【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年10月27日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡　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
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	りそなラップ型ファンド（安定型） りそなラップ型ファンド（安定成長型） りそなラップ型ファンド（成長型）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	りそなラップ型ファンド（安定型） 1兆円を上限とします。 りそなラップ型ファンド（安定成長型） 1兆円を上限とします。 りそなラップ型ファンド（成長型） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（1）【ファンドの名称】

りそなラップ型ファンド（安定型）
りそなラップ型ファンド（安定成長型）
りそなラップ型ファンド（成長型）
・以下、上記を総称して「ファンド」または「当ファンド」ということがあります。また、各々については、正式名称ではなく、以下の略称および愛称を使用することがあります。

ファンドの名称	略称	愛称
りそなラップ型ファンド（安定型）	安定型	Ｒ２４６（安定型）
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	安定成長型	Ｒ２４６（安定成長型）
りそなラップ型ファンド（成長型）	成長型	Ｒ２４６（成長型）

・愛称として「Ｒ２４６」という名称を用いることがあります。

（2）【内国投資信託受益証券の形態等】

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

（3）【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

（4）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
・基準価額につきましては、販売会社または「（8）申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

（5）【申込手数料】

申込手数料（スイッチングの際の申込手数料を含みます。）につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。

（6）【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

（7）【申込期間】

2020年10月28日から2021年4月23日までとします。
・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

（８）【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（９）【払込期日】

- **取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとします。**
- **申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額（設定総額）は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。**

（１０）【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

（１１）【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

（１２）【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

＜りそなラップ型ファンド（安定型）＞

信託財産の中長期的な安定性を重視した成長を目指して運用を行います。

＜りそなラップ型ファンド（安定成長型）＞

信託財産の中長期的な安定性と成長性のバランスを重視した成長を目指して運用を行います。

＜りそなラップ型ファンド（成長型）＞

信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

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

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

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

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

＜商品分類の定義＞

1. 単位型投信・追加型投信の区分

(1)単位型投信：当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行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 各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの8つの資産に分散投資します。

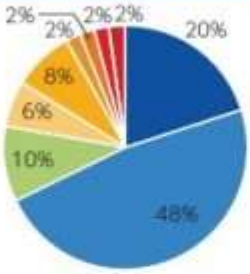
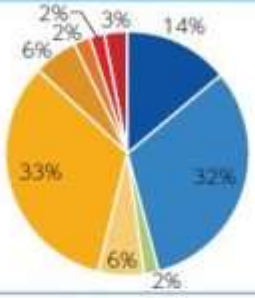
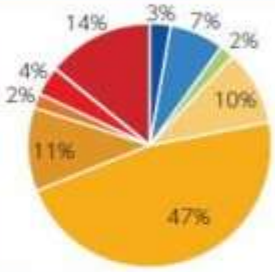
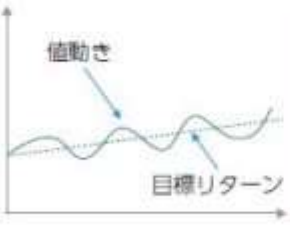
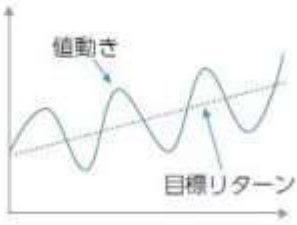
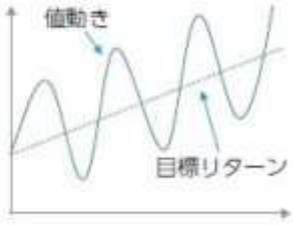
● 各マザーファンドは、以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

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

2 目標リターン別に3つの運用タイプからお選びいただけます。

- 5年から10年程度の中長期的な運用のニーズやお客さまがとり得るリスクの水準に応じて3つのファンドからお好みの運用タイプをお選びいただけます。
- 運用にあたっては、目標リターンから下落するリスクを低減しつつ、目標リターンを目指します。

運用タイプ ※目標リターン等：(年率)	安定型	安定成長型	成長型
	目標リターン：短期金利+2% リスク水準：4.22%	目標リターン：短期金利+4% リスク水準：8.93%	目標リターン：短期金利+6% リスク水準：15.45%
基本的資産配分 ※2020年3月時点			
資産配分の方針	各マザーファンドへの投資配分比率は、5年から10年程度の上記目標リターンの追求および各ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。		
目標リターンとリスク水準の関係 (イメージ)			

※「目標リターン」とは、必ず一定の収益を得ることのできる運用を意味するものではなく、記載されている目標リターンの数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。従って、投資者の元本が保証されるものではなく、各ファンドの基準価額は下落することがあります。
※目標リターンは、運用管理費用（信託報酬）控除後のものです。その他発生する費用につきましては考慮していません。
※目標リターンに記載している短期金利は円LIBOR３ヵ月もののことを指します。
※目標リターンは、５年から10年程度の中長期的な期間、運用することを想定して設定しています。
※リスク水準は、2003年４月から2020年２月までの期間を通じ、各ファンドの資産配分が上記割合であったと仮定した上で、各マザーファンドが参照しているインデックスの収益率に基づき算出したものです。実際の運用では資産配分の見直しや各マザーファンド（インデックス）のリスク水準の変化等に伴って将来的に変動します。
※上記の基本的資産配分は、2020年３月時点のものです。四捨五入の関係で合計が100％にならない場合があります。基本的資産配分は、各運用タイプの「目標リターン」に応じて、各マザーファンド（インデックス）の過去の収益率およびリスクに鑑み下方リスク水準の低減を目指して定期的に見直します。ただし、信託財産に現金等が含まれることや各マザーファンドの基準価額が変動すること等により、実際の資産別構成比率が上記の基本的資産配分と一致しない場合があります。
※「目標リターンとリスク水準の関係」は、あくまでイメージを示したものであり、基準価額の上昇を示唆・保証するものではありません。

3 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

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

- 当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオに基づきポートフォリオをシミュレーションした結果、目標リターンからのマイナス幅が一番小さいポートフォリオを採用します。

運用期間中も資産配分の見直しを行います。

- 資産配分の見直しについては、①年1回程度の基本的資産配分の策定と②市況動向に応じた資産配分の見直しを実施し、③売買の執行・投資比率の調整を行うことで、運用期間中も目標リターンからのマイナス幅（下落リスク）を最小化するよう運用していきます。

運用プロセスのイメージ

①基本的資産配分の策定（年1回程度）

ポートフォリオの下方リスク抑制の考え方をもとに
定量モデルを用いて基本となる資産配分を策定

②市況動向に応じた資産配分の見直し（適時）

市場環境や主要国・地域の市場テーマ、マクロ
分析等から定性判断に基づいて資産配分比率の
見直しを実施

▼

③売買の執行・投資比率の調整（適時）

資産配分比率に基づくポートフォリオの構築・リバランスを実施

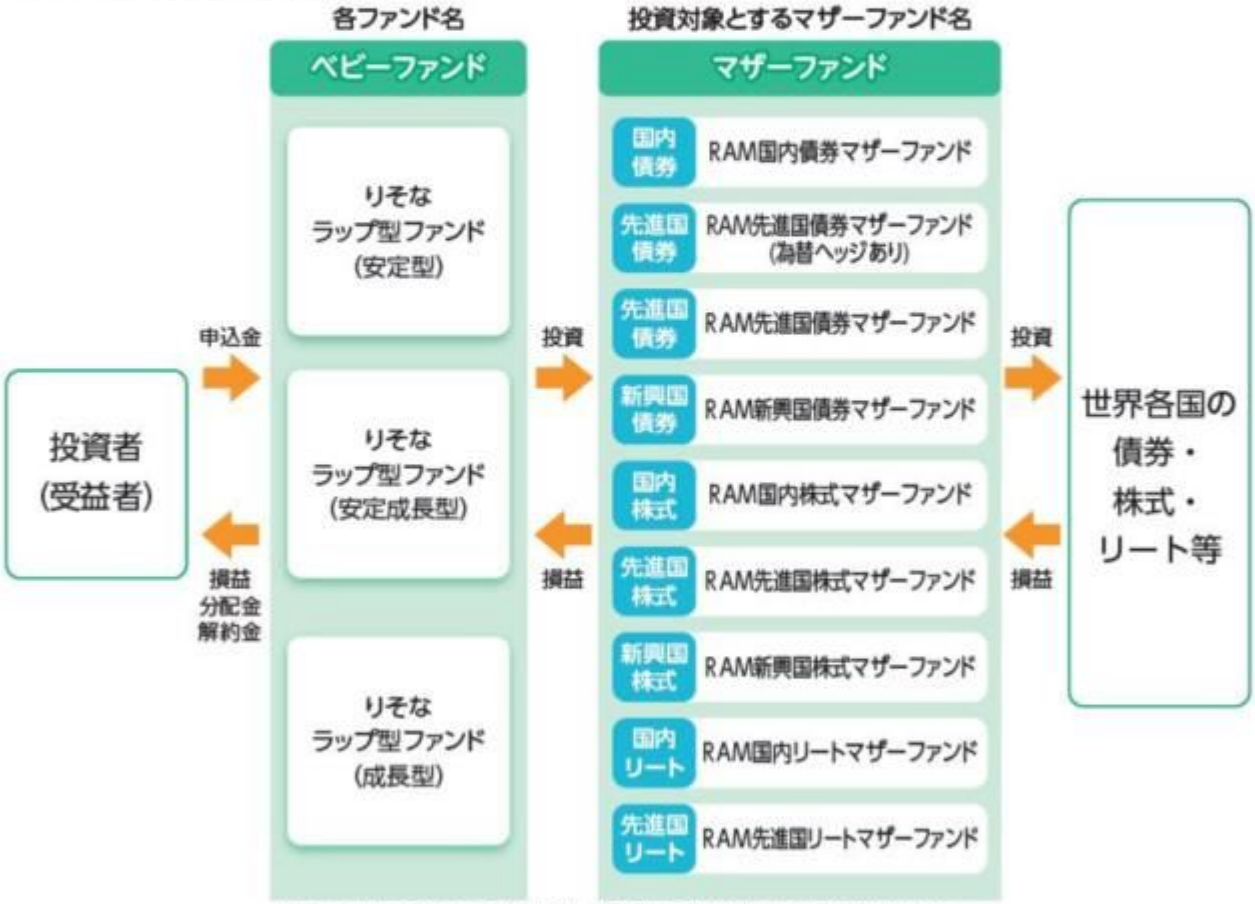
4 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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

ファンドの仕組み

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



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

主な投資制限

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

分配方針

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RAM国内債券マザーファンド

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

●RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RAM先進国債券マザーファンド

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

●RAM新興国債券マザーファンド

「JPモルガンGBI−EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI−EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI−EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・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。

●RAM国内株式マザーファンド

「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

●RAM先進国株式マザーファンド

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

●RAM新興国株式マザーファンド

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

●RAM国内リートマザーファンド

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

●RAM先進国リートマザーファンド

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

④　信託金限度額

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

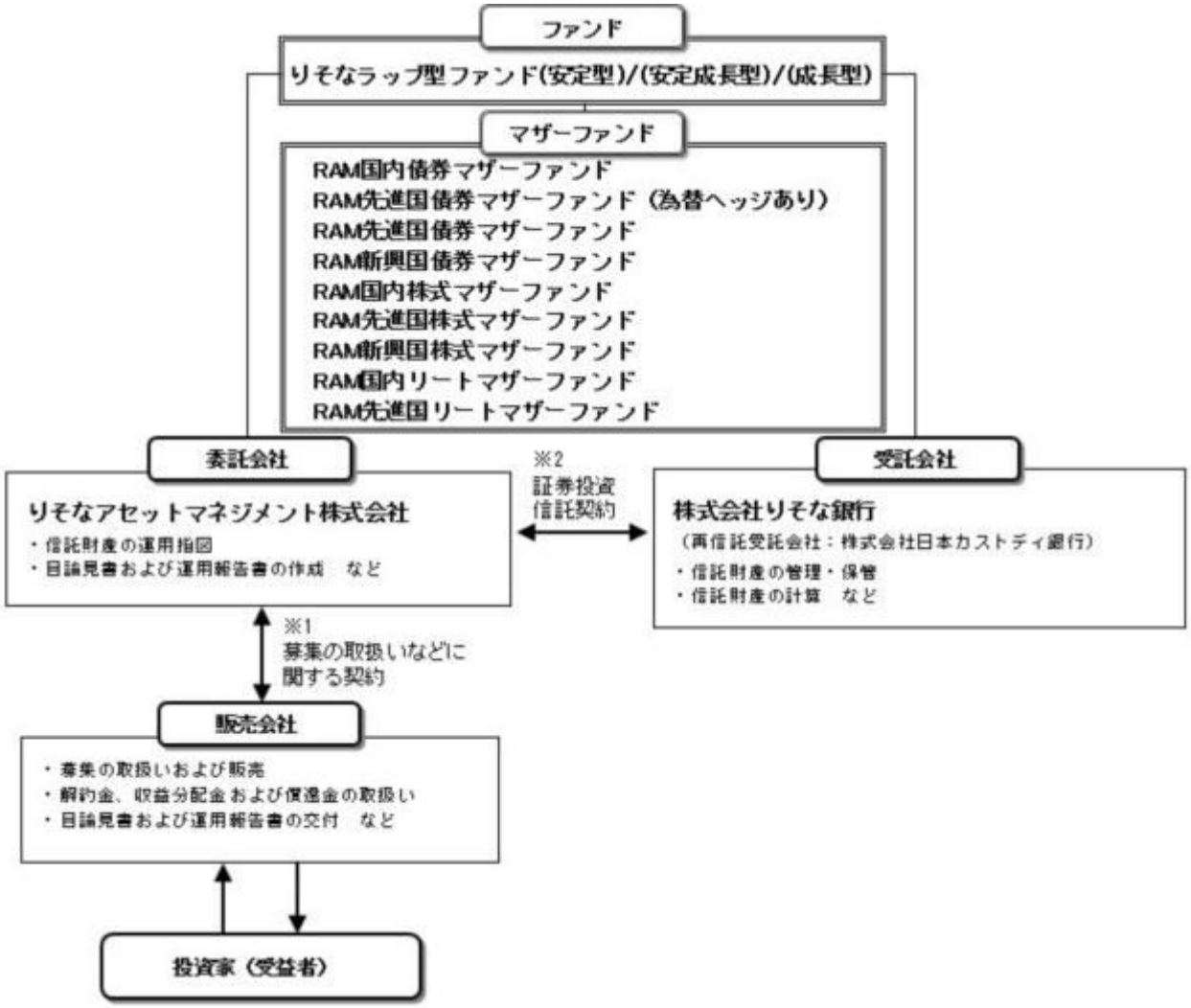
（2）【ファンドの沿革】

2016年2月26日
・ファンドの信託契約締結、運用開始

2019年9月3日
・投資対象に「ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」を追加する旨の約款変更を実施

（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】

以下に掲げるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

ⅰ　ＲＡＭ国内債券マザーファンド受益証券
ⅱ　ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）受益証券
ⅲ　ＲＡＭ先進国債券マザーファンド受益証券
ⅳ　ＲＡＭ新興国債券マザーファンド受益証券
ⅴ　ＲＡＭ国内株式マザーファンド受益証券
ⅵ　ＲＡＭ先進国株式マザーファンド受益証券
ⅶ　ＲＡＭ新興国株式マザーファンド受益証券
ⅷ　ＲＡＭ国内リートマザーファンド受益証券
ⅸ　ＲＡＭ先進国リートマザーファンド受益証券

＜りそなラップ型ファンド（安定型）＞

①　主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）への分散投資を行い、信託財産の中長期的な安定性を重視した運用を行います。

②　各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標（円短期金利[※1]＋2%[※2]（年率））の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。

※1　3ヵ月円LIBORです。

※2　信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

③　株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

④　実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

⑤　各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

⑥　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

＜りそなラップ型ファンド（安定成長型）＞

①　主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）への分散投資を行い、信託財産の中長期的な安定性と成長性のバランスを重視した運用を行います。

②　各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標（円短期金利[※1]＋4%[※2]（年率））の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。

※1　3ヵ月円LIBORです。

※2　信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

③　株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

④　実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

⑤　各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

⑥　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

＜りそなラップ型ファンド（成長型）＞

①　主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）への分散投資を行い、信託財産の中長期的な成長性を重視した運用を行います。

②　各マザーファンド受益証券への投資比率は、5年から10年程度の中長期的な運用収益目標（円短期金

利[※1]＋6%[※2]（年率））の追求および当ファンド全体の下方リスク水準の低減を目指して決定するとともに、投資環境に応じて変更します。

※1　3ヵ月円LIBORです。

※2　信託報酬控除後のものです。その他の費用については考慮しておりません。

③　株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

④　実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

⑤　各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げる場合があります。

⑥　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

（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（為替ヘッジあり）＞

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

投資方針	①　主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 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　外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。 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12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜ＲＡＭ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

