,000,000	110,393,000	
第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,810,510	
第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,970,000	
Ｆ８２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,805,000	
第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,196,250	
第９７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,372,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,532,280	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,064,000	
Ｆ２２８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,316,000	
Ｆ３０５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,367,000	
第６６回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,024,000	
第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	114,404,000	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	94,313,000	94,043,264	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,023,000	
第１８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,623,000	
第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,874,000	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,412,000	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,847,000	88,989,011	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,999,000	88,897,469	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,267,000	90,037,374	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,719,000	89,607,964	

	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,101,000	92,800,046	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,053,000	94,322,242	
	第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,347,000	96,648,048	
	第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,964,000	98,990,720	
	第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	66,795,000	66,780,305	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	69,590,000	69,621,315	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	73,843,000	73,927,181	
	第３２７回信金中金債	100,000,000	100,063,000	
	第３４０回信金中金債	100,000,000	100,202,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	102,333,000	
	第３９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,006,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,075,000	
	第５２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,804,000	
	第１１６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,984,000	
	特殊債券合計	5,201,838,000	5,422,360,819	
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	98,624,000	
	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	100,252,000	
	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	98,544,000	
	第７回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,973,000	
	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	99,731,000	
	第１２回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,860,000	
	第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,369,000	
	第１２回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,913,000	
	第１２回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,681,000	
	第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,269,000	
	第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,145,000	
	第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,167,000	
	第２６回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,234,000	
	第１２回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,540,000	
	第１８回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,897,000	
	第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,847,000	
	第５回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,770,000	
	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	98,386,000	
	第１４７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,219,000	
	第１４回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,959,000	

	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	98,485,000	
	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	100,101,000	
	第７５回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
	第５８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,858,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,508,000	
	第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,353,000	
	第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,475,000	
	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,843,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,239,000	
	第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
	第５２１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
	第２８９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,155,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,534,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,929,000	
	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	99,940,000	
社債券合計		3,500,000,000	3,506,701,000	
合計			84,216,532,479	

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

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	30,999,557
コール・ローン	211,443,246
国債証券	25,536,153,425
派生商品評価勘定	146,566
未収利息	153,656,298
前払費用	17,019,555
流動資産合計	25,949,418,647

	2020年 7月27日現在
資産合計	25,949,418,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	377,982
未払金	89,547,628
未払利息	573
流動負債合計	89,926,183
負債合計	89,926,183
純資産の部	
元本等	
元本	24,423,897,140
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,435,595,324
元本等合計	25,859,492,464
純資産合計	25,859,492,464
負債純資産合計	25,949,418,647

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5.その他財務諸表作成のための基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 7月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	36,298,086,669円
期中追加設定元本額	14,920,761,187円
期中一部解約元本額	26,794,950,716円
期末元本額	24,423,897,140円
期末元本の内訳※	

りそなラップ型ファンド（安定型）	3,016,415,576円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	422,914,688円
りそなラップ型ファンド（成長型）	219,654,805円
ＤＣりそな　グローバルバランス	60,133,128円
つみたてバランスファンド	361,996,029円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	595,153,436円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	119,139,010円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	27,819,435円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	7,198,311円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,501,354円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	263,298円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	57,905円
ＦＷりそな先進国債券アクティブファンド	177,309,634円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	69,372,284円
ＦＷりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジなし）	17,886,693,976円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	417,945,347円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	189,929,617円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	120,854,792円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	47,885,039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）	645,692円
りそなＦＴ　先進国債券インデックス（適格機関投資家専用）	680,013,784円
２．　計算日における受益権の総数	
	24,423,897,140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	1.0588円
(10,000口当たり純資産額)	(10,588円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	808,020,703
合計	808,020,703

(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 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	82,762,652	－	82,531,236	△231,416
	米ドル	33,977,077	－	33,668,742	△308,335
	カナダドル	3,796,022	－	3,776,200	△19,822
	ユーロ	35,577,994	－	35,724,560	146,566
	英ポンド	5,829,234	－	5,819,814	△9,420
	オーストラリアドル	3,582,325	－	3,541,920	△40,405
合計		82,762,652	－	82,531,236	△231,416

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	420,000.00	423,880.04	
		US TREASURY N/B	240,000.00	245,760.93	
		US TREASURY N/B	470,000.00	474,672.45	
		US TREASURY N/B	180,000.00	182,928.51	
		US TREASURY N/B	550,000.00	561,440.38	
		US TREASURY N/B	390,000.00	400,656.43	
		US TREASURY N/B	250,000.00	252,685.52	
		US TREASURY N/B	620,000.00	629,130.43	
		US TREASURY N/B	390,000.00	401,486.70	
		US TREASURY N/B	340,000.00	343,891.53	
		US TREASURY N/B	600,000.00	613,898.40	
		US TREASURY N/B	80,000.00	82,650.00	
		US TREASURY N/B	680,000.00	689,442.95	
		US TREASURY N/B	390,000.00	396,634.56	
		US TREASURY N/B	810,000.00	829,538.01	
		US TREASURY N/B	570,000.00	590,116.95	
		US TREASURY N/B	590,000.00	602,595.08	
		US TREASURY N/B	600,000.00	613,910.10	
		US TREASURY N/B	700,000.00	712,673.78	
		US TREASURY N/B	500,000.00	517,099.60	
		US TREASURY N/B	560,000.00	574,710.92	
		US TREASURY N/B	500,000.00	510,498.00	
		US TREASURY N/B	600,000.00	620,601.54	
		US TREASURY N/B	380,000.00	387,718.75	
		US TREASURY N/B	490,000.00	502,709.37	
		US TREASURY N/B	500,000.00	509,218.75	
		US TREASURY N/B	340,000.00	349,748.41	
		US TREASURY N/B	470,000.00	481,951.91	
		US TREASURY N/B	650,000.00	667,824.17	
		US TREASURY N/B	700,000.00	725,429.67	
		US TREASURY N/B	410,000.00	420,954.66	
		US TREASURY N/B	460,000.00	473,260.92	
		US TREASURY N/B	500,000.00	518,007.80	

		US TREASURY N/B	470,000.00	483,218.75	
		US TREASURY N/B	700,000.00	721,218.75	
		US TREASURY N/B	280,000.00	288,039.05	
		US TREASURY N/B	510,000.00	526,166.59	
		US TREASURY N/B	550,000.00	566,156.25	
		US TREASURY N/B	470,000.00	484,191.78	
		US TREASURY N/B	390,000.00	404,784.93	
		US TREASURY N/B	410,000.00	422,604.26	
		US TREASURY N/B	650,000.00	649,746.04	
		US TREASURY N/B	450,000.00	464,124.01	
		US TREASURY N/B	360,000.00	373,373.42	
		US TREASURY N/B	400,000.00	413,843.72	
		US TREASURY N/B	270,000.00	278,163.26	
		US TREASURY N/B	390,000.00	404,030.83	
		US TREASURY N/B	480,000.00	494,793.74	
		US TREASURY N/B	560,000.00	576,209.36	
		US TREASURY N/B	520,000.00	538,037.50	
		US TREASURY N/B	350,000.00	363,145.47	
		US TREASURY N/B	430,000.00	441,615.03	
		US TREASURY N/B	430,000.00	446,712.85	
		US TREASURY N/B	410,000.00	427,056.61	
		US TREASURY N/B	630,000.00	651,200.94	
		US TREASURY N/B	670,000.00	698,841.35	
		US TREASURY N/B	270,000.00	279,481.61	
		US TREASURY N/B	720,000.00	754,312.46	
		US TREASURY N/B	300,000.00	309,908.19	
		US TREASURY N/B	400,000.00	415,953.12	
		US TREASURY N/B	560,000.00	591,062.47	
		US TREASURY N/B	650,000.00	680,443.33	
		US TREASURY N/B	300,000.00	310,417.95	
		US TREASURY N/B	390,000.00	403,985.12	
		US TREASURY N/B	410,000.00	435,640.99	
		US TREASURY N/B	700,000.00	701,667.96	
		US TREASURY N/B	150,000.00	156,032.22	
		US TREASURY N/B	420,000.00	449,867.53	

		US TREASURY N/B	640,000.00	668,349.94	
		US TREASURY N/B	530,000.00	529,409.95	
		US TREASURY N/B	320,000.00	333,256.22	
		US TREASURY N/B	400,000.00	429,320.28	
		US TREASURY N/B	250,000.00	250,605.45	
		US TREASURY N/B	470,000.00	486,615.20	
		US TREASURY N/B	550,000.00	589,509.74	
		US TREASURY N/B	40,000.00	41,299.21	
		US TREASURY N/B	320,000.00	344,793.72	
		US TREASURY N/B	460,000.00	492,622.23	
		US TREASURY N/B	190,000.00	197,013.75	
		US TREASURY N/B	130,000.00	140,316.20	
		US TREASURY N/B	540,000.00	560,503.31	
		US TREASURY N/B	480,000.00	521,034.33	
		US TREASURY N/B	540,000.00	565,407.37	
		US TREASURY N/B	150,000.00	163,122.06	
		US TREASURY N/B	710,000.00	769,933.94	
		US TREASURY N/B	440,000.00	468,471.08	
		US TREASURY N/B	340,000.00	370,467.16	
		US TREASURY N/B	140,000.00	149,862.88	
		US TREASURY N/B	450,000.00	487,450.17	
		US TREASURY N/B	420,000.00	450,261.29	
		US TREASURY N/B	690,000.00	752,409.94	
		US TREASURY N/B	490,000.00	523,792.75	
		US TREASURY N/B	340,000.00	366,496.06	
		US TREASURY N/B	890,000.00	952,612.83	
		US TREASURY N/B	320,000.00	341,512.48	
		US TREASURY N/B	850,000.00	923,760.70	
		US TREASURY N/B	560,000.00	598,270.28	
		US TREASURY N/B	390,000.00	417,170.48	
		US TREASURY N/B	420,000.00	445,191.76	
		US TREASURY N/B	220,000.00	236,719.12	
		US TREASURY N/B	420,000.00	445,651.16	
		US TREASURY N/B	790,000.00	858,584.95	
		US TREASURY N/B	400,000.00	426,898.40	

		US TREASURY N/B	600,000.00	625,042.92	
		US TREASURY N/B	220,000.00	237,320.68	
		US TREASURY N/B	260,000.00	273,721.08	
		US TREASURY N/B	310,000.00	336,434.75	
		US TREASURY N/B	530,000.00	558,425.38	
		US TREASURY N/B	750,000.00	814,526.32	
		US TREASURY N/B	400,000.00	432,679.68	
		US TREASURY N/B	450,000.00	474,521.44	
		US TREASURY N/B	400,000.00	435,335.92	
		US TREASURY N/B	400,000.00	426,476.56	
		US TREASURY N/B	430,000.00	473,461.90	
		US TREASURY N/B	550,000.00	577,757.78	
		US TREASURY N/B	730,000.00	787,772.63	
		US TREASURY N/B	340,000.00	378,781.25	
		US TREASURY N/B	250,000.00	277,495.10	
		US TREASURY N/B	600,000.00	606,750.00	
		US TREASURY N/B	250,000.00	280,922.85	
		US TREASURY N/B	600,000.00	603,234.36	
		US TREASURY N/B	570,000.00	620,542.92	
		US TREASURY N/B	240,000.00	270,107.80	
		US TREASURY N/B	600,000.00	599,707.02	
		US TREASURY N/B	290,000.00	325,156.81	
		US TREASURY N/B	470,000.00	530,686.87	
		US TREASURY N/B	580,000.00	629,877.68	
		US TREASURY N/B	310,000.00	348,634.95	
		US TREASURY N/B	230,000.00	261,988.86	
		US TREASURY N/B	570,000.00	650,345.49	
		US TREASURY N/B	450,000.00	495,958.00	
		US TREASURY N/B	480,000.00	545,371.87	
		US TREASURY N/B	300,000.00	337,300.77	
		US TREASURY N/B	330,000.00	371,507.79	
		US TREASURY N/B	570,000.00	610,579.09	
		US TREASURY N/B	350,000.00	392,205.05	
		US TREASURY N/B	430,000.00	476,325.74	
		US TREASURY N/B	450,000.00	502,154.28	

		US TREASURY N/B	900,000.00	965,654.28	
		US TREASURY N/B	470,000.00	518,138.24	
		US TREASURY N/B	450,000.00	489,919.90	
		US TREASURY N/B	590,000.00	642,869.48	
		US TREASURY N/B	610,000.00	651,127.59	
		US TREASURY N/B	320,000.00	339,224.98	
		US TREASURY N/B	400,000.00	430,335.92	
		US TREASURY N/B	300,000.00	322,898.43	
		US TREASURY N/B	850,000.00	934,933.53	
		US TREASURY N/B	300,000.00	323,074.20	
		US TREASURY N/B	100,000.00	108,542.96	
		US TREASURY N/B	840,000.00	939,848.36	
		US TREASURY N/B	530,000.00	532,484.37	
		US TREASURY N/B	580,000.00	655,751.13	
		US TREASURY N/B	470,000.00	472,001.16	
		US TREASURY N/B	800,000.00	900,484.31	
		US TREASURY N/B	610,000.00	688,537.50	
		US TREASURY N/B	850,000.00	993,653.31	
		US TREASURY N/B	680,000.00	804,352.28	
		US TREASURY N/B	120,000.00	167,657.80	
		US TREASURY N/B	700,000.00	831,003.87	
		US TREASURY N/B	690,000.00	836,341.96	
		US TREASURY N/B	310,000.00	433,297.63	
		US TREASURY N/B	730,000.00	858,035.12	
		US TREASURY N/B	680,000.00	787,471.82	
		US TREASURY N/B	560,000.00	613,473.39	
		US TREASURY N/B	710,000.00	787,406.61	
		US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,260,820.24	
		US TREASURY N/B	120,000.00	185,456.24	
		US TREASURY N/B	150,000.00	150,530.26	
		US TREASURY N/B	200,000.00	298,527.34	
		US TREASURY N/B	80,000.00	124,010.93	
		US TREASURY N/B	90,000.00	149,603.90	
		US TREASURY N/B	30,000.00	47,380.07	
		US TREASURY N/B	100,000.00	160,382.81	

		US TREASURY N/B	70,000.00	100,942.18	
		US TREASURY N/B	140,000.00	220,368.75	
		US TREASURY N/B	190,000.00	308,415.99	
		US TREASURY N/B	40,000.00	64,148.43	
		US TREASURY N/B	190,000.00	314,286.71	
		US TREASURY N/B	210,000.00	338,674.20	
		US TREASURY N/B	650,000.00	661,946.27	
		US TREASURY N/B	150,000.00	228,480.46	
		US TREASURY N/B	210,000.00	335,479.09	
		US TREASURY N/B	230,000.00	390,249.78	
		US TREASURY N/B	50,000.00	81,397.46	
		US TREASURY N/B	230,000.00	347,735.73	
		US TREASURY N/B	130,000.00	181,002.14	
		US TREASURY N/B	180,000.00	251,367.17	
		US TREASURY N/B	80,000.00	109,667.18	
		US TREASURY N/B	300,000.00	396,533.19	
		US TREASURY N/B	190,000.00	251,030.06	
		US TREASURY N/B	320,000.00	447,174.97	
		US TREASURY N/B	360,000.00	485,437.50	
		US TREASURY N/B	360,000.00	541,701.54	
		US TREASURY N/B	320,000.00	490,587.48	
		US TREASURY N/B	410,000.00	618,683.56	
		US TREASURY N/B	390,000.00	569,095.29	
		US TREASURY N/B	430,000.00	605,577.71	
		US TREASURY N/B	380,000.00	525,721.06	
		US TREASURY N/B	350,000.00	446,591.77	
		US TREASURY N/B	390,000.00	541,033.58	
		US TREASURY N/B	480,000.00	653,765.61	
		US TREASURY N/B	290,000.00	403,955.26	
		US TREASURY N/B	330,000.00	423,192.75	
		US TREASURY N/B	460,000.00	590,947.23	
		US TREASURY N/B	380,000.00	467,296.07	
		US TREASURY N/B	350,000.00	481,284.16	
		US TREASURY N/B	440,000.00	619,557.79	
		US TREASURY N/B	400,000.00	564,093.72	