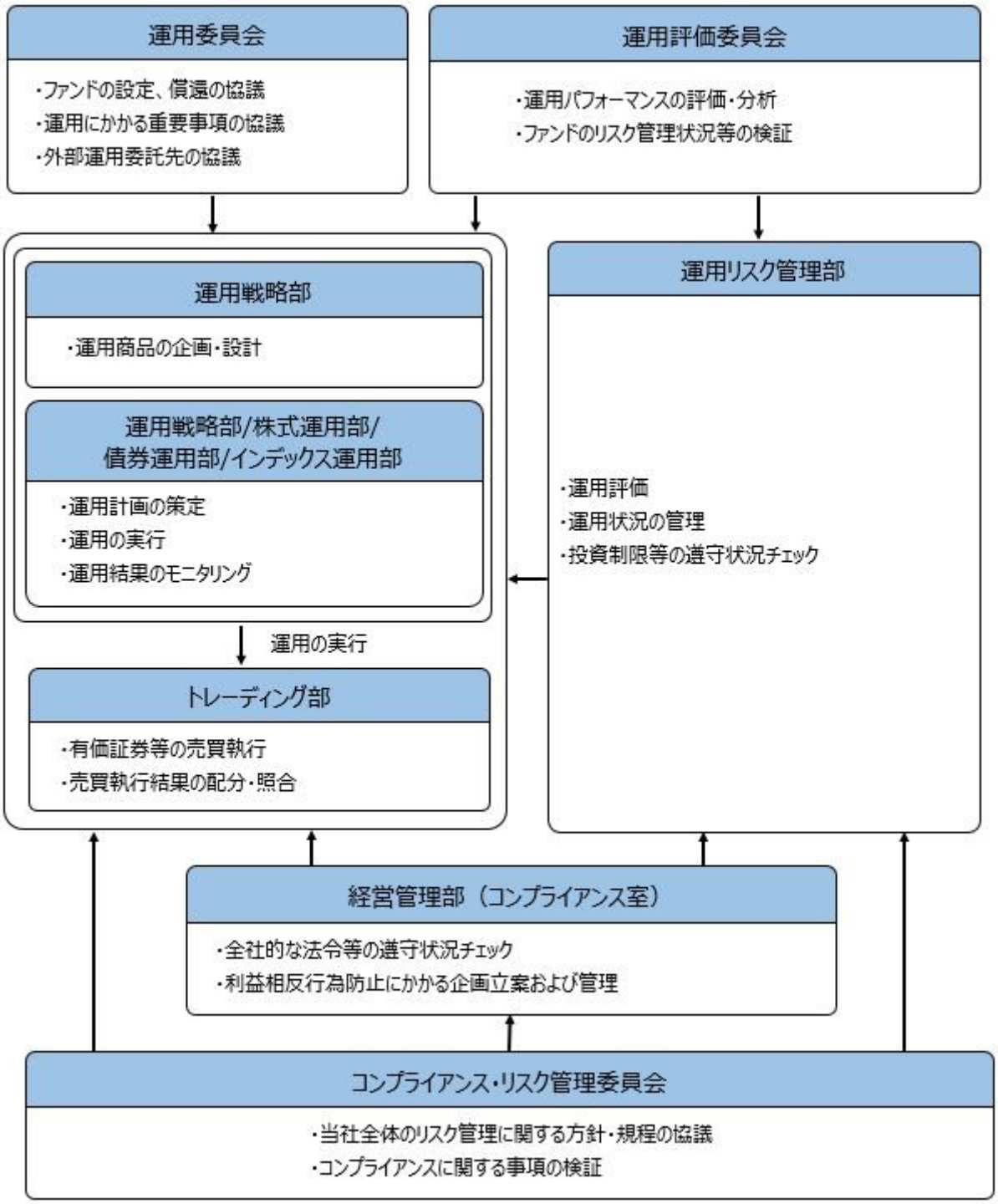
＜ＲＡＭ先進国リートマザーファンド＞

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、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。

３）留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

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

② 収益分配金の支払い

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

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

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

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

（５）【投資制限】

① 約款に定める投資制限

１）株式への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

８）投資する株式等の範囲

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

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

９）信用取引の指図範囲

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

２．前記１．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株

予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

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

10）先物取引等の運用指図および範囲

1．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

ロ）先物取引の買建およびプット・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取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」

といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

ハ）コール・オプションおよびプット・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。また当ファンドは原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの一部低減を図ることとしていますが、当該部分の為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行う通貨の短期金利より円短期金利が低い場合には、その金利差相当分のコストがかかります。

② 資産配分リスク

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

③ 信用リスク

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

④ 流動性リスク

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

⑤ カントリーリスク

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

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

①「目標リターン」とは、必ず一定の収益を得ることのできる運用を意味するものではなく、記載されている目標リターンの数値は、その達成を示唆・保証するものではありません。従って、投資者の元本が保証されるものではなく、各ファンドの基準価額は下落することがあります。

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。

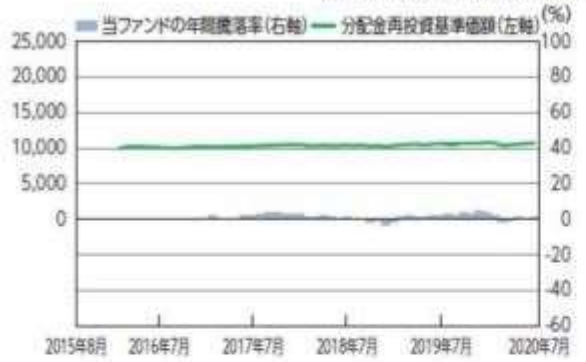
※上記体制は2020年7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

りそなラップ型ファンド(安定型)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

2015年8月末～2020年7月末

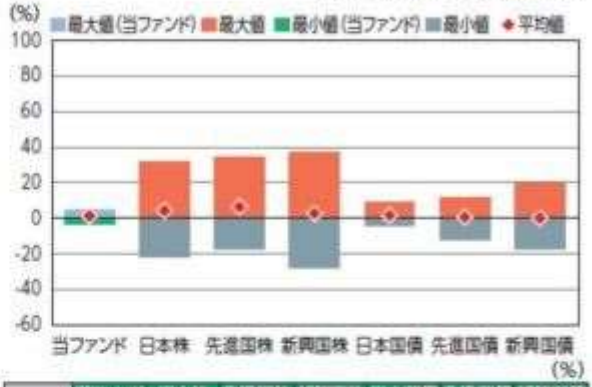


＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2017年2月から2020年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

2015年8月末～2020年7月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	4.7	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△2.9	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.4	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(当ファンドは2017年2月から2020年7月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

りそなラップ型ファンド(安定成長型)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

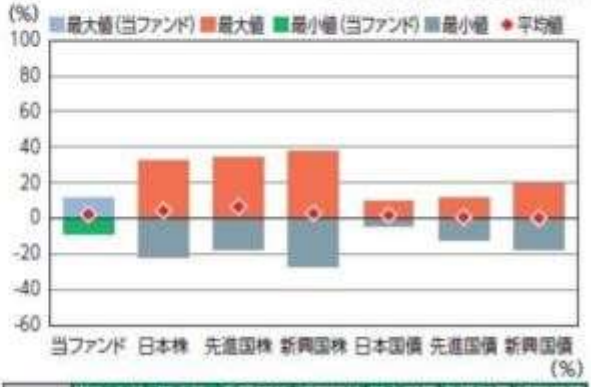
2015年8月末～2020年7月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2017年2月から2020年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

2015年8月末～2020年7月末



(%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	11.2	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△8.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.2	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(当ファンドは2017年2月から2020年7月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

りそなラップ型ファンド(成長型)

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

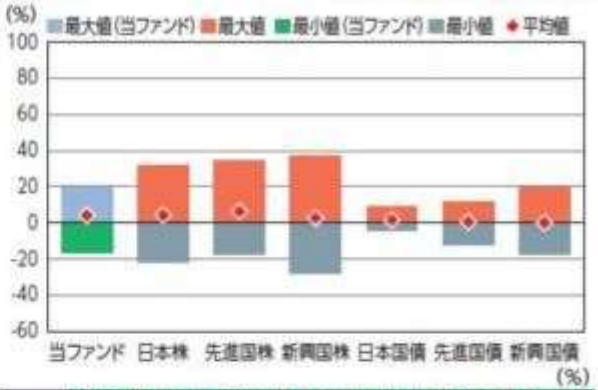
2015年8月末～2020年7月末

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2017年2月から2020年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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

2015年8月末～2020年7月末



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	19.9	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△16.4	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	4.2	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（当ファンドは2017年2月から2020年7月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)

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

JPモルガンGBI－EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

申込手数料（スイッチングの際の申込手数料を含みます。）につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。
・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2%）が上限となっております。
・申込手数料の額（１口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得

た額とします。
・＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。
※申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

（２）【換金（解約）手数料】

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、各ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。
＜りそなラップ型ファンド（安定型）＞
年率0.66%（税抜0.60%）
＜りそなラップ型ファンド（安定成長型）＞
年率1.10%（税抜1.00%）
＜りそなラップ型ファンド（成長型）＞
年率1.21%（税抜1.10%）
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。

ファンド	信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
りそなラップ型ファンド（安定型）	0.60%	0.28%	0.28%	0.04%
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1.00%	0.48%	0.48%	
りそなラップ型ファンド（成長型）	1.10%	0.53%	0.53%	

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

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。

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

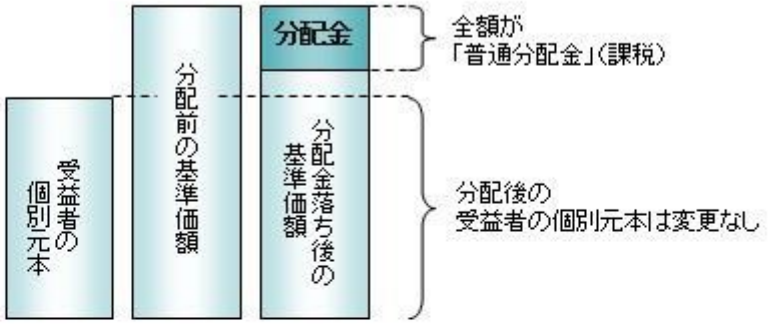
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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。

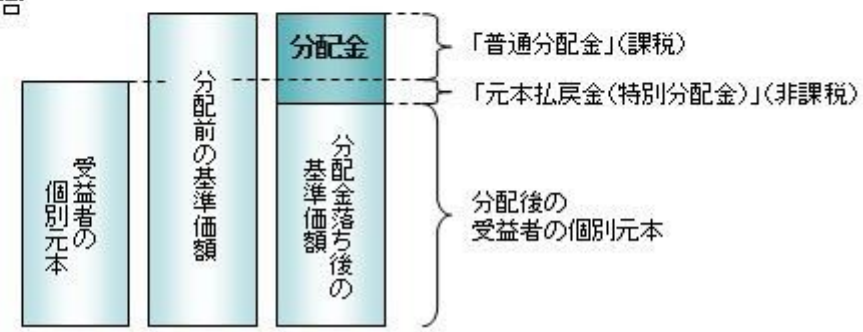
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜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】

【りそなラップ型ファンド（安定型）】

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	31,077,497,423	99.56
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	137,309,286	0.44
合計（純資産総額）		31,214,806,709	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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	13,787,119,474	1.0348	14,267,525,347	1.0770	14,848,727,673	47.57
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	6,016,141,609	1.0632	6,396,580,154	1.0543	6,342,818,098	20.32
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	3,023,970,586	1.0205	3,086,252,096	1.0597	3,204,501,629	10.27
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	1,799,088,565	1.2817	2,306,034,592	1.3276	2,388,469,978	7.65
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	1,718,623,871	1.1317	1,945,130,361	1.0612	1,823,803,651	5.84
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	671,077,584	1.0722	719,593,247	0.9406	631,215,575	2.02
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	477,932,450	1.3072	624,761,882	1.2933	618,110,037	1.98
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	532,673,084	1.2637	673,175,519	1.1500	612,574,046	1.96
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	589,932,715	1.1036	651,050,772	1.0294	607,276,736	1.95

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.56
合　　計	99.56

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　(2017年 1月25日)	20,784	20,784	1.0185	1.0185
第2計算期間末　(2018年 1月25日)	22,683	22,683	1.0567	1.0567
第3計算期間末　(2019年 1月25日)	25,807	25,807	1.0330	1.0330
第4計算期間末　(2020年 1月27日)	30,465	30,465	1.0764	1.0764
2019年 7月末日	27,801	—	1.0614	—
8月末日	28,154	—	1.0627	—
9月末日	29,082	—	1.0627	—
10月末日	28,437	—	1.0661	—
11月末日	28,902	—	1.0681	—
12月末日	29,688	—	1.0696	—
2020年 1月末日	30,663	—	1.0792	—
2月末日	30,455	—	1.0695	—
3月末日	29,314	—	1.0374	—
4月末日	29,355	—	1.0470	—
5月末日	29,332	—	1.0566	—
6月末日	29,961	—	1.0635	—
7月末日	31,214	—	1.0708	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	1.85
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.75
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	△2.24
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4.20
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	△0.46

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	25,381,905,439	4,973,752,236
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	6,097,994,810	5,039,903,818
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	7,006,194,546	3,489,739,773
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	8,485,272,377	5,165,483,563
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	3,551,373,988	2,823,349,525

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

以下の運用状況は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	22,593,150,144	99.23
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	175,400,045	0.77
合計（純資産総額）		22,768,550,189	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先進国株式マザーファンド	5,642,825,422	1.2088	6,821,358,829	1.3276	7,491,415,030	32.90
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	6,828,599,239	1.0368	7,080,116,866	1.0770	7,354,401,380	32.30
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	2,964,043,553	1.0627	3,149,898,905	1.0543	3,124,991,117	13.73
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	1,213,573,607	1.1467	1,391,646,698	1.0612	1,287,844,311	5.66
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	986,354,630	1.2949	1,277,277,894	1.2933	1,275,652,442	5.60
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	772,425,009	1.0911	842,818,621	0.9406	726,542,963	3.19
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	422,914,688	1.0252	433,572,139	1.0597	448,162,694	1.97
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	387,832,901	1.2805	496,627,417	1.1500	446,007,836	1.96
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	425,619,168	1.1100	472,477,642	1.0294	438,132,371	1.92

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.23
合　　計	99.23

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　(2017年 1月25日)	11,533	11,533	1.0254	1.0254
第2計算期間末　(2018年 1月25日)	13,222	13,222	1.1092	1.1092
第3計算期間末　(2019年 1月25日)	15,814	15,814	1.0460	1.0460
第4計算期間末　(2020年 1月27日)	21,818	21,818	1.1280	1.1280
2019年 7月末日	18,386	—	1.0859	—
8月末日	18,392	—	1.0727	—
9月末日	19,204	—	1.0857	—
10月末日	19,914	—	1.1047	—
11月末日	20,275	—	1.1135	—
12月末日	21,145	—	1.1211	—
2020年 1月末日	21,610	—	1.1249	—
2月末日	21,150	—	1.0839	—
3月末日	19,637	—	0.9923	—
4月末日	20,491	—	1.0304	—
5月末日	21,147	—	1.0511	—
6月末日	21,954	—	1.0627	—
7月末日	22,768	—	1.0785	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）

第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	―

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	2.54
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	8.17
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	△5.70
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	7.84
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	△4.24

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	13,938,406,425	2,689,976,686
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3,629,066,210	2,956,644,450
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	5,192,436,946	1,994,834,117
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	6,629,563,738	2,405,436,519
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	3,097,816,338	1,431,848,564

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

【りそなラップ型ファンド（成長型）】

以下の運用状況は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	11,783,117,716	99.50
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	59,045,839	0.50
合計（純資産総額）		11,842,163,555	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先進国株式マザーファンド	4,168,679,831	1.3687	5,706,044,238	1.3276	5,534,339,343	46.73
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	1,793,781,924	1.1237	2,015,847,553	0.9406	1,687,231,277	14.25
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	970,658,305	1.3257	1,286,883,766	1.2933	1,255,352,385	10.60
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	1,114,632,398	1.1557	1,288,213,166	1.0612	1,182,847,900	9.99
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	813,673,264	1.0481	852,873,657	1.0770	876,326,105	7.40
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	358,196,710	1.3197	472,725,311	1.1500	411,926,216	3.48
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	352,951,629	1.0558	372,667,176	1.0543	372,116,902	3.14
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	219,654,805	1.0256	225,277,969	1.0597	232,768,196	1.97
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	223,634,537	1.0952	244,939,489	1.0294	230,209,392	1.94

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.50
合　　計	99.50

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　(2017年 1月25日)	4,579	4,579	1.0940	1.0940
第2計算期間末　(2018年 1月25日)	5,569	5,569	1.2340	1.2340
第3計算期間末　(2019年 1月25日)	7,562	7,562	1.1363	1.1363

第4計算期間末　(2020年 1月27日)	11,154	11,154	1.3102	1.3102
2019年 7月末日	9,383	—	1.2156	—
8月末日	9,246	—	1.1702	—
9月末日	9,623	—	1.2090	—
10月末日	9,993	—	1.2564	—
11月末日	10,037	—	1.2796	—
12月末日	10,720	—	1.3025	—
2020年 1月末日	11,283	—	1.2972	—
2月末日	10,799	—	1.2040	—
3月末日	9,454	—	1.0012	—
4月末日	10,505	—	1.0672	—
5月末日	10,715	—	1.1003	—
6月末日	11,231	—	1.1196	—
7月末日	11,842	—	1.1419	—

②【分配の推移】

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

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	9.40
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	12.80
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	△7.92
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	15.30
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	△12.65

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2016年 2月26日～2017年 1月25日	5,825,054,815	1,639,445,533

第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	2,050,607,361	1,722,691,092
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	3,485,323,161	1,344,051,033
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4,205,065,813	2,346,609,085
当中間期	2020年 1月28日～2020年 7月27日	2,922,426,981	1,113,692,755

(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（為替ヘッジあり）

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	79,819,408,898	43.74
	カナダ	3,325,410,806	1.82
	メキシコ	1,349,030,796	0.74
	ドイツ	13,935,063,519	7.64
	イタリア	17,004,861,452	9.32
	フランス	18,743,493,064	10.27
	オランダ	3,676,117,887	2.01
	スペイン	11,136,754,330	6.10
	ベルギー	4,702,117,745	2.58
	オーストリア	2,861,745,313	1.57
	フィンランド	1,115,307,646	0.61
	アイルランド	1,489,242,897	0.82
	イギリス	11,931,408,900	6.54
	スウェーデン	526,677,053	0.29
	ノルウェー	377,487,516	0.21
	デンマーク	927,916,693	0.51
	ポーランド	1,112,141,766	0.61
	オーストラリア	4,011,191,650	2.20
	シンガポール	760,161,236	0.42
	マレーシア	884,525,592	0.48
	イスラエル	689,368,594	0.38
	小計	180,379,433,353	98.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	2,098,828,078	1.15
合計（純資産総額）		182,478,261,431	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
為替予約取引	売建	—	179,728,701,380	△98.49