	US TREASURY N/B	380,000.00	514,439.82	
	US TREASURY N/B	420,000.00	569,723.40	
	US TREASURY N/B	520,000.00	737,790.61	
	US TREASURY N/B	530,000.00	769,410.91	
	US TREASURY N/B	630,000.00	897,762.28	
	US TREASURY N/B	560,000.00	851,484.36	
	US TREASURY N/B	640,000.00	916,024.96	
	US TREASURY N/B	590,000.00	828,143.35	
	US TREASURY N/B	470,000.00	587,756.99	
	US TREASURY N/B	530,000.00	680,118.31	
	US TREASURY N/B	540,000.00	643,517.54	
	US TREASURY N/B	520,000.00	521,584.33	
	米ドル 小計	96,050,000.00	107,761,993.26 (11,403,374,126)	
カナダドル	GOV OF CANADA	60,000.00	60,808.20	
	GOV OF CANADA	210,000.00	211,318.80	
	GOV OF CANADA	180,000.00	182,413.80	
	GOV OF CANADA	100,000.00	101,958.00	
	GOV OF CANADA	210,000.00	210,978.60	
	GOV OF CANADA	200,000.00	204,520.00	
	GOV OF CANADA	120,000.00	125,590.80	
	GOV OF CANADA	510,000.00	518,200.80	
	GOV OF CANADA	250,000.00	259,685.00	
	GOV OF CANADA	190,000.00	196,667.10	
	GOV OF CANADA	200,000.00	210,656.00	
	GOV OF CANADA	110,000.00	117,730.80	
	GOV OF CANADA	160,000.00	173,502.40	
	GOV OF CANADA	120,000.00	125,878.80	
	GOV OF CANADA	200,000.00	208,558.00	
	GOV OF CANADA	150,000.00	163,884.00	
	GOV OF CANADA	250,000.00	252,230.00	
	GOV OF CANADA	140,000.00	149,427.60	
	GOV OF CANADA	120,000.00	125,096.40	
	GOV OF CANADA	60,000.00	90,816.00	
	GOV OF CANADA	150,000.00	168,423.00	

	GOV OF CANADA	120,000.00	175,141.20	
	GOV OF CANADA	130,000.00	150,394.40	
	GOV OF CANADA	320,000.00	343,280.00	
	GOV OF CANADA	130,000.00	211,837.60	
	GOV OF CANADA	130,000.00	216,808.80	
	GOV OF CANADA	140,000.00	223,269.20	
	GOV OF CANADA	190,000.00	299,616.70	
	GOV OF CANADA	170,000.00	245,780.90	
	GOV OF CANADA	180,000.00	230,673.60	
	GOV OF CANADA	50,000.00	82,198.50	
カナダドル 小計		5,250,000.00	6,037,345.00 (477,010,628)	
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	2,630,000.00	2,722,603.35	
	UNITED MEXICAN STATE	3,200,000.00	3,309,978.56	
	UNITED MEXICAN STATE	2,010,000.00	2,115,223.50	
	UNITED MEXICAN STATE	2,970,000.00	3,273,831.00	
	UNITED MEXICAN STATE	2,600,000.00	2,904,096.00	
	UNITED MEXICAN STATE	2,900,000.00	3,477,448.00	
	UNITED MEXICAN STATE	2,320,000.00	2,383,660.80	
	UNITED MEXICAN STATE	3,360,000.00	3,750,734.40	
	UNITED MEXICAN STATE	3,400,000.00	4,050,386.00	
	UNITED MEXICAN STATE	1,570,000.00	1,791,621.20	
	UNITED MEXICAN STATE	1,110,000.00	1,269,817.80	
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	1,201,516.80	
	UNITED MEXICAN STATE	2,230,000.00	2,685,767.40	
	UNITED MEXICAN STATE	2,350,000.00	2,617,195.00	
	UNITED MEXICAN STATE	1,820,000.00	2,071,851.60	
メキシコペソ 小計		35,350,000.00	39,625,731.41 (188,618,481)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	198,837.28	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	128,918.40	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	121,596.24	
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	65,640.96	
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	101,626.90	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	122,124.72	
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	161,536.50	

GOV OF AUSTRIA	60,000.00	61,366.44	
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	131,548.08	
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	152,920.55	
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	157,116.48	
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	150,930.92	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	138,393.32	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	191,283.04	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	119,537.88	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	139,198.54	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	81,960.00	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	134,126.50	
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	236,119.24	
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	136,762.36	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	133,047.00	
GOV OF AUSTRIA	30,000.00	34,149.99	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	116,479.42	
GOV OF AUSTRIA	74,000.00	150,119.36	
GOV OF AUSTRIA	30,000.00	46,750.95	
GOV OF BELGIUM	180,000.00	190,253.52	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	172,504.00	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	221,372.49	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	173,416.96	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	123,151.52	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	213,721.69	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	167,132.96	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	213,063.60	
GOV OF BELGIUM	130,000.00	166,976.43	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	206,294.40	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	151,376.96	
GOV OF BELGIUM	60,000.00	61,460.26	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	421,229.58	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	152,361.31	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	209,469.11	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	123,199.96	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	168,037.35	

		GOV OF BELGIUM	50,000.00	73,846.32	
		GOV OF BELGIUM	110,000.00	127,881.38	
		GOV OF BELGIUM	90,000.00	126,940.14	
		GOV OF BELGIUM	270,000.00	463,471.09	
		GOV OF BELGIUM	60,000.00	72,337.57	
		GOV OF BELGIUM	90,000.00	116,029.80	
		GOV OF BELGIUM	70,000.00	70,668.78	
		GOV OF BELGIUM	220,000.00	390,250.08	
		GOV OF BELGIUM	120,000.00	212,688.36	
		GOV OF BELGIUM	130,000.00	165,218.30	
		GOV OF BELGIUM	100,000.00	131,471.80	
		GOV OF BELGIUM	60,000.00	92,291.82	
		GOV OF BELGIUM	80,000.00	127,182.81	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	60,630.24	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	62,893.56	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	95,196.78	
		GOV OF FINLAND	20,000.00	20,382.20	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	98,838.99	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	51,216.95	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	98,413.12	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	53,694.45	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	95,216.40	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	95,958.83	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	75,082.74	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	64,220.34	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	85,764.56	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	66,235.68	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	58,253.17	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	51,041.51	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	51,414.40	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	77,625.84	
		GOV OF FINLAND	40,000.00	52,617.83	
		GOV OF FRANCE	330,000.00	345,942.63	
		GOV OF FRANCE	400,000.00	403,946.86	
		GOV OF FRANCE	580,000.00	616,917.00	

		GOV OF FRANCE	340,000.00	343,883.48	
		GOV OF FRANCE	480,000.00	511,134.24	
		GOV OF FRANCE	250,000.00	253,811.25	
		GOV OF FRANCE	500,000.00	508,132.00	
		GOV OF FRANCE	620,000.00	661,534.78	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	649,262.88	
		GOV OF FRANCE	440,000.00	449,239.56	
		GOV OF FRANCE	410,000.00	454,829.40	
		GOV OF FRANCE	430,000.00	473,456.23	
		GOV OF FRANCE	450,000.00	460,980.90	
		GOV OF FRANCE	510,000.00	535,617.30	
		GOV OF FRANCE	340,000.00	458,218.00	
		GOV OF FRANCE	350,000.00	378,335.89	
		GOV OF FRANCE	270,000.00	276,763.50	
		GOV OF FRANCE	520,000.00	640,398.20	
		GOV OF FRANCE	440,000.00	465,081.76	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	511,148.40	
		GOV OF FRANCE	380,000.00	416,513.59	
		GOV OF FRANCE	570,000.00	701,131.92	
		GOV OF FRANCE	390,000.00	423,160.92	
		GOV OF FRANCE	390,000.00	424,246.68	
		GOV OF FRANCE	620,000.00	938,111.46	
		GOV OF FRANCE	380,000.00	405,719.50	
		GOV OF FRANCE	510,000.00	520,310.16	
		GOV OF FRANCE	520,000.00	659,535.33	
		GOV OF FRANCE	510,000.00	601,379.76	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	843,882.90	
		GOV OF FRANCE	320,000.00	373,893.79	
		GOV OF FRANCE	410,000.00	695,151.72	
		GOV OF FRANCE	410,000.00	482,493.33	
		GOV OF FRANCE	360,000.00	607,160.52	
		GOV OF FRANCE	280,000.00	359,374.82	
		GOV OF FRANCE	450,000.00	833,325.65	
		GOV OF FRANCE	320,000.00	535,837.44	
		GOV OF FRANCE	330,000.00	462,662.97	

		GOV OF FRANCE	270,000.00	344,259.72	
		GOV OF FRANCE	120,000.00	126,691.68	
		GOV OF FRANCE	220,000.00	458,867.20	
		GOV OF FRANCE	190,000.00	418,904.38	
		GOV OF FRANCE	170,000.00	245,754.72	
		GOV OF GERMANY	200,000.00	207,321.00	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	258,112.25	
		GOV OF GERMANY	200,000.00	201,469.40	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	211,639.41	
		GOV OF GERMANY	220,000.00	221,991.48	
		GOV OF GERMANY	180,000.00	187,041.01	
		GOV OF GERMANY	230,000.00	232,427.42	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	262,927.04	
		GOV OF GERMANY	30,000.00	30,374.25	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	377,024.58	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	272,104.56	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	243,634.80	
		GOV OF GERMANY	270,000.00	285,345.18	
		GOV OF GERMANY	280,000.00	285,333.44	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	265,509.00	
		GOV OF GERMANY	340,000.00	368,350.22	
		GOV OF GERMANY	160,000.00	163,651.20	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	348,187.20	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	369,252.00	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	227,711.61	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	310,085.11	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	329,194.56	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	326,917.13	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	257,943.00	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	347,443.20	
		GOV OF GERMANY	410,000.00	436,956.68	
		GOV OF GERMANY	370,000.00	384,769.66	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	328,302.09	
		GOV OF GERMANY	140,000.00	210,727.51	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	388,848.60	

		GOV OF GERMANY	100,000.00	104,318.58	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	250,500.69	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	390,401.87	
		GOV OF GERMANY	190,000.00	272,313.89	
		GOV OF GERMANY	300,000.00	320,221.80	
		GOV OF GERMANY	200,000.00	213,898.60	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	303,715.45	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	348,115.42	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	324,565.66	
		GOV OF GERMANY	110,000.00	115,055.05	
		GOV OF GERMANY	300,000.00	491,933.94	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	416,392.43	
		GOV OF GERMANY	120,000.00	124,905.84	
		GOV OF GERMANY	330,000.00	569,220.35	
		GOV OF GERMANY	230,000.00	430,844.44	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	504,687.95	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	424,939.14	
		GOV OF GERMANY	350,000.00	575,108.10	
		GOV OF GERMANY	380,000.00	639,114.40	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	341,838.75	
		GOV OF GERMANY	180,000.00	181,514.70	
		GOV OF IRELAND	80,000.00	81,820.27	
		GOV OF IRELAND	50,000.00	50,632.23	
		GOV OF IRELAND	90,000.00	100,724.20	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	125,711.96	
		GOV OF IRELAND	140,000.00	178,182.28	
		GOV OF IRELAND	140,000.00	151,276.16	
		GOV OF IRELAND	80,000.00	82,629.60	
		GOV OF IRELAND	100,000.00	108,944.93	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	133,493.58	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	149,712.00	
		GOV OF IRELAND	70,000.00	71,909.74	
		GOV OF IRELAND	70,000.00	80,499.58	
		GOV OF IRELAND	60,000.00	69,553.96	
		GOV OF IRELAND	50,000.00	51,746.60	

GOV OF IRELAND	60,000.00	74,423.28	
GOV OF IRELAND	120,000.00	164,482.08	
GOV OF IRELAND	50,000.00	62,885.45	
GOV OF ITALY	350,000.00	363,848.80	
GOV OF ITALY	310,000.00	326,742.48	
GOV OF ITALY	200,000.00	206,036.00	
GOV OF ITALY	190,000.00	191,252.86	
GOV OF ITALY	70,000.00	72,252.81	
GOV OF ITALY	260,000.00	281,426.08	
GOV OF ITALY	210,000.00	214,565.61	
GOV OF ITALY	220,000.00	225,435.54	
GOV OF ITALY	150,000.00	153,171.90	
GOV OF ITALY	170,000.00	173,352.40	
GOV OF ITALY	230,000.00	256,789.36	
GOV OF ITALY	210,000.00	216,657.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	382,109.00	
GOV OF ITALY	190,000.00	190,254.22	
GOV OF ITALY	240,000.00	245,699.28	
GOV OF ITALY	200,000.00	204,824.40	
GOV OF ITALY	250,000.00	280,743.00	
GOV OF ITALY	180,000.00	182,835.54	
GOV OF ITALY	340,000.00	387,600.68	
GOV OF ITALY	340,000.00	365,045.08	
GOV OF ITALY	200,000.00	203,456.60	
GOV OF ITALY	340,000.00	391,805.46	
GOV OF ITALY	230,000.00	243,792.64	
GOV OF ITALY	200,000.00	211,288.80	
GOV OF ITALY	270,000.00	307,174.41	
GOV OF ITALY	200,000.00	209,449.00	
GOV OF ITALY	250,000.00	272,783.75	
GOV OF ITALY	150,000.00	149,816.22	
GOV OF ITALY	290,000.00	350,598.40	
GOV OF ITALY	200,000.00	209,530.00	
GOV OF ITALY	240,000.00	252,240.00	
GOV OF ITALY	160,000.00	170,607.92	

		GOV OF ITALY	220,000.00	242,845.90	
		GOV OF ITALY	240,000.00	258,939.84	
		GOV OF ITALY	270,000.00	328,469.04	
		GOV OF ITALY	240,000.00	254,201.28	
		GOV OF ITALY	300,000.00	326,074.50	
		GOV OF ITALY	280,000.00	290,900.12	
		GOV OF ITALY	250,000.00	252,949.50	
		GOV OF ITALY	150,000.00	164,850.00	
		GOV OF ITALY	240,000.00	261,414.00	
		GOV OF ITALY	350,000.00	490,416.50	
		GOV OF ITALY	290,000.00	315,708.79	
		GOV OF ITALY	300,000.00	391,489.44	
		GOV OF ITALY	280,000.00	323,803.20	
		GOV OF ITALY	250,000.00	295,106.00	
		GOV OF ITALY	360,000.00	497,342.88	
		GOV OF ITALY	320,000.00	393,792.64	
		GOV OF ITALY	280,000.00	289,660.00	
		GOV OF ITALY	200,000.00	198,963.20	
		GOV OF ITALY	170,000.00	179,701.22	
		GOV OF ITALY	270,000.00	403,554.44	
		GOV OF ITALY	280,000.00	295,620.92	
		GOV OF ITALY	260,000.00	394,669.75	
		GOV OF ITALY	200,000.00	228,190.00	
		GOV OF ITALY	310,000.00	452,900.11	
		GOV OF ITALY	180,000.00	226,308.72	
		GOV OF ITALY	160,000.00	161,053.62	
		GOV OF ITALY	190,000.00	212,111.63	
		GOV OF ITALY	300,000.00	407,091.00	
		GOV OF ITALY	160,000.00	193,929.95	
		GOV OF ITALY	270,000.00	417,523.24	
		GOV OF ITALY	150,000.00	185,347.05	
		GOV OF ITALY	280,000.00	435,611.68	
		GOV OF ITALY	230,000.00	359,629.42	
		GOV OF ITALY	210,000.00	268,590.37	
		GOV OF ITALY	220,000.00	257,341.48	

		GOV OF ITALY	200,000.00	265,580.00	
		GOV OF ITALY	170,000.00	241,716.71	
		GOV OF ITALY	100,000.00	111,372.50	
		GOV OF ITALY	120,000.00	142,206.06	
		GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	186,729.04	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	191,717.98	
		GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	190,295.64	
		GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	199,739.16	
		GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	214,307.62	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	194,080.63	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	210,030.56	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	197,999.00	
		GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	223,273.11	
		GOV OF NETHERLANDS	60,000.00	61,940.64	
		GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	173,945.92	
		GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	218,033.70	
		GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	175,581.60	
		GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	179,873.68	
		GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	175,556.28	
		GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	188,679.40	
		GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	337,908.57	
		GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	122,093.21	
		GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	365,379.80	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	329,347.52	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	232,764.83	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	231,410.59	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	306,619.60	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	263,672.03	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	234,417.15	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	320,713.40	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	252,350.50	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	265,340.92	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	300,493.18	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	295,227.50	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	288,805.50	

	GOV OF SPAIN	220,000.00	224,712.62	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	293,508.02	
	GOV OF SPAIN	220,000.00	222,080.10	
	GOV OF SPAIN	190,000.00	206,397.19	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	310,814.40	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	336,470.70	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	335,811.60	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	381,020.64	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	347,531.84	
	GOV OF SPAIN	190,000.00	209,468.84	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	189,442.76	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	275,067.42	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	285,975.30	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	275,429.50	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	281,851.06	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	507,051.86	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	288,099.50	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	268,598.99	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	265,470.75	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	337,062.07	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	261,673.92	
	GOV OF SPAIN	310,000.00	502,948.11	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	221,345.88	
	GOV OF SPAIN	160,000.00	187,386.56	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	386,934.16	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	419,230.27	
	GOV OF SPAIN	130,000.00	136,927.18	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	450,160.63	
	GOV OF SPAIN	170,000.00	321,558.91	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	255,486.60	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	249,411.25	
	GOV OF SPAIN	110,000.00	105,893.77	
	GOV OF SPAIN	170,000.00	291,184.77	
ユーロ 小計		70,374,000.00	84,602,420.34 (10,465,319,396)	