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	13,221.44	832,950,720	14,971.48	943,203,675	3.000	2048/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	10,975.24	834,118,684	11,049.80	839,785,171	1.500	2024/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,750,000	10,810.41	837,806,775	10,833.45	839,592,717	1.625	2022/12/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,560,000	10,800.99	816,555,297	10,761.94	813,603,409	2.000	2022/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	14,428.14	728,621,082	15,032.36	759,134,599	3.000	2048/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,770,000	10,962.84	742,184,467	11,008.53	745,277,957	1.375	2025/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,780,000	12,428.19	718,349,705	12,719.31	735,176,590	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	12,055.63	707,665,965	12,458.22	731,297,931	2.875	2028/8/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,130,000	22,595.04	707,225,052	23,244.48	727,552,363	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,189.42	704,933,491	11,413.86	719,073,307	1.500	2030/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,242.99	690,505,169	12,338.10	695,868,858	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,255.65	687,720,627	11,383.83	695,552,032	2.375	2024/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,590,000	11,585.72	647,641,898	12,410.42	693,742,578	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,248.70	656,924,401	11,383.21	664,779,895	2.500	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,362.46	630,616,832	11,807.74	655,329,898	2.250	2027/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	18,947.32	651,787,925	18,880.33	649,483,502	5.500	2029/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,215.86	624,723,720	11,551.14	643,399,029	2.250	2025/11/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,940,000	15,645.92	616,449,586	15,843.33	624,227,302	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,217.52	614,720,602	11,353.59	622,176,929	2.750	2023/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,579.99	606,791,713	11,841.65	620,502,948	2.250	2027/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,010,000	10,949.52	548,571,352	12,155.45	608,988,510	2.375	2029/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	10,876.00	609,056,512	10,841.62	607,131,044	2.375	2022/3/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,032.75	584,735,945	11,380.96	603,191,384	2.000	2025/8/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,090,000	14,444.83	590,793,943	14,745.94	603,109,310	1.500	2031/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,654.89	570,037,101	11,208.33	599,646,122	2.125	2024/3/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,630.46	564,077,466	12,264.55	594,830,867	2.750	2028/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,530,000	10,450.33	577,903,378	10,460.20	578,449,279	0.125	2022/4/30	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,770,000	15,328.32	577,877,974	15,335.83	578,161,148	3.500	2026/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	13,694.58	493,005,169	16,043.02	577,548,900	3.375	2048/11/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,730,000	15,259.15	569,166,598	15,342.89	572,289,798	2.750	2027/10/25	0.31

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.85
合　　計	98.85

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	売建	759,441,000.00	81,755,750,105	79,429,934,190	△43.53
	カナダドル	売建	42,619,000.00	3,359,149,038	3,318,741,530	△1.82
	メキシコペソ	売建	285,107,000.00	1,325,766,804	1,351,407,180	△0.74
	ユーロ	売建	599,755,000.00	72,651,233,007	74,447,588,150	△40.80
	英ポンド	売建	86,936,000.00	11,527,914,722	11,927,619,200	△6.54
	スウェーデンクローナ	売建	43,949,000.00	507,807,174	529,145,960	△0.29
	ノルウェークローネ	売建	32,778,000.00	364,647,621	377,930,340	△0.21
	デンマーククローネ	売建	55,729,000.00	905,933,340	929,002,430	△0.51
	ポーランドズロチ	売建	40,045,000.00	1,089,581,262	1,125,664,950	△0.62
	オーストラリアドル	売建	53,583,000.00	3,970,634,913	4,038,014,880	△2.21
	シンガポールドル	売建	9,923,000.00	766,733,011	756,926,440	△0.41
	マレーシアリンギット	売建	32,630,000.00	820,646,911	804,655,800	△0.44
	イスラエルシュケル	売建	22,521,000.00	702,831,153	692,070,330	△0.38

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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

りそなラップ型ファンド(安定型)

2020年7月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,708円	純資産総額	312億円

※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)

2017年1月25日	0円
2018年1月25日	0円
2019年1月25日	0円
2020年1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国内債券マザーファンド	20.3
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	47.6
RAM先進国債券マザーファンド	10.3
RAM国内株式マザーファンド	5.8
RAM先進国株式マザーファンド	7.7
RAM新興国株式マザーファンド	2.0
RAM新興国債券マザーファンド	1.9
RAM国内リートマザーファンド	2.0
RAM先進国リートマザーファンド	2.0
現金等	0.4
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	76.4
米ドル	12.4
ユーロ	5.3
英ポンド	1.0
豪ドル	0.5
その他	4.4
合計	100.0

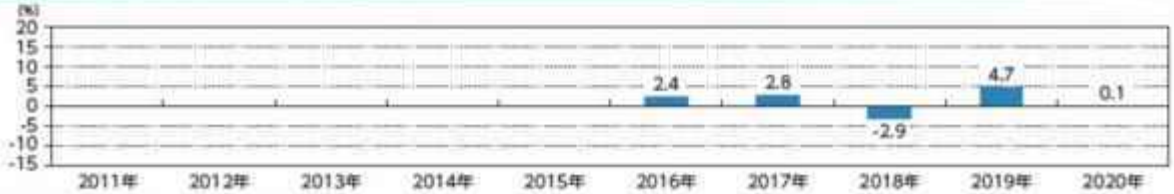
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

■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(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2024/11/30	0.46
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.46
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
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
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)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2016年2月26日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は2月26日から12月末までの騰落率です。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。

りそなラップ型ファンド(安定成長型)

2020年7月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,785円	純資産総額	227億円

※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)

2017年1月25日	0円
2018年1月25日	0円
2019年1月25日	0円
2020年1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国内債券マザーファンド	13.7
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	32.3
RAM先進国債券マザーファンド	2.0
RAM国内株式マザーファンド	5.7
RAM先進国株式マザーファンド	32.9
RAM新興国株式マザーファンド	5.6
RAM新興国債券マザーファンド	1.9
RAM国内リートマザーファンド	2.0
RAM先進国リートマザーファンド	3.2
現金等	0.8
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。
※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	54.5
米ドル	29.7
ユーロ	5.5
英ポンド	1.4
香港ドル	1.2
その他	7.6
合計	100.0

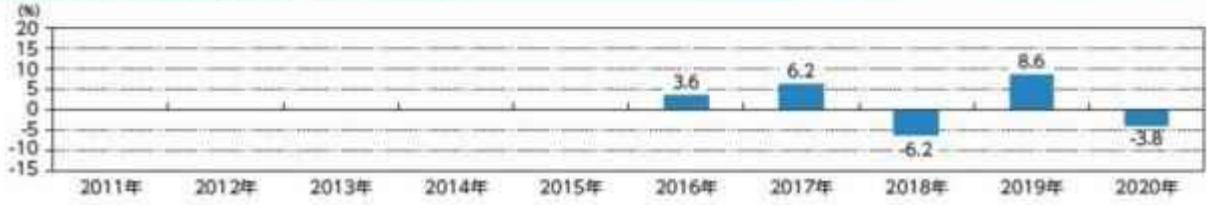
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	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(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2024/11/30	0.46
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.46
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
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
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)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2016年2月26日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は2月26日から12月末までの騰落率です。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。

りそなラップ型ファンド(成長型)

2020年7月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,419円	純資産総額	118億円

※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)

2017年1月25日	0円
2018年1月25日	0円
2019年1月25日	0円
2020年1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国内債券マザーファンド	3.1
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	7.4
RAM先進国債券マザーファンド	2.0
RAM国内株式マザーファンド	10.0
RAM先進国株式マザーファンド	46.7
RAM新興国株式マザーファンド	10.6
RAM新興国債券マザーファンド	1.9
RAM国内リートマザーファンド	3.5
RAM先進国リートマザーファンド	14.2
現金等	0.5
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
米ドル	50.2
日本円	24.6
ユーロ	8.0
英ポンド	2.5
香港ドル	2.4
その他	12.4
合計	100.0

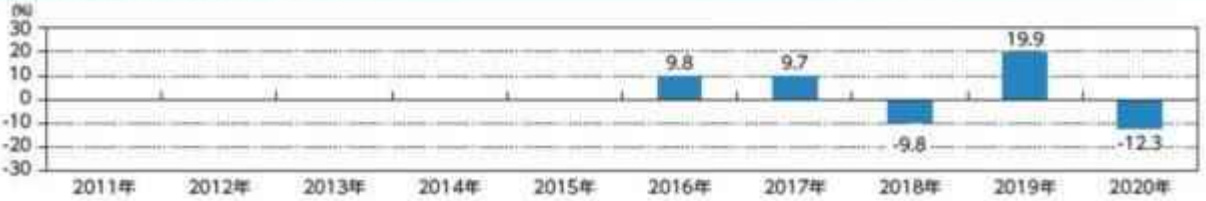
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

■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(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2024/11/30	0.46
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.46
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
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
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)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2016年2月26日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は2月26日から12月末までの騰落率です。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）スイッチング

・スイッチングとは、保有しているファンドを売却し、その売却代金をもって他のファンドを取得することで、売却するファンドと取得するファンドを同時に申込みいただきます。

・申込みの際に、スイッチングの旨をご指示ください。

※販売会社によっては、一部のファンドのみの取扱いとなる場合や全部または一部のファンド間でスイッチングが行なえない場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（４）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（５）取扱時間

原則として、午後3時までに、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。

（６）取得申込不可日

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

●ニューヨークの銀行の休業日

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ロンドンの銀行の休業日

●ロンドン証券取引所の休業日

（７）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。

（８）申込単位

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。

（９）申込代金の支払い

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

（10）受付の中止および取消

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

※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号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（スイッチングを含みます。）の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

●ニューヨークの銀行の休業日

●ニューヨーク証券取引所の休業日

●ロンドンの銀行の休業日
●ロンドン証券取引所の休業日

（４）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、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

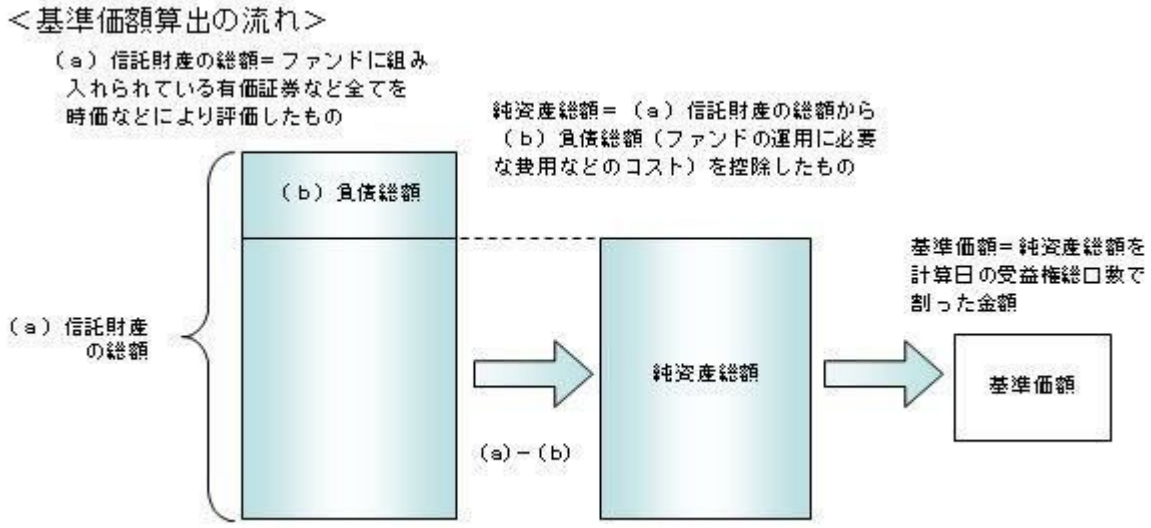
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求（スイッチングを含みます。以下同じ。）の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとし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

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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（2016年2月26日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

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

（５）【その他】

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）各ファンドの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき

ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

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。

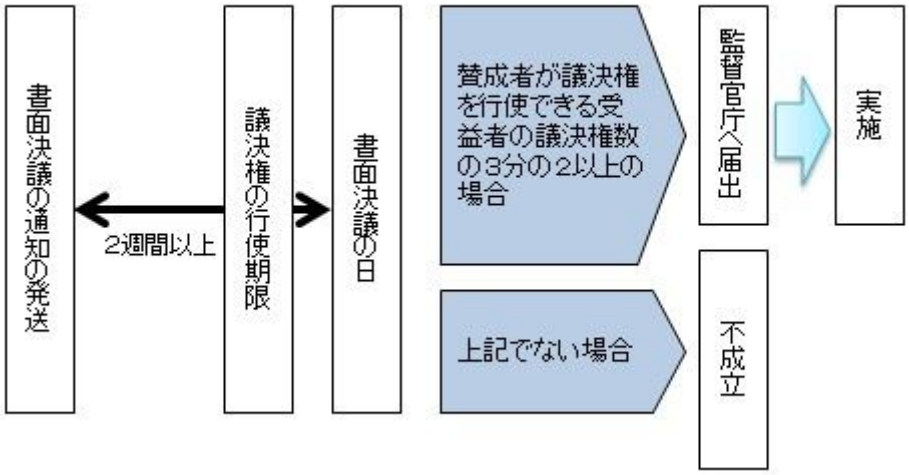
４）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書

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】

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

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

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年 1月26日から2020年 1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】

【りそなラップ型ファンド（安定型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年 1月25日現在	第4期 2020年 1月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	244,247,112	215,489,268
親投資信託受益証券	25,666,827,631	30,381,306,096
流動資産合計	25,911,074,743	30,596,795,364
資産合計	25,911,074,743	30,596,795,364
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,383,158	33,027,316
未払受託者報酬	5,375,512	6,429,744
未払委託者報酬	75,257,134	90,016,275
未払利息	662	584
その他未払費用	1,346,603	1,366,236
流動負債合計	103,363,069	130,840,155
負債合計	103,363,069	130,840,155
純資産の部		
元本等		
元本	24,982,698,968	28,302,487,782
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	825,012,706	2,163,467,427
（分配準備積立金）	967,282,132	1,299,355,430
元本等合計	25,807,711,674	30,465,955,209
純資産合計	25,807,711,674	30,465,955,209
負債純資産合計	25,911,074,743	30,596,795,364

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年 1月26日 至　2019年 1月25日	第4期 自　2019年 1月26日 至　2020年 1月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	△344,525,200	1,323,478,465
営業収益合計	△344,525,200	1,323,478,465
営業費用		
支払利息	175,781	205,782
受託者報酬	10,355,828	12,148,239
委託者報酬	144,981,462	170,075,189
その他費用	2,597,821	2,587,132
営業費用合計	158,110,892	185,016,342
営業利益又は営業損失（△）	△502,636,092	1,138,462,123
経常利益又は経常損失（△）	△502,636,092	1,138,462,123
当期純利益又は当期純損失（△）	△502,636,092	1,138,462,123
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（△）	△60,676,189	105,981,617
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,217,435,757	825,012,706
剰余金増加額又は欠損金減少額	237,986,550	489,842,739
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	237,986,550	489,842,739
剰余金減少額又は欠損金増加額	188,449,698	183,868,524
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	188,449,698	183,868,524
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	825,012,706	2,163,467,427

（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1月26日から翌年1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 1月26日から2020年 1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3期 2019年 1月25日現在		第4期 2020年 1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	21,466,244,195円	期首元本額	24,982,698,968円
期中追加設定元本額	7,006,194,546円	期中追加設定元本額	8,485,272,377円
期中一部解約元本額	3,489,739,773円	期中一部解約元本額	5,165,483,563円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	24,982,698,968口	２． 計算期間の末日における受益権の総数	28,302,487,782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	1.0330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	1.0764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)	(10,330円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,764円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日		第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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	199,994,666円	A 費用控除後の配当等収益額	402,402,301円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	103,465,643円
C 収益調整金額	373,551,490円	C 収益調整金額	864,111,997円
D 分配準備積立金額	767,287,466円	D 分配準備積立金額	793,487,486円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	1,340,833,622円	E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	2,163,467,427円
F 当ファンドの期末残存口数	24,982,698,968口	F 当ファンドの期末残存口数	28,302,487,782口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	536円	G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	764円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 1月25日現在	第4期 2020年 1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3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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	△163,063,060	709,984,425
合計	△163,063,060	709,984,425

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国内債券マザーファンド	5,763,205,997	6,134,932,783	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	13,941,105,859	14,391,403,578	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	3,285,160,939	3,343,308,287	
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	525,138,072	592,355,745	
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	1,742,935,848	2,076,359,475	
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	1,458,591,769	2,065,511,804	
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	415,870,035	576,104,759	
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	409,235,380	605,136,356	
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	490,532,590	596,193,309	
合計		28,031,776,489	30,381,306,096	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年 1月25日現在	第4期 2020年 1月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	174,184,246	211,932,204
親投資信託受益証券	15,746,224,124	21,743,733,155
流動資産合計	15,920,408,370	21,955,665,359
資産合計	15,920,408,370	21,955,665,359
負債の部		
流動負債		
未払解約金	21,968,708	26,548,996
未払受託者報酬	3,320,460	4,387,207
未払委託者報酬	79,690,885	105,292,925
未払利息	472	574
その他未払費用	831,923	932,201
流動負債合計	105,812,448	137,161,903
負債合計	105,812,448	137,161,903
純資産の部		
元本等		
元本	15,118,454,328	19,342,581,547
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	696,141,594	2,475,921,909
（分配準備積立金）	1,080,614,145	1,431,144,793
元本等合計	15,814,595,922	21,818,503,456
純資産合計	15,814,595,922	21,818,503,456
負債純資産合計	15,920,408,370	21,955,665,359