	英ポンド	UK TREASURY	170,000.00	177,193.21	
		UK TREASURY	180,000.00	191,879.10	
		UK TREASURY	300,000.00	303,584.76	
		UK TREASURY	320,000.00	332,537.34	
		UK TREASURY	150,000.00	150,828.00	
		UK TREASURY	240,000.00	246,315.60	
		UK TREASURY	230,000.00	246,907.30	
		UK TREASURY	310,000.00	323,156.52	
		UK TREASURY	40,000.00	44,736.09	
		UK TREASURY	250,000.00	309,019.40	
		UK TREASURY	270,000.00	279,540.93	
		UK TREASURY	240,000.00	266,147.52	
		UK TREASURY	170,000.00	186,150.00	
		UK TREASURY	190,000.00	206,932.80	
		UK TREASURY	180,000.00	236,555.35	
		UK TREASURY	180,000.00	203,703.51	
		UK TREASURY	170,000.00	253,895.00	
		UK TREASURY	180,000.00	192,995.28	
		UK TREASURY	200,000.00	203,860.00	
		UK TREASURY	190,000.00	279,972.60	
		UK TREASURY	210,000.00	307,509.00	
		UK TREASURY	160,000.00	250,565.74	
		UK TREASURY	230,000.00	361,409.12	
		UK TREASURY	320,000.00	383,324.09	
		UK TREASURY	190,000.00	330,450.66	
		UK TREASURY	190,000.00	317,274.08	
		UK TREASURY	220,000.00	374,110.90	
		UK TREASURY	90,000.00	101,146.64	
		UK TREASURY	240,000.00	434,060.64	
		UK TREASURY	230,000.00	359,700.15	
		UK TREASURY	280,000.00	459,727.80	
		UK TREASURY	220,000.00	410,839.26	
		UK TREASURY	250,000.00	301,956.35	
		UK TREASURY	150,000.00	192,553.20	
		UK TREASURY	160,000.00	313,308.48	

	UK TREASURY	50,000.00	49,345.95	
	UK TREASURY	190,000.00	361,105.03	
	UK TREASURY	120,000.00	156,198.48	
	UK TREASURY	230,000.00	494,873.06	
	UK TREASURY	210,000.00	289,946.79	
	UK TREASURY	160,000.00	352,701.76	
	UK TREASURY	70,000.00	68,000.80	
	UK TREASURY	190,000.00	334,651.59	
	UK TREASURY	180,000.00	402,413.11	
	UK TREASURY	120,000.00	181,905.60	
英ポンド 小計		8,820,000.00	12,224,988.59 (1,658,564,202)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,320,000.00	1,413,470.52	
	GOV OF SWEDEN	1,110,000.00	1,177,060.65	
	GOV OF SWEDEN	840,000.00	953,631.84	
	GOV OF SWEDEN	690,000.00	743,863.73	
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	707,208.08	
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	710,117.10	
	GOV OF SWEDEN	570,000.00	894,677.70	
スウェーデンクローナ 小計		5,850,000.00	6,600,029.62 (79,332,356)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	980,000.00	1,031,597.00	
	GOV OF NORWAY	710,000.00	782,100.50	
	GOV OF NORWAY	610,000.00	652,396.22	
	GOV OF NORWAY	410,000.00	437,158.40	
	GOV OF NORWAY	490,000.00	533,400.86	
	GOV OF NORWAY	440,000.00	491,700.00	
	GOV OF NORWAY	480,000.00	531,484.80	
	GOV OF NORWAY	520,000.00	559,803.40	
ノルウェークローネ 小計		4,640,000.00	5,019,641.18 (58,378,426)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	820,000.00	858,403.88	
	GOV OF DENMARK	470,000.00	479,213.68	
	GOV OF DENMARK	710,000.00	759,455.05	
	GOV OF DENMARK	910,000.00	1,021,168.14	
	GOV OF DENMARK	970,000.00	1,036,388.74	

	GOV OF DENMARK	1,070,000.00	1,153,845.20	
	GOV OF DENMARK	1,620,000.00	3,060,375.68	
デンマーククローネ 小計		6,570,000.00	8,368,850.37 (139,090,293)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	320,000.00	325,502.59	
	GOV OF POLAND	180,000.00	192,933.00	
	GOV OF POLAND	500,000.00	519,323.00	
	GOV OF POLAND	500,000.00	561,140.00	
	GOV OF POLAND	550,000.00	582,556.19	
	GOV OF POLAND	330,000.00	369,679.20	
	GOV OF POLAND	340,000.00	366,296.11	
	GOV OF POLAND	320,000.00	343,018.68	
	GOV OF POLAND	360,000.00	404,051.36	
	GOV OF POLAND	520,000.00	566,492.05	
	GOV OF POLAND	390,000.00	426,128.66	
	GOV OF POLAND	340,000.00	378,471.00	
	GOV OF POLAND	80,000.00	110,648.00	
	GOV OF POLAND	410,000.00	462,623.50	
ポーランドズロチ 小計		5,140,000.00	5,608,863.34 (157,609,059)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	204,866.76	
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	354,367.87	
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	261,466.84	
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	445,548.63	
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	446,892.69	
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	248,660.29	
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	453,369.54	
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	496,886.24	
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	407,743.16	
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	402,143.00	
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	413,079.35	
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	371,222.27	
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	482,754.91	
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	410,045.40	
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	449,892.91	
		250,000.00	252,060.57	

	GOV OF AUSTRALIA			
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	179,884.82	
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	206,007.82	
	GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	297,556.77	
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	84,775.57	
	GOV OF AUSTRALIA	150,000.00	204,210.31	
	GOV OF AUSTRALIA	110,000.00	141,711.22	
	GOV OF AUSTRALIA	90,000.00	108,298.00	
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	216,160.18	
オーストラリアドル 小計		6,550,000.00	7,539,605.12 (568,260,037)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	60,708.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	102,594.50	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	127,224.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	41,488.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	117,887.00	
	GOV OF SINGAPORE	10,000.00	10,580.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	121,660.00	
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	21,803.50	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	54,520.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	106,605.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	79,940.00	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	106,020.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	59,850.00	
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	77,970.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	58,782.50	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	48,617.60	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	91,630.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	94,640.00	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	35,589.15	
シンガポールドル 小計		1,240,000.00	1,418,109.25 (108,698,074)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	112,545.62	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	225,785.25	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	204,799.84	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,493.44	

	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,245.92	
	GOV OF MALAYSIA	50,000.00	51,988.61	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	269,929.71	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	104,669.50	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	126,296.19	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	178,941.67	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	216,148.28	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,921.25	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,795.52	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	207,021.83	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	212,279.09	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	142,194.41	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	131,637.92	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,372.50	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	254,095.12	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	87,195.29	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	209,417.50	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	288,873.57	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	239,616.19	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	141,667.44	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	47,099.73	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	109,673.76	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	78,045.87	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	214,063.25	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	144,734.25	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	236,530.84	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	167,474.72	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	93,782.25	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	181,399.98	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	75,657.70	
マレーシアリンギット 小計		4,900,000.00	5,365,394.01 (133,437,349)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	220,000.00	244,046.00	
	GOV OF ISRAEL	480,000.00	486,408.00	
	GOV OF ISRAEL	50,000.00	51,762.50	

		GOV OF ISRAEL	380,000.00	400,349.00	
		GOV OF ISRAEL	100,000.00	101,135.00	
		GOV OF ISRAEL	220,000.00	239,569.00	
		GOV OF ISRAEL	210,000.00	295,827.00	
		GOV OF ISRAEL	240,000.00	266,364.00	
		GOV OF ISRAEL	240,000.00	277,260.00	
		GOV OF ISRAEL	100,000.00	103,620.00	
		GOV OF ISRAEL	220,000.00	397,419.00	
		GOV OF ISRAEL	210,000.00	311,377.50	
	イスラエルシュケル 小計		2,670,000.00	3,175,137.00 (98,460,998)	
合計				25,536,153,425 (25,536,153,425)	

(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	220銘柄	100.0%	44.8%
カナダドル	国債証券	31銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券	320銘柄	100.0%	41.0%
英ポンド	国債証券	45銘柄	100.0%	6.5%
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	8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	14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	24銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券	12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新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	21,845,899
コール・ローン	32,369,620
投資信託受益証券	4,563,128,476
未収配当金	74,691,677
流動資産合計	4,692,035,672
資産合計	4,692,035,672
負債の部	
流動負債	
未払金	15,973,053
未払解約金	1,117,000
未払利息	87
流動負債合計	17,090,140
負債合計	17,090,140
純資産の部	
元本等	
元本	4,492,026,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	182,919,066
元本等合計	4,674,945,532
純資産合計	4,674,945,532
負債純資産合計	4,692,035,672

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	為替予約取引

法	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4.収益及び費用の計上基準	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 7月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	2,904,392,071円
期中追加設定元本額	5,782,324,189円
期中一部解約元本額	4,194,689,794円
期末元本額	4,492,026,466円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	586,105,330円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	425,619,168円
りそなラップ型ファンド（成長型）	221,720,844円
ＤＣりそな　グローバルバランス	11,739,083円
つみたてバランスファンド	368,283,176円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	157,824,507円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	76,584,681円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	46,582,614円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	2,997,243円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,485,706円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	896,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,543,943円
リスクコントロール・オープン	1,379,388円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	68,393,904円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	1,721,497,948円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	23,809,063円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	61,287,205円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	61,135,328円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	183,199,474円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	131,675,317円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	83,655,722円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	53,876,350円

りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	171,192,549円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	27,892,044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）	649,508円
２．　計算日における受益権の総数	
	4,492,026,466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	1.0407円
(10,000口当たり純資産額)	(10,407円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△168,407,974
合計	△168,407,974

(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	533,245	30,037,690.85	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	413,917	13,083,916.37	
		米ドル 小計	947,162	43,121,607.22 (4,563,128,476)	
合計				4,563,128,476 (4,563,128,476)	

(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 7月27日現在

資産の部
　流動資産

	2020年 7月27日現在
コール・ローン	381,489,801
投資証券	17,361,437,220
派生商品評価勘定	995,790
未収配当金	110,413,493
前払金	15,101,100
差入委託証拠金	64,965,000
流動資産合計	17,934,402,404
資産合計	17,934,402,404
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,385,440
未払解約金	36,789,000
未払利息	1,034
流動負債合計	50,175,474
負債合計	50,175,474
純資産の部	
元本等	
元本	15,468,007,281
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,416,219,649
元本等合計	17,884,226,930
純資産合計	17,884,226,930
負債純資産合計	17,934,402,404

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 7月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	11,378,192,415円
期中追加設定元本額	19,321,875,321円

期中一部解約元本額	15,232,060,455円
期末元本額	15,468,007,281円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	532,673,084円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	387,832,901円
りそなラップ型ファンド（成長型）	358,196,710円
ＤＣりそな　グローバルバランス	10,628,732円
つみたてバランスファンド	676,734,334円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	170,905,965円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	83,461,132円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	50,543,661円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	3,250,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,659,439円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	935,139円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,628,993円
リスクコントロール・オープン	1,228,751円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	3,320,684,790円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	2,288,566,569円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	2,287,422,859円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	21,699,958円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	69,097,211円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	67,101,355円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	165,759,547円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	117,031,121円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	75,381,568円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	48,550,251円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	155,712,500円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	25,094,354円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,190,491,217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）	617,967円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,354,117,087円
２．　計算日における受益権の総数	
	15,468,007,281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	1.1562円
(10,000口当たり純資産額)	(11,562円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△3,783,521,738
合計	△3,783,521,738

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

（2020年 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	519,452,150	－	507,062,500	△12,389,650
合計		519,452,150	－	507,062,500	△12,389,650

（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	243	26,754,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	289	27,830,700	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	444	65,001,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	663	455,481,000	

ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2,559	181,944,900	
森ヒルズリート投資法人	2,295	319,464,000	
産業ファンド投資法人	2,569	501,982,600	
アドバンス・レジデンス投資法人	1,892	654,632,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,301	257,858,200	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	999	346,153,500	
ＧＬＰ投資法人	5,161	876,853,900	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	868	294,686,000	
日本プロロジスリート投資法人	3,001	1,054,851,500	
星野リゾート・リート投資法人	303	128,775,000	
Ｏｎｅリート投資法人	311	74,982,100	
イオンリート投資法人	2,152	241,024,000	
ヒューリックリート投資法人	1,696	209,456,000	
日本リート投資法人	648	206,388,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12,813	163,237,620	
積水ハウス・リート投資法人	5,831	409,336,200	
トーセイ・リート投資法人	434	44,224,600	
ケネディクス商業リート投資法人	770	147,070,000	
ヘルスケア＆メディカル投資法人	425	52,445,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	399	40,338,900	
野村不動産マスターファンド投資法人	6,439	835,782,200	
いちごホテルリート投資法人	330	20,493,000	
ラサールロジポート投資法人	1,854	341,877,600	
スターアジア不動産投資法人	662	60,970,200	
マリモ地方創生リート投資法人	197	19,030,200	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	568	307,856,000	
大江戸温泉リート投資法人	339	19,865,400	
さくら総合リート投資法人	432	34,560,000	
投資法人みらい	2,268	80,060,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	468	42,775,200	
三菱地所物流リート投資法人	393	178,422,000	
ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	454	72,503,800	
ザイマックス・リート投資法人	289	25,143,000	
タカラレーベン不動産投資法人	566	49,298,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	415	65,943,500	
日本ビルファンド投資法人	1,931	1,162,462,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,994	1,102,682,000	
日本リテールファンド投資法人	3,769	497,884,900	
オリックス不動産投資法人	3,974	545,232,800	
日本プライムリアルティ投資法人	1,311	384,647,400	
プレミア投資法人	1,801	211,797,600	
東急リアル・エステート投資法人	1,337	183,035,300	

	グローバル・ワン不動産投資法人	1,385	136,007,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,478	456,756,000	
	森トラスト総合リート投資法人	1,425	177,127,500	
	インヴィンシブル投資法人	8,748	226,573,200	
	フロンティア不動産投資法人	708	216,648,000	
	平和不動産リート投資法人	1,242	136,495,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,303	415,005,500	
	福岡リート投資法人	1,031	129,390,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	617	372,668,000	
	いちごオフィスリート投資法人	1,544	107,153,600	
	大和証券オフィス投資法人	460	270,480,000	
	阪急阪神リート投資法人	901	105,236,800	
	スターツプロシード投資法人	311	64,439,200	
	大和ハウスリート投資法人	2,846	788,626,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,425	267,280,000	
	大和証券リビング投資法人	2,442	257,386,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,845	211,068,000	
合計		117,568	17,361,437,220	

(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。

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	66,105,421
コール・ローン	35,554,433
投資証券	19,263,330,575
未収入金	19,548,139
未収配当金	31,796,000
流動資産合計	19,416,334,568
資産合計	19,416,334,568
負債の部	
流動負債	

	2020年 7月27日現在
派生商品評価勘定	288,930
未払解約金	2,285,000
未払利息	96
流動負債合計	2,574,026
負債合計	2,574,026
純資産の部	
元本等	
元本	21,226,241,671
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△1,812,481,129
元本等合計	19,413,760,542
純資産合計	19,413,760,542
負債純資産合計	19,416,334,568

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 7月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	12,589,398,578円
期中追加設定元本額	23,606,312,069円
期中一部解約元本額	14,969,468,976円
期末元本額	21,226,241,671円
期末元本の内訳※	

りそなラップ型ファンド（安定型）	660,159,361円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	772,425,009円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,781,771,879円
ＤＣりそな　グローバルバランス	13,285,803円
つみたてバランスファンド	412,484,360円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	243,549,256円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	118,394,934円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	70,945,949円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	4,439,325円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	3,748,786円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,306,546円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	2,303,190円
リスクコントロール・オープン	6,146,624円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	8,459,709,253円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	4,204,125,358円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	1,250,122,298円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	27,009,756円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	86,335,127円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	96,276,884円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	411,037,426円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	287,830,391円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	188,656,397円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	121,488,255円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	383,374,925円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	61,587,928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）	2,004,616円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,555,722,035円
２．　計算日における受益権の総数	
	21,226,241,671口
３．　元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,812,481,129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	0.9146円
(10,000口当たり純資産額)	(9,146円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27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。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27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 7月27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 7月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△3,215,780,957
合計	△3,215,780,957