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年 1月26日 至　2019年 1月25日	第4期 自　2019年 1月26日 至　2020年 1月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	△645,540,553	1,599,509,031
営業収益合計	△645,540,553	1,599,509,031
営業費用		
支払利息	119,992	153,160
受託者報酬	6,236,674	8,044,480
委託者報酬	149,680,076	193,067,429
その他費用	1,565,228	1,713,473
営業費用合計	157,601,970	202,978,542
営業利益又は営業損失（△）	△803,142,523	1,396,530,489
経常利益又は経常損失（△）	△803,142,523	1,396,530,489
当期純利益又は当期純損失（△）	△803,142,523	1,396,530,489
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（△）	△70,568,561	97,122,362
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,302,102,225	696,141,594
剰余金増加額又は欠損金減少額	328,865,823	605,161,209
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	328,865,823	605,161,209
剰余金減少額又は欠損金増加額	202,252,492	124,789,021
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	202,252,492	124,789,021
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	696,141,594	2,475,921,909

（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1月26日から翌年1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 1月26日から2020年 1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3期 2019年 1月25日現在		第4期 2020年 1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	11,920,851,499円	期首元本額	15,118,454,328円
期中追加設定元本額	5,192,436,946円	期中追加設定元本額	6,629,563,738円
期中一部解約元本額	1,994,834,117円	期中一部解約元本額	2,405,436,519円
２．計算期間の末日における受益権の総数	15,118,454,328口	２．計算期間の末日における受益権の総数	19,342,581,547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	1.0460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	1.1280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)	(10,460円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,280円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日		第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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	196,072,979円	A 費用控除後の配当等収益額	373,778,406円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	120,608,203円
C 収益調整金額	532,586,540円	C 収益調整金額	1,137,280,558円
D 分配準備積立金額	884,541,166円	D 分配準備積立金額	936,758,184円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	1,613,200,685円	E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	2,568,425,351円
F 当ファンドの期末残存口数	15,118,454,328口	F 当ファンドの期末残存口数	19,342,581,547口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,067円	G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,327円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 1月25日現在	第4期 2020年 1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3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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	△405,505,565	1,122,635,168
合計	△405,505,565	1,122,635,168

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国内債券マザーファンド	2,783,463,760	2,962,997,172	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	6,734,651,724	6,952,180,974	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	422,099,426	429,570,585	
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	377,233,743	425,519,662	
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	2,983,412,431	3,554,139,229	
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	2,676,244,973	3,789,830,506	
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	617,085,627	854,848,719	
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	294,146,363	434,954,226	
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	1,925,038,738	2,339,692,082	
合計		18,813,376,785	21,743,733,155	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【りそなラップ型ファンド（成長型）】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2019年 1月25日現在	第4期 2020年 1月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	67,235,081	164,330,020
親投資信託受益証券	7,548,110,897	11,066,872,049
流動資産合計	7,615,345,978	11,231,202,069
資産合計	7,615,345,978	11,231,202,069
負債の部		
流動負債		
未払解約金	10,224,704	15,861,815
未払受託者報酬	1,548,403	2,204,607
未払委託者報酬	41,032,767	58,422,111
未払利息	182	445
その他未払費用	388,068	468,401
流動負債合計	53,194,124	76,957,379
負債合計	53,194,124	76,957,379
純資産の部		
元本等		
元本	6,654,797,679	8,513,254,407
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	907,354,175	2,640,990,283
（分配準備積立金）	659,460,954	1,211,877,747
元本等合計	7,562,151,854	11,154,244,690
純資産合計	7,562,151,854	11,154,244,690
負債純資産合計	7,615,345,978	11,231,202,069

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2018年 1月26日 至　2019年 1月25日	第4期 自　2019年 1月26日 至　2020年 1月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	△438,522,747	1,458,261,152
営業収益合計	△438,522,747	1,458,261,152
営業費用		
支払利息	56,768	82,184
受託者報酬	2,835,621	4,031,057
委託者報酬	75,143,955	106,823,011
その他費用	711,856	858,725
営業費用合計	78,748,200	111,794,977
営業利益又は営業損失（△）	△517,270,947	1,346,466,175
経常利益又は経常損失（△）	△517,270,947	1,346,466,175
当期純利益又は当期純損失（△）	△517,270,947	1,346,466,175
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（△）	△29,864,895	193,692,208
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,056,012,801	907,354,175
剰余金増加額又は欠損金減少額	635,333,516	937,038,474
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	635,333,516	937,038,474
剰余金減少額又は欠損金増加額	296,586,090	356,176,333
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	296,586,090	356,176,333
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	907,354,175	2,640,990,283

（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1月26日から翌年1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 1月26日から2020年 1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3期 2019年 1月25日現在		第4期 2020年 1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	4,513,525,551円	期首元本額	6,654,797,679円
期中追加設定元本額	3,485,323,161円	期中追加設定元本額	4,205,065,813円
期中一部解約元本額	1,344,051,033円	期中一部解約元本額	2,346,609,085円
２．計算期間の末日における受益権の総数	6,654,797,679口	２．計算期間の末日における受益権の総数	8,513,254,407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	1.1363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	1.3102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)	(11,363円)	(10,000口当たり純資産額)	(13,102円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日		第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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	91,594,084円	A 費用控除後の配当等収益額	212,161,767円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	515,298,384円
C 収益調整金額	729,428,045円	C 収益調整金額	1,429,112,536円
D 分配準備積立金額	567,866,870円	D 分配準備積立金額	484,417,596円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	1,388,888,999円	E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	2,640,990,283円
F 当ファンドの期末残存口数	6,654,797,679口	F 当ファンドの期末残存口数	8,513,254,407口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	2,087円	G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	3,102円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 1月25日現在	第4期 2020年 1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3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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3期 自 2018年 1月26日 至 2019年 1月25日	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1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	△353,564,118	1,230,109,224
合計	△353,564,118	1,230,109,224

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国内債券マザーファンド	60,167,896	64,048,725	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	150,806,800	155,677,859	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド	217,977,583	221,835,786	
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	194,658,577	219,574,874	
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	1,420,203,859	1,691,888,857	
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	3,454,544,460	4,891,980,409	
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	855,977,079	1,185,785,047	
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	389,622,834	576,135,284	
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	1,694,870,173	2,059,945,208	
合計		8,438,829,261	11,066,872,049	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

「りそなラップ型ファンド」の各ファンドは「ＲＡＭ国内債券マザーファンド」、「ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「ＲＡＭ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国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	281,392
コール・ローン	403,064,482
国債証券	67,879,350,990
地方債証券	4,251,702,000
特殊債券	4,513,095,411
社債券	3,135,485,000
未収入金	392,459,500
未収利息	142,956,853
前払費用	12,985,817
流動資産合計	80,731,381,445
資産合計	80,731,381,445
負債の部	
流動負債	
未払金	96,864,800
未払解約金	310,330,000
未払利息	1,093
流動負債合計	407,195,893
負債合計	407,195,893
純資産の部	
元本等	
元本	75,458,660,146
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,865,525,406
元本等合計	80,324,185,552
純資産合計	80,324,185,552
負債純資産合計	80,731,381,445

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 1月27日現在
１．　投資信託財産に係る元本の状況

期首	2019年 1月26日
期首元本額	61,581,519,887円
期中追加設定元本額	47,499,596,095円
期中一部解約元本額	33,622,455,836円
期末元本額	75,458,660,146円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	5,763,205,997円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,783,463,760円
りそなラップ型ファンド（成長型）	60,167,896円
ＤＣりそな　グローバルバランス	314,264,624円
つみたてバランスファンド	1,065,663,362円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	715,977,238円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	141,846,285円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	30,388,907円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	8,894,412円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,491,674円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	190,120円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	8,647円
ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	956,561,505円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	40,338,229,354円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	568,017,780円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	215,813,232円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	150,529,612円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	55,970,164円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	1,110,535,002円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	3,386,960,747円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	6,168,912,518円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	3,516,772,895円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	2,572,261,983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）	5,637,595円
りそなＦＴ　国内債券インデックス（適格機関投資家専用）	5,525,589,370円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	305,467円
２．　計算日における受益権の総数	
	75,458,660,146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	1.0645円
(10,000口当たり純資産額)	(10,645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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	152,274,330
地方債証券	△1,419,600
特殊債券	△11,428,696
社債券	12,006,000
合計	151,432,034

(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３９７回利付国債（２年）	200,000,000	200,496,000	
	第３９８回利付国債（２年）	200,000,000	200,532,000	
	第３９９回利付国債（２年）	240,000,000	240,688,800	
	第４００回利付国債（２年）	160,000,000	160,491,200	
	第４０１回利付国債（２年）	200,000,000	200,656,000	
	第４０２回利付国債（２年）	500,000,000	501,745,000	
	第４０３回利付国債（２年）	130,000,000	130,479,700	
	第４０４回利付国債（２年）	170,000,000	170,663,000	
	第４０５回利付国債（２年）	380,000,000	381,561,800	
	第４０６回利付国債（２年）	330,000,000	331,425,600	
	第４０７回利付国債（２年）	200,000,000	200,904,000	
	第１２７回利付国債（５年）	350,000,000	350,976,500	
	第１２８回利付国債（５年）	470,000,000	471,602,700	
	第１２９回利付国債（５年）	450,000,000	451,813,500	

第１３０回利付国債（５年）	560,000,000	562,604,000	
第１３１回利付国債（５年）	510,000,000	512,733,600	
第１３２回利付国債（５年）	630,000,000	633,855,600	
第１３３回利付国債（５年）	890,000,000	896,141,000	
第１３４回利付国債（５年）	970,000,000	977,323,500	
第１３５回利付国債（５年）	620,000,000	625,084,000	
第１３６回利付国債（５年）	550,000,000	554,873,000	
第１３７回利付国債（５年）	740,000,000	747,044,800	
第１３８回利付国債（５年）	880,000,000	888,958,400	
第１３９回利付国債（５年）	700,000,000	707,434,000	
第１４０回利付国債（５年）	740,000,000	748,177,000	
第１４１回利付国債（５年）	730,000,000	738,358,500	
第１回利付国債（４０年）	40,000,000	61,958,000	
第２回利付国債（４０年）	70,000,000	105,639,800	
第３回利付国債（４０年）	110,000,000	167,305,600	
第４回利付国債（４０年）	130,000,000	199,773,600	
第５回利付国債（４０年）	170,000,000	253,599,200	
第６回利付国債（４０年）	170,000,000	250,478,000	
第７回利付国債（４０年）	160,000,000	227,256,000	
第８回利付国債（４０年）	180,000,000	239,889,600	
第９回利付国債（４０年）	300,000,000	300,948,000	
第１０回利付国債（４０年）	280,000,000	328,991,600	
第１１回利付国債（４０年）	210,000,000	239,780,100	
第１２回利付国債（４０年）	140,000,000	144,982,600	
第３１３回利付国債（１０年）	320,000,000	325,257,600	
第３１４回利付国債（１０年）	130,000,000	131,839,500	
第３１５回利付国債（１０年）	295,000,000	300,510,600	
第３１６回利付国債（１０年）	300,000,000	305,187,000	
第３１７回利付国債（１０年）	460,000,000	469,397,800	
第３１８回利付国債（１０年）	366,000,000	372,873,480	
第３１９回利付国債（１０年）	140,000,000	143,294,200	
第３２０回利付国債（１０年）	352,000,000	359,613,760	
第３２１回利付国債（１０年）	391,000,000	400,606,870	
第３２２回利付国債（１０年）	220,000,000	224,932,400	
第３２３回利付国債（１０年）	340,000,000	348,568,000	
第３２４回利付国債（１０年）	183,000,000	187,172,400	
第３２５回利付国債（１０年）	470,000,000	481,848,700	
第３２６回利付国債（１０年）	280,000,000	286,955,200	
第３２７回利付国債（１０年）	387,000,000	397,739,250	
第３２８回利付国債（１０年）	461,000,000	471,981,020	
第３２９回利付国債（１０年）	477,000,000	492,531,120	
第３３０回利付国債（１０年）	257,000,000	265,992,430	

	第３３１回利付国債（１０年）	90,000,000	92,489,400	
	第３３２回利付国債（１０年）	312,000,000	321,225,840	
	第３３３回利付国債（１０年）	445,000,000	458,995,250	
	第３３４回利付国債（１０年）	421,000,000	435,052,980	
	第３３５回利付国債（１０年）	175,000,000	180,360,250	
	第３３６回利付国債（１０年）	180,000,000	185,812,200	
	第３３７回利付国債（１０年）	340,000,000	347,626,200	
	第３３８回利付国債（１０年）	741,000,000	762,303,750	
	第３３９回利付国債（１０年）	335,000,000	345,106,950	
	第３４０回利付国債（１０年）	674,000,000	695,291,660	
	第３４１回利付国債（１０年）	370,000,000	380,012,200	
	第３４２回利付国債（１０年）	220,000,000	223,476,000	
	第３４３回利付国債（１０年）	610,000,000	619,839,300	
	第３４４回利付国債（１０年）	750,000,000	762,577,500	
	第３４５回利付国債（１０年）	660,000,000	671,490,600	
	第３４６回利付国債（１０年）	470,000,000	478,304,900	
	第３４７回利付国債（１０年）	220,000,000	223,942,400	
	第３４８回利付国債（１０年）	440,000,000	447,986,000	
	第３４９回利付国債（１０年）	420,000,000	427,530,600	
	第３５０回利付国債（１０年）	560,000,000	569,889,600	
	第３５１回利付国債（１０年）	400,000,000	406,940,000	
	第３５２回利付国債（１０年）	380,000,000	386,456,200	
	第３５３回利付国債（１０年）	500,000,000	508,285,000	
	第３５４回利付国債（１０年）	470,000,000	477,567,000	
	第３５５回利付国債（１０年）	360,000,000	365,612,400	
	第３５６回利付国債（１０年）	720,000,000	730,814,400	
	第１回利付国債（３０年）	60,000,000	76,533,600	
	第１１回利付国債（３０年）	10,000,000	12,186,800	
	第１２回利付国債（３０年）	40,000,000	51,042,800	
	第１３回利付国債（３０年）	90,000,000	113,899,500	
	第１４回利付国債（３０年）	20,000,000	26,524,400	
	第１５回利付国債（３０年）	100,000,000	134,527,000	
	第１６回利付国債（３０年）	70,000,000	94,451,000	
	第１７回利付国債（３０年）	110,000,000	147,342,800	
	第１８回利付国債（３０年）	120,000,000	159,372,000	
	第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	133,247,000	
	第２０回利付国債（３０年）	60,000,000	82,053,600	
	第２１回利付国債（３０年）	90,000,000	120,692,700	
	第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	68,786,500	
	第２３回利付国債（３０年）	160,000,000	220,859,200	
	第２４回利付国債（３０年）	100,000,000	138,497,000	
	第２５回利付国債（３０年）	100,000,000	135,646,000	
	第２６回利付国債（３０年）	225,000,000	309,852,000	

	第２７回利付国債（３０年）	215,000,000	301,586,950	
	第２８回利付国債（３０年）	150,000,000	211,687,500	
	第２９回利付国債（３０年）	140,000,000	196,063,000	
	第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	264,037,300	
	第３１回利付国債（３０年）	130,000,000	179,142,600	
	第３２回利付国債（３０年）	215,000,000	302,115,850	
	第３３回利付国債（３０年）	250,000,000	338,207,500	
	第３４回利付国債（３０年）	275,000,000	384,989,000	
	第３５回利付国債（３０年）	276,000,000	376,717,920	
	第３６回利付国債（３０年）	255,000,000	349,717,200	
	第３７回利付国債（３０年）	310,000,000	420,518,100	
	第３８回利付国債（３０年）	170,000,000	227,886,700	
	第３９回利付国債（３０年）	180,000,000	245,905,200	
	第４０回利付国債（３０年）	165,000,000	222,093,300	
	第４１回利付国債（３０年）	185,000,000	245,202,700	
	第４２回利付国債（３０年）	160,000,000	212,574,400	
	第４３回利付国債（３０年）	190,000,000	252,755,100	
	第４４回利付国債（３０年）	150,000,000	200,025,000	
	第４５回利付国債（３０年）	210,000,000	270,249,000	
	第４６回利付国債（３０年）	210,000,000	270,488,400	
	第４７回利付国債（３０年）	220,000,000	289,185,600	
	第４８回利付国債（３０年）	203,000,000	257,089,350	
	第４９回利付国債（３０年）	220,000,000	279,149,200	
	第５０回利付国債（３０年）	190,000,000	212,767,700	
	第５１回利付国債（３０年）	240,000,000	238,250,400	
	第５２回利付国債（３０年）	210,000,000	219,011,100	
	第５３回利付国債（３０年）	240,000,000	256,322,400	
	第５４回利付国債（３０年）	230,000,000	257,567,800	
	第５５回利付国債（３０年）	80,000,000	89,557,600	
	第５６回利付国債（３０年）	180,000,000	201,430,800	
	第５７回利付国債（３０年）	240,000,000	268,809,600	
	第５８回利付国債（３０年）	380,000,000	425,436,600	
	第５９回利付国債（３０年）	180,000,000	196,777,800	
	第６０回利付国債（３０年）	210,000,000	241,008,600	
	第６１回利付国債（３０年）	170,000,000	185,855,900	
	第６２回利付国債（３０年）	200,000,000	207,658,000	
	第６３回利付国債（３０年）	200,000,000	202,126,000	
	第６４回利付国債（３０年）	250,000,000	252,340,000	
	第４９回利付国債（２０年）	30,000,000	30,772,500	
	第５０回利付国債（２０年）	150,000,000	153,517,500	
	第５１回利付国債（２０年）	90,000,000	92,697,300	
	第５２回利付国債（２０年）	190,000,000	197,039,500	

	第５３回利付国債（２０年）	20,000,000	20,852,200	
	第５４回利付国債（２０年）	180,000,000	188,011,800	
	第５５回利付国債（２０年）	100,000,000	104,609,000	
	第５６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,516,000	
	第５７回利付国債（２０年）	110,000,000	115,412,000	
	第５８回利付国債（２０年）	100,000,000	105,455,000	
	第５９回利付国債（２０年）	40,000,000	42,162,400	
	第６０回利付国債（２０年）	30,000,000	31,360,200	
	第６１回利付国債（２０年）	50,000,000	51,830,000	
	第６２回利付国債（２０年）	80,000,000	82,618,400	
	第６３回利付国債（２０年）	60,000,000	64,010,400	
	第６４回利付国債（２０年）	120,000,000	129,060,000	
	第６５回利付国債（２０年）	380,000,000	410,582,400	
	第６７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,712,400	
	第６８回利付国債（２０年）	90,000,000	98,830,800	
	第６９回利付国債（２０年）	60,000,000	65,637,000	
	第７０回利付国債（２０年）	110,000,000	122,400,300	
	第７１回利付国債（２０年）	100,000,000	110,389,000	
	第７２回利付国債（２０年）	210,000,000	232,094,100	
	第７３回利付国債（２０年）	180,000,000	199,076,400	
	第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	111,654,000	
	第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	110,618,000	
	第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	22,227,200	
	第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	55,571,500	
	第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	22,337,200	
	第８０回利付国債（２０年）	180,000,000	202,014,000	
	第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	33,671,100	
	第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	191,771,900	
	第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	11,337,700	
	第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	135,339,600	
	第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	170,913,000	
	第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	115,182,000	
	第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	103,105,800	
	第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	214,250,350	
	第８９回利付国債（２０年）	120,000,000	138,199,200	
	第９０回利付国債（２０年）	90,000,000	104,193,000	
	第９１回利付国債（２０年）	10,000,000	11,644,100	
	第９２回利付国債（２０年）	215,000,000	248,692,650	
	第９３回利付国債（２０年）	90,000,000	103,926,600	
	第９４回利付国債（２０年）	90,000,000	104,576,400	
	第９５回利付国債（２０年）	185,000,000	218,714,400	
	第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	81,711,000	
	第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	153,384,400	

第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	82,051,200	
第９９回利付国債（２０年）	205,000,000	241,264,500	
第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	179,647,720	
第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	24,123,000	
第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	175,676,200	
第１０３回利付国債（２０年）	20,000,000	24,062,000	
第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	11,861,800	
第１０５回利付国債（２０年）	132,000,000	157,182,960	
第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	47,979,600	
第１０７回利付国債（２０年）	280,000,000	334,670,000	
第１０８回利付国債（２０年）	130,000,000	153,054,200	
第１０９回利付国債（２０年）	180,000,000	212,617,800	
第１１０回利付国債（２０年）	115,000,000	137,954,000	
第１１１回利付国債（２０年）	200,000,000	242,690,000	
第１１２回利付国債（２０年）	205,000,000	246,822,050	
第１１３回利付国債（２０年）	155,000,000	187,384,150	
第１１４回利付国債（２０年）	260,000,000	315,419,000	
第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	122,309,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	171,927,000	
第１１７回利付国債（２０年）	215,000,000	261,842,050	
第１１８回利付国債（２０年）	231,000,000	280,027,440	
第１１９回利付国債（２０年）	60,000,000	71,482,800	
第１２０回利付国債（２０年）	140,000,000	163,872,800	
第１２１回利付国債（２０年）	165,000,000	198,897,600	
第１２２回利付国債（２０年）	150,000,000	179,214,000	
第１２３回利付国債（２０年）	285,000,000	350,957,550	
第１２４回利付国債（２０年）	150,000,000	183,078,000	
第１２５回利付国債（２０年）	120,000,000	149,575,200	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	122,415,000	
第１２７回利付国債（２０年）	50,000,000	60,650,000	
第１２８回利付国債（２０年）	285,000,000	346,685,400	
第１２９回利付国債（２０年）	70,000,000	84,353,500	
第１３０回利付国債（２０年）	230,000,000	278,042,400	
第１３１回利付国債（２０年）	120,000,000	143,668,800	
第１３２回利付国債（２０年）	160,000,000	192,120,000	
第１３３回利付国債（２０年）	245,000,000	297,094,350	
第１３４回利付国債（２０年）	155,000,000	188,411,800	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	48,138,000	
第１３６回利付国債（２０年）	80,000,000	95,307,200	
第１３７回利付国債（２０年）	110,000,000	132,678,700	
第１３８回利付国債（２０年）	160,000,000	189,036,800	
第１３９回利付国債（２０年）	160,000,000	191,012,800	

	第１４０回利付国債（２０年）	340,000,000	411,260,600	
	第１４１回利付国債（２０年）	195,000,000	236,519,400	
	第１４２回利付国債（２０年）	170,000,000	208,377,500	
	第１４３回利付国債（２０年）	315,000,000	378,733,950	
	第１４４回利付国債（２０年）	140,000,000	166,499,200	
	第１４５回利付国債（２０年）	395,000,000	481,378,600	
	第１４６回利付国債（２０年）	320,000,000	391,020,800	
	第１４７回利付国債（２０年）	355,000,000	429,731,050	
	第１４８回利付国債（２０年）	385,000,000	461,757,450	
	第１４９回利付国債（２０年）	370,000,000	444,751,100	
	第１５０回利付国債（２０年）	440,000,000	523,305,200	
	第１５１回利付国債（２０年）	345,000,000	400,983,150	
	第１５２回利付国債（２０年）	330,000,000	383,849,400	
	第１５３回利付国債（２０年）	320,000,000	377,635,200	
	第１５４回利付国債（２０年）	348,000,000	406,022,040	
	第１５５回利付国債（２０年）	370,000,000	420,449,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	340,000,000	353,950,200	
	第１５７回利付国債（２０年）	270,000,000	272,157,300	
	第１５８回利付国債（２０年）	280,000,000	295,912,400	
	第１５９回利付国債（２０年）	300,000,000	321,975,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	210,000,000	228,916,800	
	第１６１回利付国債（２０年）	340,000,000	364,694,200	
	第１６２回利付国債（２０年）	220,000,000	236,002,800	
	第１６３回利付国債（２０年）	270,000,000	289,656,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	390,000,000	411,196,500	
	第１６５回利付国債（２０年）	280,000,000	295,162,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	370,000,000	403,248,200	
	第１６７回利付国債（２０年）	320,000,000	336,860,800	
	第１６８回利付国債（２０年）	270,000,000	278,923,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	260,000,000	263,621,800	
	第１７０回利付国債（２０年）	420,000,000	425,523,000	
	国債証券合計	61,478,000,000	67,879,350,990	
地方債証券	第１４回東京都公募公債	100,000,000	118,679,000	
	第７０５回東京都公募公債	100,000,000	102,285,000	
	第７２３回東京都公募公債	100,000,000	102,843,000	
	第７２９回東京都公募公債	100,000,000	102,936,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	102,717,000	
	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	100,471,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	100,310,000	
	平成２９年度第６回北海道公募公債	100,000,000	100,049,000	
	第２１１回神奈川県公募公債	100,000,000	102,240,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,466,000	

	第１６４回大阪府公募公債	100,000,000	100,092,000	
	第３７６回大阪府公募公債	110,000,000	113,385,800	
	第４３５回大阪府公募公債	100,000,000	101,412,000	
	第４５１回大阪府公募公債	100,000,000	99,881,000	
	平成２７年度第１３回京都府公募公債	100,000,000	100,649,000	
	平成２９年度第４回京都府公募公債	100,000,000	101,411,000	
	平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	101,299,000	
	平成３０年度第１４回静岡県公募公債	100,000,000	100,974,000	
	平成２４年度第５回愛知県公募公債	100,000,000	102,175,000	
	平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	100,401,000	
	平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	101,731,000	
	平成２９年度第３回広島県公募公債	100,000,000	101,151,000	
	平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	101,494,000	
	第８回埼玉県公募公債	100,000,000	120,353,000	
	平成２６年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	102,673,000	
	平成２７年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	103,154,000	
	平成２９年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,876,000	
	第１２０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,204,000	
	第１２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,029,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,005,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,590,000	
	第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,488,000	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,803,000	
	第２６回横浜市公募公債	100,000,000	120,664,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	100,000,000	102,652,000	
	平成２９年度第２回福岡市公募公債	100,000,000	100,057,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,770,000	
	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	121,993,200	
	平成２９年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,100,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	101,440,000	
	平成２９年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	101,799,000	
	地方債証券合計	4,130,000,000	4,251,702,000	
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	102,514,000	
	第４９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,937,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,724,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	110,088,000	
	第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	102,756,390	
	第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	117,504,360	
	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	130,531,870	

	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	102,543,000	
	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	102,846,000	
	第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	135,884,770	
	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	101,110,000	
	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	101,582,000	
	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	101,905,000	
	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	101,281,000	
	第１３回公営企業債券	100,000,000	111,496,000	
	第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	130,535,680	
	第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,451,000	
	Ｆ８２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,723,000	
	第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,886,450	
	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	115,163,950	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,882,000	
	Ｆ２２８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	112,325,000	
	第６６回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,085,000	
	第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	115,900,000	
	第１８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,897,000	
	第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	120,444,000	
	第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,267,000	
	第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,172,000	91,793,292	
	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,460,000	91,835,896	
	第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,540,000	92,798,675	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,224,000	92,608,780	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,350,000	95,585,041	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,151,000	96,958,869	
	第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,371,000	99,207,037	
	第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	74,423,000	74,433,419	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	77,542,000	77,607,135	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	81,633,000	82,002,797	
	第３２７回信金中金債	100,000,000	100,123,000	
	第３４０回信金中金債	100,000,000	100,379,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	102,879,000	
	第３６回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,076,000	
	第３９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,066,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,478,000	
	特殊債券合計	4,345,866,000	4,513,095,411	

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	100,382,000	
	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	100,124,000	
	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	99,518,000	
	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	99,958,000	
	第１２回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,020,000	
	第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,545,000	
	第１２回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,448,000	
	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	99,834,000	
	第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,011,000	
	第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,875,000	
	第２６回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,467,000	
	第１２回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,982,000	
	第１回日本生命２０１７基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,086,000	
	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	100,774,000	
	第１２４回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,793,000	
	第１４７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,962,000	
	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	99,689,000	
	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	100,279,000	
	第７５回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,158,000	
	第５８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,988,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,290,000	
	第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,724,000	
	第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,730,000	
	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,029,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,959,000	
	第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,549,000	
	第５２１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,110,000	
	第２８９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,242,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,630,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,052,000	
	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	101,277,000	
	社債券合計	3,100,000,000	3,135,485,000	
合計			79,779,633,401	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	147,089,385
コール・ローン	2,459,000,227
国債証券	168,546,910,083
派生商品評価勘定	1,480,781,846
未収入金	1,411,098,759
未収利息	1,018,571,278
前払費用	257,350,983
流動資産合計	175,320,802,561
資産合計	175,320,802,561
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	46,555,368
未払金	2,319,656,462
未払解約金	1,392,950,000
未払利息	6,669
流動負債合計	3,759,168,499
負債合計	3,759,168,499
純資産の部	
元本等	
元本	166,192,163,018
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,369,471,044
元本等合計	171,561,634,062
純資産合計	171,561,634,062
負債純資産合計	175,320,802,561

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 1月27日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	58,899,119,964円
期中追加設定元本額	142,650,536,718円
期中一部解約元本額	35,357,493,664円
期末元本額	166,192,163,018円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	13,941,105,859円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	6,734,651,724円
りそなラップ型ファンド（成長型）	150,806,800円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	741,718,436円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	146,903,643円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	31,483,818円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	9,197,191円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,581,682円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	196,585円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	9,047円
ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	1,223,740,903円
ＦＷりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	62,794,540,210円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	517,371,023円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	223,583,636円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	155,661,305円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	57,978,155円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	4,593,820,249円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	14,010,547,621円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	25,518,369,723円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	14,547,446,794円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	10,640,418,999円
りそなＦＴ　先進国債券インデックス・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	7,293,810,144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）	5,837,705円

りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	2,850,191,457円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	190,309円
２．　計算日における受益権の総数	
	166,192,163,018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	1.0323円
(10,000口当たり純資産額)	(10,323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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	1,363,451,835
合計	1,363,451,835

(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 1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	2,350,643,136	－	2,327,420,583	△23,222,553
	米ドル	1,115,358,240	－	1,106,530,350	△8,827,890
	カナダドル	53,952,716	－	53,282,525	△670,191

	メキシコペソ	30,325,251	－	29,935,776	△389,475
	ユーロ	912,273,379	－	900,842,490	△11,430,889
	英ポンド	156,853,954	－	155,838,000	△1,015,954
	オーストラリアドル	45,969,866	－	45,443,193	△526,673
	シンガポールドル	35,909,730	－	35,548,249	△361,481
	売建	170,226,286,800	－	168,768,837,769	1,457,449,031
	米ドル	81,683,765,827	－	81,560,204,652	123,561,175
	カナダドル	3,253,333,160	－	3,229,882,741	23,450,419
	メキシコペソ	1,537,492,267	－	1,537,791,550	△299,283
	ユーロ	64,144,299,173	－	63,043,491,690	1,100,807,483
	英ポンド	11,029,649,702	－	10,974,199,140	55,450,562
	スウェーデンクローナ	489,953,806	－	476,691,000	13,262,806
	ノルウェークローネ	392,899,787	－	381,511,480	11,388,307
	デンマーククローネ	812,098,755	－	798,431,200	13,667,555
	ポーランドズロチ	988,874,742	－	975,280,860	13,593,882
	オーストラリアドル	3,362,409,550	－	3,272,817,896	89,591,654
	シンガポールドル	728,823,177	－	726,651,200	2,171,977
	マレーシアリンギット	754,768,812	－	771,918,400	△17,149,588
	南アフリカランド	1,047,918,042	－	1,019,965,960	27,952,082
合計		172,576,929,936	－	171,096,258,352	1,434,226,478

（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	2,340,000.00	2,343,839.00	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,319,540.80	
		US TREASURY N/B	5,230,000.00	5,251,961.81	
		US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,154,013.06	
		US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,665,564.29	
		US TREASURY N/B	2,650,000.00	2,668,736.29	
		US TREASURY N/B	5,910,000.00	5,882,065.79	
		US TREASURY N/B	6,420,000.00	6,484,826.59	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,320,888.60	
		US TREASURY N/B	3,270,000.00	3,258,248.27	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,490,020.33	
		US TREASURY N/B	5,960,000.00	6,019,017.70	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,514,831.98	
		US TREASURY N/B	4,220,000.00	4,257,007.29	
		US TREASURY N/B	1,860,000.00	1,897,672.25	
		US TREASURY N/B	4,240,000.00	4,299,128.07	
		US TREASURY N/B	3,310,000.00	3,330,622.62	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,793,875.00	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,537,060.50	
		US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,572,172.95	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,005,156.00	
		US TREASURY N/B	3,940,000.00	4,002,485.64	
		US TREASURY N/B	6,730,000.00	6,690,171.86	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,010,077.90	
		US TREASURY N/B	7,650,000.00	7,719,775.65	

		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,528,125.00	
		US TREASURY N/B	2,010,000.00	1,997,476.69	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,998,750.00	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,039,687.40	
		US TREASURY N/B	3,660,000.00	3,636,125.82	
		US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,798,008.43	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,398,933.54	
		US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,867,231.23	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,999,882.70	
		US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,480,237.50	
		US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,428,359.11	
		US TREASURY N/B	4,230,000.00	4,249,249.45	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,245,548.89	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,200,312.32	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,143,886.64	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,765,551.37	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,160,304.61	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,350,550.60	
		US TREASURY N/B	5,510,000.00	5,551,647.33	
		US TREASURY N/B	3,260,000.00	3,294,382.56	
		US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,192,219.77	
		US TREASURY N/B	4,120,000.00	4,152,911.38	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,667,921.56	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,313,835.88	
		US TREASURY N/B	5,270,000.00	5,314,156.80	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,050,273.40	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,408,750.00	
		US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,160,129.77	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,767,348.37	
		US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,018,264.76	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,025,702.80	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,610,562.40	
		US TREASURY N/B	3,870,000.00	3,931,375.49	
		US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,919,257.74	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,711,521.41	

		US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,078,750.00	
		US TREASURY N/B	2,950,000.00	2,979,384.65	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,761,816.20	
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,364,314.00	
		US TREASURY N/B	4,210,000.00	4,227,267.31	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,101,886.64	
		US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,304,791.88	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,223,890.46	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,473,800.00	
		US TREASURY N/B	2,940,000.00	2,972,443.19	
		US TREASURY N/B	6,310,000.00	6,400,459.52	
		US TREASURY N/B	1,980,000.00	1,988,546.47	
		US TREASURY N/B	4,780,000.00	4,851,326.20	
		US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,917,900.22	
		US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,485,940.56	
		US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,379,774.20	
		US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,899,357.26	
		US TREASURY N/B	3,930,000.00	3,993,632.20	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,302,515.50	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,069,804.60	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,142,507.65	
		US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,521,366.92	
		US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,034,804.94	
		US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,307,863.75	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,531,513.65	
		US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,070,702.31	
		US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,957,788.92	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,751,590.55	
		US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,305,331.25	
		US TREASURY N/B	1,850,000.00	1,836,269.48	
		US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,702,503.12	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,237,160.81	
		US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,312,025.92	
		US TREASURY N/B	2,050,000.00	2,140,848.62	
		US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,152,238.25	