(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 7月27日現在）　　（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	24,455,500	－	24,166,570	△288,930
	米ドル	19,303,038	－	19,045,800	△257,238
	英ポンド	1,291,237	－	1,288,770	△2,467
	シンガポールドル	3,861,225	－	3,832,000	△29,225
合計		24,455,500	－	24,166,570	△288,930

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

①計算日において為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,937	174,613.53	
		AGREE REALTY CORP	9,155	570,356.50	
		ALEXANDER'S INC	368	91,367.04	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,283	3,587,249.65	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,232	210,492.24	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,565	810,164.70	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	135,144.72	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	42,494	1,158,811.38	
		AMERICOLD REALTY TRUST	33,424	1,281,141.92	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,027	892,212.55	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,978	308,505.96	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	66,200	26,480.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,169	4,886.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,732	3,485,044.20	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	25,342.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,404	2,212,710.68	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	11,871.33	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	27,601	294,226.66	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,116	560,296.88	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,842	109,935.14	
		BRT APARTMENTS CORP	877	9,024.33	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,240	1,453,967.20	
		CARETRUST REIT INC	15,511	264,307.44	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	3,399.03	
		CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	14,057.36	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,481	45,118.92	
		CITY OFFICE REIT INC	8,644	82,290.88	

CLIPPER REALTY INC		1,350	8,842.50	
COLONY CAPITAL INC		83,392	150,105.60	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC		18,542	215,828.88	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC		3,736	161,245.76	
CORECIVIC INC		19,484	173,602.44	
COREPOINT LODGING INC		7,200	35,352.00	
CORESITE REALTY CORP		6,772	843,994.36	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES		19,132	479,447.92	
COUSINS PROPERTIES INC		25,471	734,838.35	
CUBESMART		32,476	897,961.40	
CYRUSONE INC		19,556	1,552,061.94	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO		34,147	163,905.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC		45,252	6,651,591.48	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST		38,700	144,351.00	
DOUGLAS EMMETT INC		27,619	791,836.73	
DUKE REALTY CORP		62,078	2,313,026.28	
EAGLE HOSPITALITY TRUST		82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC		12,162	279,482.76	
EASTGROUP PROPERTIES INC		6,647	807,942.85	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A		25,942	170,179.52	
EPR PROPERTIES		13,450	420,043.50	
EQUINIX INC		14,914	10,997,434.46	
EQUITY COMMONWEALTH		20,728	650,030.08	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES		30,744	2,015,884.08	
EQUITY RESIDENTIAL		59,006	3,206,386.04	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY		14,956	222,993.96	
ESSEX PROPERTY TRUST INC		11,046	2,365,169.52	
EXTRA SPACE STORAGE INC		21,865	2,085,921.00	
FARMLAND PARTNERS INC		3,259	22,715.23	
FEDERAL REALTY INVS TRUST		11,773	859,311.27	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR		21,342	874,808.58	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST		11,417	260,764.28	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C		15,990	77,551.50	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP		8,641	72,065.94	

GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,614	1,165,453.38	
GEO GROUP INC/THE	19,721	212,789.59	
GETTY REALTY CORP	6,175	182,780.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	112,316.04	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	40,726.07	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	86,082.15	
GLOBAL NET LEASE INC	14,550	233,673.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,203	673,351.06	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36,679	978,595.72	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	91,045	2,389,020.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	20,178.49	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,532	644,476.32	
HOST HOTELS & RESORTS INC	117,560	1,234,380.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,165	612,784.30	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,354	166,437.36	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,134	224,684.12	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,440	320,126.40	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,974	138,140.52	
INVITATION HOMES INC	91,686	2,524,115.58	
IRON MOUNTAIN INC	48,124	1,310,897.76	
JBG SMITH PROPERTIES	20,196	581,644.80	
KILROY REALTY CORP	17,696	999,647.04	
KIMCO REALTY CORP	72,457	778,912.75	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,699	131,099.43	
LEXINGTON REALTY TRUST	47,838	519,520.68	
LIFE STORAGE INC	8,049	751,696.11	
LTC PROPERTIES INC	6,359	236,681.98	
MACERICH CO/THE	20,631	164,016.45	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	211,345.93	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	256,400	185,890.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	88,138	1,667,570.96	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,314	2,149,068.78	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	15,850	222,534.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,790	990,376.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,977	291,428.17	

		NATL HEALTH INVESTORS INC	7,223	427,240.45	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,695	53,519.95	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	4,057	142,887.54	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,819	189,728.03	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,989	1,185,256.80	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,170	36,911.70	
		PARAMOUNT GROUP INC	30,907	215,421.79	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	40,506	345,516.18	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,138	227,357.26	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	9,978.15	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	34,938	610,366.86	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20,377	317,881.20	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	26,859.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	62,234.00	
		PRIME US REIT	62,000	48,050.00	
		PROLOGIS INC	124,359	12,424,707.69	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,480	456,088.80	
		PUBLIC STORAGE	25,368	4,702,212.48	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,355	709,835.25	
		REALTY INCOME CORP	57,874	3,323,125.08	
		REGENCY CENTERS CORP	28,317	1,131,547.32	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,899	191,257.88	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34,737	212,590.44	
		RETAIL VALUE INC	1,615	19,380.00	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,570	861,471.60	
		RLJ LODGING TRUST	28,086	226,373.16	
		RPT REALTY	15,048	91,792.80	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,023	282,690.59	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,637	500,343.48	
		SAFEHOLD INC	2,352	114,542.40	
		SAUL CENTERS INC	2,130	64,602.90	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,842	46,628.46	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	190,370.64	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	51,511	3,120,021.27	
		SITE CENTERS CORP	24,168	167,242.56	

		SL GREEN REALTY CORP	12,885	598,379.40	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,442	568,958.04	
		STAG INDUSTRIAL INC	25,054	776,423.46	
		STORE CAPITAL CORP	37,067	839,567.55	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	101,673.60	
		SUN COMMUNITIES INC	16,597	2,354,782.36	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	35,478	257,925.06	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,020	110,970.40	
		TAUBMAN CENTERS INC	9,971	379,296.84	
		TERRENO REALTY CORP	11,502	644,342.04	
		UDR INC	49,122	1,743,339.78	
		UMH PROPERTIES INC	5,256	63,702.72	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,060	138,885.20	
		URBAN EDGE PROPERTIES	17,978	181,757.58	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	53,182.24	
		VENTAS INC	63,146	2,258,732.42	
		VEREIT INC	178,972	1,111,416.12	
		VICI PROPERTIES INC	79,446	1,670,749.38	
		VORNADO REALTY TRUST	26,517	928,360.17	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	15,637.13	
		WASHINGTON REIT	13,364	285,187.76	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	19,496	325,193.28	
		WELLTOWER INC	70,479	3,624,030.18	
		WHITESTONE REIT	7,716	49,536.72	
		WP CAREY INC	29,193	1,938,415.20	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	20,048	170,408.00	
	米ドル 小計		4,219,373	135,620,257.75 (14,351,335,675)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,085	413,585.85	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,997	70,086.63	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,226	126,315.14	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,701	651,619.56	
		CHOICE PROPERTIES REIT	26,037	323,379.54	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,280	106,638.40	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	108,876.80	

		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	121,394.45	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	140,957.18	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,061	81,220.00	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	246,017.88	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,848	360,206.40	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,054	242,522.72	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	158,197.23	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	143,515.61	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,894	34,016.24	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,047	29,026.46	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	6,008	208,177.20	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,751	171,213.37	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,823	385,020.93	
		SLATE OFFICE REIT	4,169	15,341.92	
		SLATE RETAIL REIT - U	1,920	17,625.60	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,423	252,062.67	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,126	138,842.70	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	27,984.00	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,100	105,774.00	
		カナダドル 小計	272,908	4,679,618.48 (369,736,656)	
ユーロ		AEDIFICA	4,439	428,363.50	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,130	326,886.30	
		ALTAREA	659	77,498.40	
		BEFIMMO	4,044	153,267.60	
		COFINIMMO	4,226	511,346.00	
		COVIVIO	8,276	508,560.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	7,371	79,901.64	
		GECINA SA	9,127	989,366.80	
		HAMBORNER REIT AG	12,779	107,151.91	
		HIBERNIA REIT PLC	124,814	140,540.56	
		ICADE	4,706	266,830.20	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	15,694.67	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,440	286,921.80	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,158	68,844.40	