		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,149,413.80	
		US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,106,777.46	
		US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,728,251.70	
		US TREASURY N/B	2,580,000.00	2,700,685.43	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,478,372.82	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,208,609.27	
		US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,858,373.40	
		US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,556,230.28	
		US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,511,700.52	
		US TREASURY N/B	3,780,000.00	3,967,892.46	
		US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,432,810.05	
		US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,270,723.24	
		US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,487,198.07	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,572,220.95	
		US TREASURY N/B	4,340,000.00	4,521,652.43	
		US TREASURY N/B	6,310,000.00	6,444,580.31	
		US TREASURY N/B	3,880,000.00	3,963,056.05	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,527,294.75	
		US TREASURY N/B	4,480,000.00	4,602,149.88	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,527,587.75	
		US TREASURY N/B	4,110,000.00	4,268,539.96	
		US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,684,034.14	
		US TREASURY N/B	2,980,000.00	2,947,871.71	
		US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,590,727.32	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,999,843.60	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,502,903.87	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,199,874.88	
		US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,095,892.93	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,395,132.73	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,600,914.04	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,209,044.67	
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,221,320.94	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,538,560.73	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,439,167.94	
		US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,669,001.74	

		US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,713,285.40	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,863,891.25	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,313,972.54	
		US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,253,990.56	
		US TREASURY N/B	4,750,000.00	5,085,283.02	
		US TREASURY N/B	3,640,000.00	3,728,511.68	
		US TREASURY N/B	4,350,000.00	4,631,220.54	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,265,620.91	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,375,570.12	
		US TREASURY N/B	5,130,000.00	5,328,286.29	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,758,329.75	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,923,589.52	
		US TREASURY N/B	1,820,000.00	1,931,012.72	
		US TREASURY N/B	3,490,000.00	3,502,064.93	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,901,187.50	
		US TREASURY N/B	4,080,000.00	4,244,395.03	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,462,588.73	
		US TREASURY N/B	3,750,000.00	3,761,791.87	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,822,851.47	
		US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,785,554.57	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,647,226.40	
		US TREASURY N/B	4,130,000.00	4,106,286.36	
		US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,348,762.50	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,708,454.87	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,006,093.60	
		US TREASURY N/B	4,360,000.00	4,474,364.54	
		US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,554,880.70	
		US TREASURY N/B	4,730,000.00	4,936,290.43	
		US TREASURY N/B	5,920,000.00	6,235,887.05	
		US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,592,630.52	
		US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,707,509.40	
		US TREASURY N/B	5,450,000.00	5,908,885.63	
		US TREASURY N/B	5,590,000.00	6,124,434.18	
		US TREASURY N/B	220,000.00	287,937.87	
		US TREASURY N/B	6,270,000.00	6,882,916.94	

		US TREASURY N/B	6,580,000.00	7,369,085.44	
		US TREASURY N/B	530,000.00	690,397.44	
		US TREASURY N/B	5,760,000.00	6,224,849.85	
		US TREASURY N/B	6,360,000.00	6,745,326.31	
		US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,275,984.11	
		US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,730,200.79	
		US TREASURY N/B	780,000.00	1,117,578.46	
		US TREASURY N/B	950,000.00	1,301,648.39	
		US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,558,593.75	
		US TREASURY N/B	630,000.00	920,907.41	
		US TREASURY N/B	690,000.00	950,636.66	
		US TREASURY N/B	520,000.00	727,532.78	
		US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,446,669.52	
		US TREASURY N/B	840,000.00	1,150,045.26	
		US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,893,221.01	
		US TREASURY N/B	600,000.00	835,886.70	
		US TREASURY N/B	1,780,000.00	2,557,776.51	
		US TREASURY N/B	1,950,000.00	2,722,763.55	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,548,496.41	
		US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,473,883.16	
		US TREASURY N/B	1,250,000.00	1,834,155.25	
		US TREASURY N/B	2,080,000.00	2,916,468.67	
		US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,396,849.21	
		US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,231,018.67	
		US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,587,010.10	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,322,617.00	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,384,392.17	
		US TREASURY N/B	2,660,000.00	2,968,861.11	
		US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,653,656.09	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,213,013.51	
		US TREASURY N/B	3,130,000.00	4,005,910.77	
		US TREASURY N/B	2,560,000.00	3,341,199.87	
		US TREASURY N/B	4,340,000.00	5,568,168.78	
		US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,908,216.26	
		US TREASURY N/B	3,650,000.00	4,342,359.37	

		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,449,206.90	
		US TREASURY N/B	3,760,000.00	4,020,482.64	
		US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,614,942.21	
		US TREASURY N/B	3,090,000.00	3,538,532.65	
		US TREASURY N/B	3,320,000.00	3,889,781.72	
		US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,486,885.72	
		US TREASURY N/B	3,390,000.00	3,635,443.79	
		US TREASURY N/B	2,850,000.00	2,911,953.87	
		US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,170,989.34	
		US TREASURY N/B	2,740,000.00	3,234,484.23	
		US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,258,039.79	
		US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,251,081.08	
		US TREASURY N/B	4,090,000.00	4,620,261.95	
		US TREASURY N/B	3,670,000.00	4,342,928.61	
		US TREASURY N/B	3,740,000.00	4,531,535.84	
		US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,981,265.52	
		US TREASURY N/B	4,350,000.00	5,526,029.02	
		US TREASURY N/B	3,580,000.00	4,257,542.92	
		US TREASURY N/B	4,450,000.00	5,175,297.49	
		US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,116,750.21	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,268,865.06	
		米ドル 小計	708,800,000.00	747,001,012.27 (81,467,930,398)	
カナダドル		GOV OF CANADA	1,070,000.00	1,076,901.50	
		GOV OF CANADA	1,860,000.00	1,843,167.00	
		GOV OF CANADA	1,190,000.00	1,192,772.70	
		GOV OF CANADA	870,000.00	889,505.40	
		GOV OF CANADA	990,000.00	989,465.40	
		GOV OF CANADA	1,260,000.00	1,244,842.20	
		GOV OF CANADA	1,090,000.00	1,085,062.30	
		GOV OF CANADA	770,000.00	770,231.00	
		GOV OF CANADA	1,260,000.00	1,234,611.00	
		GOV OF CANADA	1,060,000.00	1,090,909.60	
		GOV OF CANADA	2,080,000.00	2,055,684.80	
		GOV OF CANADA	1,570,000.00	1,584,820.80	

		GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,112,208.90	
		GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,193,657.40	
		GOV OF CANADA	1,290,000.00	1,334,543.70	
		GOV OF CANADA	900,000.00	942,147.00	
		GOV OF CANADA	1,230,000.00	1,236,211.50	
		GOV OF CANADA	810,000.00	805,067.10	
		GOV OF CANADA	840,000.00	877,606.80	
		GOV OF CANADA	1,190,000.00	1,199,127.30	
		GOV OF CANADA	1,710,000.00	1,664,753.40	
		GOV OF CANADA	1,140,000.00	1,196,167.80	
		GOV OF CANADA	850,000.00	1,172,464.50	
		GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,195,858.50	
		GOV OF CANADA	550,000.00	543,482.50	
		GOV OF CANADA	1,010,000.00	1,539,371.30	
		GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,537,810.00	
		GOV OF CANADA	1,120,000.00	1,628,592.00	
		GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,895,675.60	
		GOV OF CANADA	1,210,000.00	1,563,441.00	
		GOV OF CANADA	820,000.00	927,092.00	
		GOV OF CANADA	360,000.00	510,127.20	
	カナダドル 小計		35,820,000.00	39,133,379.20 (3,245,722,470)	
	メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	20,490,000.00	20,429,964.30	
		UNITED MEXICAN STATE	18,900,000.00	19,094,859.00	
		UNITED MEXICAN STATE	22,070,000.00	21,975,540.40	
		UNITED MEXICAN STATE	3,300,000.00	3,304,455.00	
		UNITED MEXICAN STATE	25,340,000.00	26,431,140.40	
		UNITED MEXICAN STATE	10,500,000.00	11,035,383.45	
		UNITED MEXICAN STATE	22,570,000.00	25,643,356.90	
		UNITED MEXICAN STATE	14,260,000.00	13,562,400.80	
		UNITED MEXICAN STATE	22,480,000.00	23,431,128.80	
		UNITED MEXICAN STATE	20,210,000.00	22,573,761.60	
		UNITED MEXICAN STATE	12,380,000.00	13,249,818.80	
		UNITED MEXICAN STATE	7,360,000.00	7,930,915.20	
		UNITED MEXICAN STATE	6,750,000.00	8,762,175.00	
		UNITED MEXICAN STATE	14,170,000.00	16,311,087.00	

	UNITED MEXICAN STATE	16,910,000.00	18,171,486.00	
	UNITED MEXICAN STATE	10,910,000.00	12,121,986.44	
	メキシコペソ 小計	248,600,000.00	264,029,459.09 (1,528,730,568)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	1,310,000.00	1,398,295.31	
	GOV OF AUSTRIA	430,000.00	471,099.40	
	GOV OF AUSTRIA	710,000.00	721,093.75	
	GOV OF AUSTRIA	930,000.00	1,035,489.90	
	GOV OF AUSTRIA	680,000.00	692,957.40	
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,021,129.52	
	GOV OF AUSTRIA	400,000.00	408,590.80	
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	771,111.60	
	GOV OF AUSTRIA	1,020,000.00	1,114,413.24	
	GOV OF AUSTRIA	620,000.00	820,986.02	
	GOV OF AUSTRIA	990,000.00	1,062,364.05	
	GOV OF AUSTRIA	850,000.00	899,463.20	
	GOV OF AUSTRIA	620,000.00	926,782.20	
	GOV OF AUSTRIA	820,000.00	885,550.95	
	GOV OF AUSTRIA	790,000.00	837,553.63	
	GOV OF AUSTRIA	660,000.00	873,868.38	
	GOV OF AUSTRIA	1,150,000.00	1,917,501.95	
	GOV OF AUSTRIA	540,000.00	891,664.20	
	GOV OF AUSTRIA	540,000.00	684,228.60	
	GOV OF AUSTRIA	300,000.00	655,665.00	
	GOV OF AUSTRIA	470,000.00	826,103.02	
	GOV OF AUSTRIA	200,000.00	269,660.40	
	GOV OF BELGIUM	1,300,000.00	1,405,655.93	
	GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,287,458.64	
	GOV OF BELGIUM	1,300,000.00	1,468,786.52	
	GOV OF BELGIUM	1,090,000.00	1,194,768.62	
	GOV OF BELGIUM	700,000.00	718,784.50	
	GOV OF BELGIUM	1,210,000.00	1,375,033.11	
	GOV OF BELGIUM	930,000.00	971,158.08	
	GOV OF BELGIUM	1,360,000.00	1,447,480.64	
	GOV OF BELGIUM	790,000.00	1,028,596.59	

		GOV OF BELGIUM	1,290,000.00	1,399,204.95	
		GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,227,939.60	
		GOV OF BELGIUM	1,400,000.00	2,059,103.20	
		GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,536,478.34	
		GOV OF BELGIUM	1,120,000.00	1,225,116.48	
		GOV OF BELGIUM	990,000.00	1,097,301.15	
		GOV OF BELGIUM	620,000.00	916,533.60	
		GOV OF BELGIUM	660,000.00	756,082.14	
		GOV OF BELGIUM	640,000.00	895,532.16	
		GOV OF BELGIUM	1,560,000.00	2,662,888.80	
		GOV OF BELGIUM	370,000.00	435,909.95	
		GOV OF BELGIUM	720,000.00	907,441.92	
		GOV OF BELGIUM	1,440,000.00	2,520,931.68	
		GOV OF BELGIUM	810,000.00	1,410,129.00	
		GOV OF BELGIUM	910,000.00	1,123,094.70	
		GOV OF BELGIUM	510,000.00	641,656.50	
		GOV OF BELGIUM	390,000.00	565,911.84	
		GOV OF BELGIUM	410,000.00	603,077.20	
		GOV OF FINLAND	510,000.00	535,572.93	
		GOV OF FINLAND	430,000.00	435,660.52	
		GOV OF FINLAND	380,000.00	402,286.62	
		GOV OF FINLAND	450,000.00	480,116.25	
		GOV OF FINLAND	400,000.00	407,895.20	
		GOV OF FINLAND	360,000.00	398,466.36	
		GOV OF FINLAND	300,000.00	306,504.90	
		GOV OF FINLAND	500,000.00	622,237.00	
		GOV OF FINLAND	330,000.00	353,747.46	
		GOV OF FINLAND	480,000.00	505,506.24	
		GOV OF FINLAND	390,000.00	412,661.73	
		GOV OF FINLAND	390,000.00	488,750.92	
		GOV OF FINLAND	310,000.00	328,887.58	
		GOV OF FINLAND	360,000.00	382,125.96	
		GOV OF FINLAND	360,000.00	391,698.00	
		GOV OF FINLAND	360,000.00	412,057.80	
		GOV OF FINLAND	370,000.00	558,933.84	

		GOV OF FINLAND	300,000.00	377,022.30	
		GOV OF FRANCE	1,470,000.00	1,479,190.44	
		GOV OF FRANCE	2,900,000.00	3,056,936.40	
		GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,093,746.45	
		GOV OF FRANCE	3,050,000.00	3,255,289.40	
		GOV OF FRANCE	2,240,000.00	2,266,688.25	
		GOV OF FRANCE	3,580,000.00	3,870,094.56	
		GOV OF FRANCE	2,780,000.00	2,817,785.76	
		GOV OF FRANCE	3,300,000.00	3,557,664.00	
		GOV OF FRANCE	3,400,000.00	3,460,585.26	
		GOV OF FRANCE	4,160,000.00	4,481,736.88	
		GOV OF FRANCE	3,570,000.00	4,217,262.42	
		GOV OF FRANCE	2,800,000.00	2,858,981.71	
		GOV OF FRANCE	2,920,000.00	3,271,552.80	
		GOV OF FRANCE	3,080,000.00	3,412,384.36	
		GOV OF FRANCE	2,370,000.00	2,421,109.05	
		GOV OF FRANCE	3,080,000.00	3,233,747.44	
		GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,111,727.35	
		GOV OF FRANCE	2,700,000.00	2,918,613.60	
		GOV OF FRANCE	3,180,000.00	3,954,466.74	
		GOV OF FRANCE	2,430,000.00	2,559,555.45	
		GOV OF FRANCE	3,060,000.00	3,175,998.48	
		GOV OF FRANCE	2,720,000.00	2,974,711.68	
		GOV OF FRANCE	3,060,000.00	3,780,997.20	
		GOV OF FRANCE	2,940,000.00	3,174,612.00	
		GOV OF FRANCE	2,750,000.00	2,973,162.50	
		GOV OF FRANCE	2,940,000.00	4,493,172.60	
		GOV OF FRANCE	2,670,000.00	2,824,902.72	
		GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,148,499.38	
		GOV OF FRANCE	3,380,000.00	4,275,821.68	
		GOV OF FRANCE	3,520,000.00	4,111,286.08	
		GOV OF FRANCE	2,850,000.00	4,909,438.50	
		GOV OF FRANCE	2,070,000.00	2,377,978.74	
		GOV OF FRANCE	2,360,000.00	3,964,941.60	
		GOV OF FRANCE	2,700,000.00	3,101,614.20	

		GOV OF FRANCE	2,240,000.00	3,713,418.24	
		GOV OF FRANCE	1,490,000.00	1,859,430.60	
		GOV OF FRANCE	2,960,000.00	5,376,751.20	
		GOV OF FRANCE	1,950,000.00	3,161,655.90	
		GOV OF FRANCE	2,260,000.00	3,026,140.00	
		GOV OF FRANCE	2,020,000.00	2,433,502.08	
		GOV OF FRANCE	1,400,000.00	2,779,117.30	
		GOV OF FRANCE	1,100,000.00	2,289,023.00	
		GOV OF FRANCE	1,000,000.00	1,326,530.00	
		GOV OF GERMANY	860,000.00	885,594.46	
		GOV OF GERMANY	1,120,000.00	1,127,743.68	
		GOV OF GERMANY	1,390,000.00	1,400,110.01	
		GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,411,725.00	
		GOV OF GERMANY	1,950,000.00	2,058,511.65	
		GOV OF GERMANY	1,200,000.00	1,255,345.20	
		GOV OF GERMANY	1,060,000.00	1,070,523.14	
		GOV OF GERMANY	1,480,000.00	1,495,520.76	
		GOV OF GERMANY	1,000,000.00	1,011,594.00	
		GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,472,430.40	
		GOV OF GERMANY	1,370,000.00	1,389,127.38	
		GOV OF GERMANY	2,160,000.00	2,286,275.96	
		GOV OF GERMANY	1,510,000.00	1,594,665.70	
		GOV OF GERMANY	1,210,000.00	1,230,666.18	
		GOV OF GERMANY	1,280,000.00	1,364,582.40	
		GOV OF GERMANY	1,370,000.00	1,398,141.17	
		GOV OF GERMANY	1,940,000.00	2,078,244.40	
		GOV OF GERMANY	1,480,000.00	1,619,904.40	
		GOV OF GERMANY	1,730,000.00	1,770,574.36	
		GOV OF GERMANY	1,770,000.00	1,942,178.52	
		GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,641,304.00	
		GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,419,720.90	
		GOV OF GERMANY	1,560,000.00	1,675,415.04	
		GOV OF GERMANY	1,670,000.00	1,716,938.69	
		GOV OF GERMANY	2,000,000.00	2,110,992.00	
		GOV OF GERMANY	1,790,000.00	1,947,878.00	

		GOV OF GERMANY	2,190,000.00	2,330,622.09	
		GOV OF GERMANY	2,110,000.00	2,183,122.05	
		GOV OF GERMANY	1,890,000.00	1,991,787.84	
		GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,543,868.83	
		GOV OF GERMANY	2,100,000.00	2,258,308.50	
		GOV OF GERMANY	1,170,000.00	1,746,377.10	
		GOV OF GERMANY	1,890,000.00	2,038,242.15	
		GOV OF GERMANY	810,000.00	1,171,392.84	
		GOV OF GERMANY	1,700,000.00	1,800,881.40	
		GOV OF GERMANY	1,890,000.00	2,003,649.48	
		GOV OF GERMANY	1,700,000.00	1,760,540.40	
		GOV OF GERMANY	740,000.00	1,237,257.06	
		GOV OF GERMANY	1,550,000.00	2,557,546.50	
		GOV OF GERMANY	1,640,000.00	2,830,028.28	
		GOV OF GERMANY	1,790,000.00	3,044,210.04	
		GOV OF GERMANY	1,220,000.00	2,242,222.14	
		GOV OF GERMANY	1,340,000.00	2,650,793.36	
		GOV OF GERMANY	1,160,000.00	1,993,651.40	
		GOV OF GERMANY	2,170,000.00	3,439,356.69	
		GOV OF GERMANY	2,270,000.00	3,678,979.92	
		GOV OF GERMANY	1,490,000.00	1,944,926.80	
		GOV OF GERMANY	380,000.00	358,920.26	
		GOV OF IRELAND	590,000.00	606,399.86	
		GOV OF IRELAND	350,000.00	354,775.75	
		GOV OF IRELAND	560,000.00	637,787.68	
		GOV OF IRELAND	670,000.00	777,102.18	
		GOV OF IRELAND	890,000.00	1,154,399.42	
		GOV OF IRELAND	950,000.00	1,026,756.20	
		GOV OF IRELAND	690,000.00	750,453.66	
		GOV OF IRELAND	650,000.00	721,288.75	
		GOV OF IRELAND	620,000.00	773,683.74	
		GOV OF IRELAND	510,000.00	582,593.40	
		GOV OF IRELAND	400,000.00	457,596.00	
		GOV OF IRELAND	490,000.00	596,052.66	
		GOV OF IRELAND	650,000.00	862,254.25	

		GOV OF IRELAND	340,000.00	409,057.40	
		GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,806,128.65	
		GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,353,989.25	
		GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,165,003.83	
		GOV OF ITALY	1,820,000.00	1,835,038.66	
		GOV OF ITALY	2,240,000.00	2,370,997.66	
		GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,798,965.58	
		GOV OF ITALY	1,270,000.00	1,321,615.34	
		GOV OF ITALY	2,130,000.00	2,145,448.89	
		GOV OF ITALY	1,090,000.00	1,135,202.30	
		GOV OF ITALY	1,190,000.00	1,315,159.44	
		GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,323,377.97	
		GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,389,145.95	
		GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,769,700.04	
		GOV OF ITALY	1,580,000.00	1,612,712.32	
		GOV OF ITALY	1,510,000.00	1,722,186.71	
		GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,739,769.36	
		GOV OF ITALY	1,360,000.00	1,560,631.28	
		GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,494,187.50	
		GOV OF ITALY	1,850,000.00	1,892,270.65	
		GOV OF ITALY	1,480,000.00	1,514,341.92	
		GOV OF ITALY	1,900,000.00	2,162,359.60	
		GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,734,579.00	
		GOV OF ITALY	1,860,000.00	2,004,429.00	
		GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,572,033.25	
		GOV OF ITALY	1,760,000.00	2,051,299.36	
		GOV OF ITALY	1,420,000.00	1,505,026.76	
		GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,636,584.70	
		GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,961,339.73	
		GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,764,773.03	
		GOV OF ITALY	1,150,000.00	1,257,390.45	
		GOV OF ITALY	970,000.00	958,602.50	
		GOV OF ITALY	1,680,000.00	2,051,452.70	
		GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,282,058.52	
		GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,609,731.20	

		GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,420,302.38	
		GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,750,670.53	
		GOV OF ITALY	1,720,000.00	2,105,163.04	
		GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,630,821.65	
		GOV OF ITALY	2,640,000.00	2,854,634.64	
		GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,532,900.08	
		GOV OF ITALY	400,000.00	399,491.20	
		GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,789,533.56	
		GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,042,475.75	
		GOV OF ITALY	1,850,000.00	2,615,835.25	
		GOV OF ITALY	1,950,000.00	2,105,900.55	
		GOV OF ITALY	1,970,000.00	2,569,774.38	
		GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,615,858.59	
		GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,798,327.30	
		GOV OF ITALY	2,390,000.00	3,283,759.62	
		GOV OF ITALY	1,720,000.00	2,091,451.20	
		GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,235,149.96	
		GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,702,779.40	
		GOV OF ITALY	1,750,000.00	1,801,787.75	
		GOV OF ITALY	1,360,000.00	2,036,646.24	
		GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,532,701.14	
		GOV OF ITALY	2,360,000.00	3,379,550.68	
		GOV OF ITALY	970,000.00	1,182,719.06	
		GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,245,130.08	
		GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,937,902.35	
		GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,734,433.01	
		GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,714,302.50	
		GOV OF ITALY	590,000.00	695,382.85	
		GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,687,671.80	
		GOV OF ITALY	1,450,000.00	2,159,415.40	
		GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,482,393.94	
		GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,804,396.96	
		GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,545,017.76	
		GOV OF ITALY	1,120,000.00	1,496,925.92	
		GOV OF ITALY	740,000.00	804,872.84	

		GOV OF NETHERLANDS	1,340,000.00	1,416,330.42	
		GOV OF NETHERLANDS	1,340,000.00	1,355,858.90	
		GOV OF NETHERLANDS	1,160,000.00	1,242,979.44	
		GOV OF NETHERLANDS	1,140,000.00	1,289,031.06	
		GOV OF NETHERLANDS	1,300,000.00	1,406,654.60	
		GOV OF NETHERLANDS	1,390,000.00	1,420,624.48	
		GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,515,476.56	
		GOV OF NETHERLANDS	1,170,000.00	1,216,715.76	
		GOV OF NETHERLANDS	1,220,000.00	1,293,515.98	
		GOV OF NETHERLANDS	1,350,000.00	1,462,704.75	
		GOV OF NETHERLANDS	990,000.00	1,457,420.58	
		GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,309,240.80	
		GOV OF NETHERLANDS	960,000.00	1,004,968.32	
		GOV OF NETHERLANDS	1,080,000.00	1,445,283.00	
		GOV OF NETHERLANDS	1,260,000.00	2,105,712.00	
		GOV OF NETHERLANDS	550,000.00	589,345.46	
		GOV OF NETHERLANDS	1,370,000.00	2,451,546.50	
		GOV OF NETHERLANDS	1,210,000.00	2,028,134.24	
		GOV OF SPAIN	1,500,000.00	1,507,726.50	
		GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,224,113.57	
		GOV OF SPAIN	1,690,000.00	1,720,276.35	
		GOV OF SPAIN	1,530,000.00	1,541,585.16	
		GOV OF SPAIN	1,750,000.00	1,969,777.25	
		GOV OF SPAIN	2,060,000.00	2,095,798.68	
		GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,317,945.27	
		GOV OF SPAIN	1,720,000.00	2,015,349.80	
		GOV OF SPAIN	1,760,000.00	1,796,758.29	
		GOV OF SPAIN	1,600,000.00	1,879,040.00	
		GOV OF SPAIN	1,380,000.00	1,657,235.10	
		GOV OF SPAIN	1,720,000.00	2,011,450.56	
		GOV OF SPAIN	1,270,000.00	1,292,951.94	
		GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,264,439.90	
		GOV OF SPAIN	1,750,000.00	1,904,999.25	
		GOV OF SPAIN	1,740,000.00	2,190,059.70	
		GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,239,593.76	

		GOV OF SPAIN	1,450,000.00	1,624,384.25	
		GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,455,205.79	
		GOV OF SPAIN	2,040,000.00	2,209,132.32	
		GOV OF SPAIN	1,490,000.00	1,638,271.39	
		GOV OF SPAIN	1,820,000.00	1,999,539.36	
		GOV OF SPAIN	1,570,000.00	1,721,505.00	
		GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,106,700.80	
		GOV OF SPAIN	1,430,000.00	2,034,891.28	
		GOV OF SPAIN	2,030,000.00	3,063,518.86	
		GOV OF SPAIN	1,720,000.00	1,897,997.64	
		GOV OF SPAIN	1,840,000.00	1,884,373.44	
		GOV OF SPAIN	1,750,000.00	2,026,553.90	
		GOV OF SPAIN	1,900,000.00	3,106,199.80	
		GOV OF SPAIN	1,590,000.00	1,942,926.41	
		GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,215,254.77	
		GOV OF SPAIN	1,640,000.00	2,528,851.94	
		GOV OF SPAIN	1,640,000.00	2,844,750.38	
		GOV OF SPAIN	1,570,000.00	2,691,027.10	
		GOV OF SPAIN	1,150,000.00	2,152,956.40	
		GOV OF SPAIN	1,400,000.00	1,941,291.80	
		GOV OF SPAIN	1,030,000.00	1,388,921.52	
		GOV OF SPAIN	1,010,000.00	1,638,877.51	
	ユーロ 小計		435,550,000.00	520,669,565.50 (62,636,548,729)	
	英ポンド	UK TREASURY	2,160,000.00	2,181,686.18	
		UK TREASURY	2,250,000.00	2,370,273.29	
		UK TREASURY	800,000.00	860,850.88	
		UK TREASURY	1,810,000.00	1,816,020.42	
		UK TREASURY	2,390,000.00	2,476,112.17	
		UK TREASURY	2,150,000.00	2,177,369.50	
		UK TREASURY	1,430,000.00	1,525,952.14	
		UK TREASURY	2,320,000.00	2,379,815.15	
		UK TREASURY	970,000.00	1,074,680.84	
		UK TREASURY	1,330,000.00	1,640,018.47	
		UK TREASURY	1,010,000.00	1,021,123.32	

		UK TREASURY	1,250,000.00	1,364,125.00	
		UK TREASURY	1,150,000.00	1,231,446.68	
		UK TREASURY	1,190,000.00	1,261,302.42	
		UK TREASURY	1,150,000.00	1,489,116.13	
		UK TREASURY	1,970,000.00	2,161,799.20	
		UK TREASURY	950,000.00	1,404,723.01	
		UK TREASURY	1,560,000.00	1,606,022.47	
		UK TREASURY	1,060,000.00	1,524,249.47	
		UK TREASURY	1,340,000.00	1,903,411.04	
		UK TREASURY	1,220,000.00	1,840,791.13	
		UK TREASURY	1,700,000.00	2,560,455.00	
		UK TREASURY	1,940,000.00	2,187,908.72	
		UK TREASURY	1,190,000.00	1,972,792.47	
		UK TREASURY	1,210,000.00	1,916,571.75	
		UK TREASURY	1,430,000.00	2,300,729.00	
		UK TREASURY	1,440,000.00	2,455,704.00	
		UK TREASURY	1,880,000.00	2,750,264.78	
		UK TREASURY	1,900,000.00	2,915,514.28	
		UK TREASURY	1,520,000.00	2,651,565.21	
		UK TREASURY	1,880,000.00	2,075,562.86	
		UK TREASURY	860,000.00	1,006,959.38	
		UK TREASURY	1,190,000.00	2,163,828.40	
		UK TREASURY	1,380,000.00	2,424,412.15	
		UK TREASURY	800,000.00	945,680.00	
		UK TREASURY	1,470,000.00	2,917,289.07	
		UK TREASURY	1,300,000.00	1,620,446.36	
		UK TREASURY	1,280,000.00	2,573,521.40	
		UK TREASURY	1,380,000.00	2,168,634.12	
		UK TREASURY	1,470,000.00	2,918,185.20	
		UK TREASURY	740,000.00	951,073.44	
		英ポンド 小計	59,420,000.00	78,787,986.50 (11,228,075,956)	
	スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	7,710,000.00	8,403,491.37	
		GOV OF SWEDEN	7,950,000.00	8,486,971.62	
		GOV OF SWEDEN	5,170,000.00	5,916,717.57	
		GOV OF SWEDEN	4,240,000.00	4,566,556.32	

	GOV OF SWEDEN	3,580,000.00	3,820,006.78	
	GOV OF SWEDEN	4,120,000.00	4,396,802.20	
	GOV OF SWEDEN	3,760,000.00	5,857,824.32	
スウェーデンクローナ 小計		36,530,000.00	41,448,370.18 (472,511,420)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	6,760,000.00	6,974,697.60	
	GOV OF NORWAY	5,700,000.00	5,831,994.90	
	GOV OF NORWAY	4,150,000.00	4,435,727.50	
	GOV OF NORWAY	2,540,000.00	2,601,429.90	
	GOV OF NORWAY	2,890,000.00	2,928,379.20	
	GOV OF NORWAY	2,850,000.00	2,937,723.00	
	GOV OF NORWAY	2,980,000.00	3,138,714.80	
	GOV OF NORWAY	2,410,000.00	2,498,459.05	
ノルウェークローネ 小計		30,280,000.00	31,347,125.95 (377,732,867)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,350,000.00	5,705,427.25	
	GOV OF DENMARK	1,430,000.00	1,465,617.15	
	GOV OF DENMARK	5,280,000.00	5,708,482.56	
	GOV OF DENMARK	5,250,000.00	5,956,870.50	
	GOV OF DENMARK	7,110,000.00	7,646,975.64	
	GOV OF DENMARK	3,300,000.00	3,569,775.00	
	GOV OF DENMARK	10,490,000.00	20,001,564.12	
デンマーククローネ 小計		38,210,000.00	50,054,712.22 (805,880,866)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,700,000.00	1,712,682.00	
	GOV OF POLAND	1,250,000.00	1,226,910.87	
	GOV OF POLAND	2,580,000.00	2,589,430.41	
	GOV OF POLAND	1,710,000.00	1,833,496.20	
	GOV OF POLAND	2,230,000.00	2,262,172.21	
	GOV OF POLAND	1,940,000.00	2,144,320.80	
	GOV OF POLAND	2,340,000.00	2,392,492.75	
	GOV OF POLAND	2,240,000.00	2,417,764.16	
	GOV OF POLAND	2,500,000.00	2,566,462.99	
	GOV OF POLAND	1,630,000.00	1,654,731.82	
	GOV OF POLAND	2,210,000.00	2,349,816.31	

	GOV OF POLAND	3,140,000.00	3,209,786.80	
	GOV OF POLAND	2,510,000.00	2,559,744.42	
	GOV OF POLAND	2,410,000.00	2,500,013.50	
	GOV OF POLAND	640,000.00	836,032.00	
	GOV OF POLAND	1,620,000.00	1,691,037.00	
ポーランドズロチ 小計		32,650,000.00	33,946,894.24 (959,678,700)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,920,000.00	2,042,254.27	
	GOV OF AUSTRALIA	1,660,000.00	1,698,762.82	
	GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	1,964,305.35	
	GOV OF AUSTRALIA	1,530,000.00	1,594,762.90	
	GOV OF AUSTRALIA	2,050,000.00	2,360,524.77	
	GOV OF AUSTRALIA	2,350,000.00	2,541,696.05	
	GOV OF AUSTRALIA	2,270,000.00	2,549,076.07	
	GOV OF AUSTRALIA	2,610,000.00	3,138,085.20	
	GOV OF AUSTRALIA	2,310,000.00	2,919,508.97	
	GOV OF AUSTRALIA	2,480,000.00	2,804,614.88	
	GOV OF AUSTRALIA	2,370,000.00	2,599,107.66	
	GOV OF AUSTRALIA	2,100,000.00	2,397,850.56	
	GOV OF AUSTRALIA	2,490,000.00	2,964,501.61	
	GOV OF AUSTRALIA	2,120,000.00	2,447,445.23	
	GOV OF AUSTRALIA	2,080,000.00	2,362,610.84	
	GOV OF AUSTRALIA	1,260,000.00	1,308,811.51	
	GOV OF AUSTRALIA	1,210,000.00	1,700,474.22	
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	708,742.33	
	GOV OF AUSTRALIA	990,000.00	1,346,595.03	
	GOV OF AUSTRALIA	800,000.00	1,036,567.20	
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	435,670.63	
	GOV OF AUSTRALIA	1,060,000.00	1,361,570.42	
オーストラリアドル 小計		38,360,000.00	44,283,538.52 (3,290,266,912)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	640,000.00	647,226.04	
	GOV OF SINGAPORE	690,000.00	688,344.00	
	GOV OF SINGAPORE	220,000.00	221,656.40	
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	521,925.89	
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	505,238.70	