		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	106,216.92	
		KLEPIERRE	35,203	558,143.56	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	50,705.95	
		MERCIALYS	3,481	23,061.62	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	60,185	414,072.80	
		MONTEA	1,871	177,745.00	
		NSI NV	3,090	95,944.50	
		RETAIL ESTATES	1,989	113,373.00	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,902	1,106,624.64	
		VASTNED RETAIL NV	2,560	53,888.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,050	570,323.25	
		WERELDHAVE NV	7,169	55,129.61	
	ユーロ 小計		502,892	7,286,402.83 (901,328,030)	
	英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	15,320.00	
		ASSURA PLC	432,419	337,719.23	
		BIG YELLOW GROUP PLC	26,421	257,340.54	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	78,960.00	
		BRITISH LAND CO PLC	158,720	569,011.20	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,700	202,580.00	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	3,880.80	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,652	127,522.06	
		DERWENT LONDON PLC	18,288	518,281.92	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	64,676.48	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,364	240,076.65	
		HAMMERSON PLC	135,561	95,055.37	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	126,100	685,479.60	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	150,742	334,647.24	
		LXI REIT PLC	94,678	100,548.03	
		NEWRIVER REIT PLC	56,051	33,630.60	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	65,928.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213,711	319,711.65	
		RDI REIT PLC	48,350	42,548.00	
		REGIONAL REIT LTD	68,961	46,893.48	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	33,857	250,880.37	

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	35,863.78	
	SEGRO PLC	201,616	1,864,948.00	
	SHAFTESBURY PLC	36,422	178,467.80	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	49,939	50,937.78	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	294,977	440,105.68	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	124,710	81,685.05	
	UNITE GROUP PLC	68,253	634,411.63	
	WORKSPACE GROUP PLC	21,040	119,296.80	
英ポンド 小計		3,245,661	7,796,407.74 (1,057,738,638)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	66,607	180,504.97	
	APN INDUSTRIA REIT	13,219	32,783.12	
	ARENA REIT	52,557	118,253.25	
	BWP TRUST	82,681	323,282.71	
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	139,284.00	
	CHARTER HALL GROUP	80,514	809,970.84	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,828	347,729.88	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,091	270,773.02	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	137,235.67	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	324,502	288,806.78	
	DEXUS	181,412	1,629,079.76	
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	97,120.10	
	GOODMAN GROUP	274,553	4,464,231.78	
	GPT GROUP	322,528	1,328,815.36	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	172,124.56	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,020	59,486.60	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,899	229,535.40	
	MIRVAC GROUP	653,152	1,365,087.68	
	NATIONAL STORAGE REIT	158,638	301,412.20	
	RURAL FUNDS GROUP	45,950	94,197.50	
	SCENTRE GROUP	883,360	1,863,889.60	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	174,242	383,332.40	
	STOCKLAND	407,672	1,316,780.56	
	VICINITY CENTRES	670,328	918,349.36	
	WAYPOINT REIT LTD	119,935	326,223.20	

オーストラリアドル 小計		5,006,659	17,198,290.30 (1,296,235,139)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	187,009.90	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	187,660	409,098.80	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	272,970	281,159.10	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	314,830.99	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	49,526	129,510.49	
ニュージーランドドル 小計		841,430	1,321,609.28 (93,094,157)	
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,341,860.00	
	FORTUNE REIT	239,000	1,589,350.00	
	LINK REIT	347,600	20,473,640.00	
	PROSPERITY REIT	226,000	515,280.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	136,000	495,040.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	939,600.00	
香港ドル 小計		1,556,600	25,354,770.00 (346,092,610)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	98,942.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	175,200	105,996.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	501,600	1,745,568.00	
	ASCOTT TRUST	316,596	296,017.26	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	490,600	843,832.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	487,500	965,250.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	140,500	179,840.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	143,100	144,531.00	
	ESR REIT	305,700	122,280.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	80,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	107,400	64,440.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	126,100	301,379.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	60,833.50	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	396,379	499,437.54	
	KEPPEL DC REIT	200,400	589,176.00	
	KEPPEL REIT	327,600	360,360.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	127,100	80,073.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	24,688.40	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	353,400	664,392.00	

		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	262,400	829,184.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	506,400	1,083,696.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	354,900	319,410.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	446,000	176,170.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	70,900	241,769.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	60,838.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	69,535.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	41,873.50	
		SPH REIT	127,200	107,484.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	200,500	98,245.00	
		SUNTEC REIT	386,200	536,818.00	
	シンガポールドル 小計		7,480,875	10,792,158.70 (827,218,964)	
	韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	15,600	80,028,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	26,773,000.00	
	韓国ウォン 小計		19,700	106,801,000.00 (9,451,888)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	29,265	357,910.95	
	イスラエルシュケル 小計		29,265	357,910.95 (11,098,818)	
合計				19,263,330,575 (19,263,330,575)	

(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%	74.5%
カナダドル	投資証券	26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%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券	25銘柄	100.0%	6.7%
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%	1.8%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	4.3%
韓国ウォン	投資証券	2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシュケル	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。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 7月31日現在です。

【つみたてバランスファンド】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	7,625,801,882円
Ⅱ　負債総額	5,590,422円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	7,620,211,460円
Ⅳ　発行済口数	7,497,979,815口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0163円

（参考）

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	26,610,101,324円
Ⅱ　負債総額	217,045,667円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,393,055,657円
Ⅳ　発行済口数	24,870,285,882口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0612円

ＲＡＭ先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	63,757,247,670円
Ⅱ　負債総額	63,190,373円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	63,694,057,297円
Ⅳ　発行済口数	47,978,361,320口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3276円

ＲＡＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	9,342,057,118円
Ⅱ　負債総額	7,460,217円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,334,596,901円
Ⅳ　発行済口数	7,217,786,020口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2933円

ＲＡＭ国内債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	85,310,658,382円
Ⅱ　負債総額	4,286,831円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	85,306,371,551円
Ⅳ　発行済口数	80,911,661,150口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0543円

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	26,175,153,058円
Ⅱ　負債総額	91,267,654円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	26,083,885,404円
Ⅳ　発行済口数	24,613,690,797口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0597円

ＲＡＭ新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	4,985,402,979円
Ⅱ　負債総額	182,540,845円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,802,862,134円
Ⅳ　発行済口数	4,665,474,545口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0294円

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	18,217,562,459円
Ⅱ　負債総額	255,813,307円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	17,961,749,152円
Ⅳ　発行済口数	15,618,977,329口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1500円

ＲＡＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	20,841,887,578円
Ⅱ　負債総額	457,735,854円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	20,384,151,724円
Ⅳ　発行済口数	21,671,665,578口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9406円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容
①　譲渡制限はありません。
②　受益権の譲渡
・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

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

（５）受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一

定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2020年7月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

●過去５年間における主な資本金の増減

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7月末現在）

①　会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。
取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。取締役会は、業務執行を分担して行う責任者を執行役員として選任することができます。また、取締役会は、取締役および執行役員の職務執行を監督します。
取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。
取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。
取締役は株主総会において選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。
監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。
経営会議は、経営に関する全般的重要事項および重要な業務執行案件を協議します。
監査等委員会は、代表取締役その他の業務執行取締役の職務の執行を監査する独立の機関であるとともに、監査等委員である取締役以外の業務執行取締役の選任・解任・辞任および報酬等について監査等委員会としての意見を決定します。

②　投資運用の意思決定機構

委託会社では、以下P.D.C.Aサイクルにて投資運用の意思決定を行っています。
○PLAN：計画
・運用戦略部は、運用基本方針や主な投資制限などを策定し、運用委員会にて協議します。
○DO：実行
・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。
○CHECK：検証→ACTION：改善
・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。
2020年7月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	79	776,530
単位型株式投資信託	6	121,885
合計	85	898,416

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	769,705
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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	△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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	△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	25.96%

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	29.07%

（企業結合等関係）

共通支配下の取引等

（１）取引の概要

①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

②企業結合日

2020年１月１日

③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

④結合後の名称

りそなアセットマネジメント株式会社

⑤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

①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。

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がいないため、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

①営業収益

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

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

②有形固定資産

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

（３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	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）	1,159,040 1,059,624	未収運用受託報酬 未収投資助言報酬	1,224,680 350,629
							支払手数料（注3）	706,067	未払手数料	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
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年10月25日	有価証券届出書
2019年10月25日	有価証券報告書
2020年 4月24日	有価証券届出書
2020年 4月24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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結

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

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

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

監査人は、監査等委員会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2020年9月17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

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」に掲げられているつみたてバランスファンドの2019年7月26日から2020年7月27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、つみたてバランスファンドの2020年7月27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、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付け

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

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

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

利害関係

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

以　上

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