	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	595,428.15	
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	296,624.63	
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	577,162.80	
	GOV OF SINGAPORE	240,000.00	251,213.23	
	GOV OF SINGAPORE	430,000.00	446,123.28	
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	712,639.11	
	GOV OF SINGAPORE	440,000.00	475,242.49	
	GOV OF SINGAPORE	370,000.00	409,584.45	
	GOV OF SINGAPORE	360,000.00	400,911.71	
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	584,298.05	
	GOV OF SINGAPORE	270,000.00	285,754.05	
	GOV OF SINGAPORE	220,000.00	238,025.96	
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	479,875.10	
	GOV OF SINGAPORE	550,000.00	629,598.75	
シンガポールドル 小計		8,370,000.00	8,966,872.79 (722,729,946)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	1,080,000.00	1,100,303.78	
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	877,820.83	
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,197,751.92	
	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	694,433.95	
	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	567,727.94	
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	971,564.90	
	GOV OF MALAYSIA	940,000.00	957,108.00	
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	627,011.98	
	GOV OF MALAYSIA	900,000.00	927,689.30	
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	776,661.48	
	GOV OF MALAYSIA	1,500,000.00	1,576,293.15	
	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	701,618.17	
	GOV OF MALAYSIA	800,000.00	833,392.00	
	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	711,960.00	
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	332,930.60	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,246,363.75	
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,058,118.31	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,219,179.03	
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,420,520.49	

		GOV OF MALAYSIA	1,380,000.00	1,435,882.82	
		GOV OF MALAYSIA	1,300,000.00	1,377,149.92	
		GOV OF MALAYSIA	460,000.00	509,680.00	
		GOV OF MALAYSIA	810,000.00	881,280.00	
		GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,595,315.00	
		GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,259,500.00	
		GOV OF MALAYSIA	800,000.00	854,841.84	
		GOV OF MALAYSIA	270,000.00	299,676.64	
		GOV OF MALAYSIA	650,000.00	764,975.90	
		GOV OF MALAYSIA	1,340,000.00	1,604,681.75	
		GOV OF MALAYSIA	290,000.00	345,680.00	
		GOV OF MALAYSIA	490,000.00	564,970.00	
		GOV OF MALAYSIA	1,140,000.00	1,363,222.60	
	マレーシアリンギット 小計		28,760,000.00	30,655,306.05 (823,708,073)	
	南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	3,660,000.00	3,668,418.00	
		GOV OF SOUTH AFRICA	10,130,000.00	10,382,237.00	
		GOV OF SOUTH AFRICA	19,940,000.00	22,424,230.88	
		GOV OF SOUTH AFRICA	12,530,000.00	11,700,508.98	
		GOV OF SOUTH AFRICA	8,420,000.00	7,145,570.69	
		GOV OF SOUTH AFRICA	10,300,000.00	9,442,029.57	
		GOV OF SOUTH AFRICA	9,610,000.00	8,933,917.28	
		GOV OF SOUTH AFRICA	9,140,000.00	6,529,982.51	
		GOV OF SOUTH AFRICA	11,270,000.00	9,933,300.23	
		GOV OF SOUTH AFRICA	8,050,000.00	7,320,556.49	
		GOV OF SOUTH AFRICA	8,010,000.00	5,567,836.70	
		GOV OF SOUTH AFRICA	12,670,000.00	11,088,784.00	
		GOV OF SOUTH AFRICA	18,890,000.00	16,470,191.00	
	南アフリカランド 小計		142,620,000.00	130,607,563.33 (987,393,178)	
合計				168,546,910,083 (168,546,910,083)	

(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		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	221銘柄	100.0%	48.2%
カナダドル	国債証券	32銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	298銘柄	100.0%	37.2%
英ポンド	国債証券	41銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	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	16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.0%
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	32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%

（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先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 1月27日現在
資産の部	
流動資産	

	2020年 1月27日現在
預金	96,492,491
コール・ローン	45,091,408
国債証券	29,807,773,813
派生商品評価勘定	2,282,068
未収入金	392,965,055
未収利息	216,261,916
前払費用	19,842,250
流動資産合計	30,580,709,001
資産合計	30,580,709,001
負債の部	
流動負債	
未払金	64,368,025
未払解約金	430,080,000
未払利息	122
流動負債合計	494,448,147
負債合計	494,448,147
純資産の部	
元本等	
元本	29,562,938,389
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	523,322,465
元本等合計	30,086,260,854
純資産合計	30,086,260,854
負債純資産合計	30,580,709,001

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 1月27日現在
1． 投資信託財産に係る元本の状況

期首	2019年 1月26日
期首元本額	32,538,384,108円
期中追加設定元本額	12,342,361,668円
期中一部解約元本額	15,317,807,387円
期末元本額	29,562,938,389円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	3,285,160,939円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	422,099,426円
りそなラップ型ファンド（成長型）	217,977,583円
ＤＣりそな　グローバルバランス	78,261,686円
つみたてバランスファンド	273,889,167円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	404,383,354円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	80,860,733円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	16,533,679円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	5,057,271円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,354,516円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	108,087円
ＦＷりそな先進国債券アクティブファンド	161,067,295円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	97,683,258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）	23,995,654,885円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	190,026,975円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	125,607,605円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	80,653,433円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	33,067,898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）	548,318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）	92,942,281円
２．　計算日における受益権の総数	
	29,562,938,389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	1.0177円
(10,000口当たり純資産額)	(10,177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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

国債証券	1,164,114,604
合計	1,164,114,604

(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 1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				
	売建	398,002,085	－	395,720,017	2,282,068
	米ドル	207,408,036	－	206,442,555	965,481
	カナダドル	7,293,617	－	7,248,082	45,535
	ユーロ	159,207,262	－	158,146,380	1,060,882
	英ポンド	24,093,170	－	23,883,000	210,170
合計		398,002,085	－	395,720,017	2,282,068

（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	800,000.00	801,312.48	
		US TREASURY N/B	260,000.00	262,208.96	
		US TREASURY N/B	440,000.00	441,847.64	
		US TREASURY N/B	400,000.00	399,242.15	
		US TREASURY N/B	630,000.00	643,412.07	
		US TREASURY N/B	460,000.00	463,252.33	
		US TREASURY N/B	650,000.00	646,927.71	
		US TREASURY N/B	850,000.00	858,582.96	
		US TREASURY N/B	480,000.00	484,359.36	
		US TREASURY N/B	480,000.00	478,274.97	
		US TREASURY N/B	600,000.00	604,863.24	
		US TREASURY N/B	800,000.00	807,921.84	
		US TREASURY N/B	600,000.00	598,769.52	
		US TREASURY N/B	800,000.00	807,015.60	
		US TREASURY N/B	580,000.00	591,747.26	
		US TREASURY N/B	620,000.00	628,646.08	
		US TREASURY N/B	480,000.00	482,990.59	
		US TREASURY N/B	550,000.00	548,796.87	
		US TREASURY N/B	590,000.00	598,746.27	
		US TREASURY N/B	820,000.00	815,307.38	
		US TREASURY N/B	700,000.00	700,902.30	
		US TREASURY N/B	540,000.00	548,564.02	
		US TREASURY N/B	970,000.00	964,259.54	
		US TREASURY N/B	950,000.00	953,191.33	
		US TREASURY N/B	550,000.00	555,016.55	
		US TREASURY N/B	890,000.00	906,687.50	
		US TREASURY N/B	520,000.00	516,760.14	
		US TREASURY N/B	620,000.00	619,806.25	
		US TREASURY N/B	710,000.00	724,089.02	
		US TREASURY N/B	500,000.00	496,738.50	
		US TREASURY N/B	600,000.00	606,070.26	

		US TREASURY N/B	750,000.00	767,255.85	
		US TREASURY N/B	410,000.00	408,182.22	
		US TREASURY N/B	740,000.00	739,971.05	
		US TREASURY N/B	810,000.00	817,340.62	
		US TREASURY N/B	570,000.00	583,804.65	
		US TREASURY N/B	590,000.00	592,684.90	
		US TREASURY N/B	600,000.00	604,183.56	
		US TREASURY N/B	700,000.00	700,068.32	
		US TREASURY N/B	500,000.00	510,449.20	
		US TREASURY N/B	560,000.00	565,337.47	
		US TREASURY N/B	600,000.00	611,671.86	
		US TREASURY N/B	380,000.00	380,089.02	
		US TREASURY N/B	490,000.00	493,703.66	
		US TREASURY N/B	970,000.00	980,230.39	
		US TREASURY N/B	470,000.00	472,634.53	
		US TREASURY N/B	650,000.00	655,192.33	
		US TREASURY N/B	700,000.00	713,206.97	
		US TREASURY N/B	290,000.00	291,744.52	
		US TREASURY N/B	460,000.00	463,854.29	
		US TREASURY N/B	500,000.00	508,378.90	
		US TREASURY N/B	470,000.00	472,937.50	
		US TREASURY N/B	700,000.00	706,165.95	
		US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,489,336.58	
		US TREASURY N/B	510,000.00	514,821.08	
		US TREASURY N/B	850,000.00	855,461.84	
		US TREASURY N/B	320,000.00	322,112.48	
		US TREASURY N/B	390,000.00	396,185.12	
		US TREASURY N/B	410,000.00	412,722.64	
		US TREASURY N/B	450,000.00	453,049.78	
		US TREASURY N/B	360,000.00	364,725.00	
		US TREASURY N/B	400,000.00	403,984.35	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,054,511.63	
		US TREASURY N/B	390,000.00	394,052.33	
		US TREASURY N/B	480,000.00	481,968.72	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,000,898.40	

		US TREASURY N/B	520,000.00	523,930.41	
		US TREASURY N/B	350,000.00	353,800.75	
		US TREASURY N/B	300,000.00	299,250.00	
		US TREASURY N/B	330,000.00	333,641.58	
		US TREASURY N/B	410,000.00	415,877.71	
		US TREASURY N/B	290,000.00	291,251.75	
		US TREASURY N/B	670,000.00	679,997.60	
		US TREASURY N/B	700,000.00	703,212.86	
		US TREASURY N/B	720,000.00	733,556.23	
		US TREASURY N/B	400,000.00	403,351.56	
		US TREASURY N/B	560,000.00	574,940.57	
		US TREASURY N/B	650,000.00	660,524.41	
		US TREASURY N/B	610,000.00	610,667.15	
		US TREASURY N/B	590,000.00	610,592.35	
		US TREASURY N/B	170,000.00	170,199.20	
		US TREASURY N/B	90,000.00	92,882.80	
		US TREASURY N/B	150,000.00	150,735.34	
		US TREASURY N/B	450,000.00	468,246.06	
		US TREASURY N/B	640,000.00	645,762.49	
		US TREASURY N/B	770,000.00	774,000.38	
		US TREASURY N/B	400,000.00	416,609.36	
		US TREASURY N/B	470,000.00	468,567.95	
		US TREASURY N/B	550,000.00	571,140.62	
		US TREASURY N/B	490,000.00	486,363.26	
		US TREASURY N/B	620,000.00	646,931.25	
		US TREASURY N/B	160,000.00	165,715.61	
		US TREASURY N/B	600,000.00	597,937.74	
		US TREASURY N/B	730,000.00	762,350.97	
		US TREASURY N/B	540,000.00	538,059.56	
		US TREASURY N/B	480,000.00	503,906.20	
		US TREASURY N/B	540,000.00	542,931.98	
		US TREASURY N/B	650,000.00	682,969.69	
		US TREASURY N/B	710,000.00	743,211.88	
		US TREASURY N/B	440,000.00	450,613.24	
		US TREASURY N/B	600,000.00	631,031.22	

		US TREASURY N/B	490,000.00	504,365.03	
		US TREASURY N/B	650,000.00	678,183.54	
		US TREASURY N/B	420,000.00	432,526.15	
		US TREASURY N/B	690,000.00	724,297.83	
		US TREASURY N/B	490,000.00	502,278.66	
		US TREASURY N/B	800,000.00	828,031.20	
		US TREASURY N/B	890,000.00	912,823.60	
		US TREASURY N/B	670,000.00	683,884.14	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,073,111.06	
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,041,754.65	
		US TREASURY N/B	390,000.00	398,348.41	
		US TREASURY N/B	620,000.00	626,769.09	
		US TREASURY N/B	500,000.00	513,632.80	
		US TREASURY N/B	620,000.00	626,841.76	
		US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,235,903.29	
		US TREASURY N/B	400,000.00	406,671.84	
		US TREASURY N/B	600,000.00	593,531.22	
		US TREASURY N/B	420,000.00	431,787.88	
		US TREASURY N/B	560,000.00	559,978.10	
		US TREASURY N/B	520,000.00	537,814.05	
		US TREASURY N/B	530,000.00	529,979.27	
		US TREASURY N/B	970,000.00	1,003,286.90	
		US TREASURY N/B	400,000.00	411,531.24	
		US TREASURY N/B	800,000.00	800,203.12	
		US TREASURY N/B	400,000.00	414,070.28	
		US TREASURY N/B	430,000.00	450,550.94	
		US TREASURY N/B	620,000.00	634,640.18	
		US TREASURY N/B	550,000.00	583,279.29	
		US TREASURY N/B	830,000.00	875,601.36	
		US TREASURY N/B	450,000.00	480,700.17	
		US TREASURY N/B	710,000.00	731,563.41	
		US TREASURY N/B	440,000.00	470,370.29	
		US TREASURY N/B	890,000.00	946,250.75	
		US TREASURY N/B	470,000.00	503,175.36	
		US TREASURY N/B	390,000.00	399,483.39	

		US TREASURY N/B	570,000.00	606,849.58	
		US TREASURY N/B	530,000.00	571,799.56	
		US TREASURY N/B	570,000.00	615,488.62	
		US TREASURY N/B	450,000.00	467,393.52	
		US TREASURY N/B	480,000.00	515,428.08	
		US TREASURY N/B	500,000.00	530,214.80	
		US TREASURY N/B	600,000.00	636,597.60	
		US TREASURY N/B	460,000.00	461,590.22	
		US TREASURY N/B	330,000.00	347,943.75	
		US TREASURY N/B	850,000.00	884,248.96	
		US TREASURY N/B	450,000.00	471,559.54	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,003,144.50	
		US TREASURY N/B	470,000.00	485,605.45	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,820.31	
		US TREASURY N/B	590,000.00	600,716.76	
		US TREASURY N/B	890,000.00	884,889.79	
		US TREASURY N/B	500,000.00	493,437.50	
		US TREASURY N/B	400,000.00	400,914.04	
		US TREASURY N/B	300,000.00	300,609.36	
		US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,077,541.92	
		US TREASURY N/B	800,000.00	801,531.20	
		US TREASURY N/B	840,000.00	876,635.08	
		US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,137,628.04	
		US TREASURY N/B	880,000.00	919,909.31	
		US TREASURY N/B	930,000.00	972,885.27	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,279,355.05	
		US TREASURY N/B	900,000.00	986,044.86	
		US TREASURY N/B	120,000.00	157,057.02	
		US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,229,484.35	
		US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,198,316.32	
		US TREASURY N/B	310,000.00	403,817.37	
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,394,106.99	
		US TREASURY N/B	840,000.00	890,892.15	
		US TREASURY N/B	890,000.00	885,967.13	
		US TREASURY N/B	750,000.00	754,819.26	

		US TREASURY N/B	120,000.00	171,935.14	
		US TREASURY N/B	270,000.00	369,942.16	
		US TREASURY N/B	200,000.00	273,437.50	
		US TREASURY N/B	90,000.00	131,558.20	
		US TREASURY N/B	130,000.00	179,105.45	
		US TREASURY N/B	100,000.00	139,910.15	
		US TREASURY N/B	70,000.00	87,299.02	
		US TREASURY N/B	240,000.00	328,584.36	
		US TREASURY N/B	190,000.00	268,441.78	
		US TREASURY N/B	200,000.00	278,628.90	
		US TREASURY N/B	390,000.00	560,411.70	
		US TREASURY N/B	260,000.00	363,035.14	
		US TREASURY N/B	250,000.00	328,071.27	
		US TREASURY N/B	210,000.00	289,266.78	
		US TREASURY N/B	230,000.00	337,484.56	
		US TREASURY N/B	250,000.00	350,537.10	
		US TREASURY N/B	230,000.00	297,477.14	
		US TREASURY N/B	130,000.00	153,877.33	
		US TREASURY N/B	180,000.00	213,180.46	
		US TREASURY N/B	480,000.00	557,428.08	
		US TREASURY N/B	300,000.00	334,933.59	
		US TREASURY N/B	410,000.00	457,606.41	
		US TREASURY N/B	590,000.00	698,954.06	
		US TREASURY N/B	360,000.00	409,914.81	
		US TREASURY N/B	480,000.00	614,324.97	
		US TREASURY N/B	570,000.00	743,939.03	
		US TREASURY N/B	740,000.00	949,411.26	
		US TREASURY N/B	550,000.00	680,227.49	
		US TREASURY N/B	760,000.00	904,162.50	
		US TREASURY N/B	340,000.00	396,538.26	
		US TREASURY N/B	680,000.00	727,108.56	
		US TREASURY N/B	520,000.00	607,536.69	
		US TREASURY N/B	480,000.00	549,674.97	
		US TREASURY N/B	710,000.00	831,850.91	
		US TREASURY N/B	500,000.00	535,966.75	

	US TREASURY N/B	660,000.00	707,785.51	
	US TREASURY N/B	480,000.00	490,434.33	
	US TREASURY N/B	500,000.00	576,103.50	
	US TREASURY N/B	670,000.00	790,914.02	
	US TREASURY N/B	400,000.00	472,179.68	
	US TREASURY N/B	800,000.00	903,078.08	
	US TREASURY N/B	670,000.00	756,864.42	
	US TREASURY N/B	460,000.00	544,345.26	
	US TREASURY N/B	830,000.00	1,005,661.69	
	US TREASURY N/B	630,000.00	747,189.82	
	US TREASURY N/B	460,000.00	584,361.69	
	US TREASURY N/B	840,000.00	998,976.55	
	US TREASURY N/B	720,000.00	837,351.50	
	US TREASURY N/B	640,000.00	657,037.44	
	US TREASURY N/B	560,000.00	590,504.65	
	米ドル 小計	125,260,000.00	132,122,004.26 (14,409,225,784)	
カナダドル	GOV OF CANADA	250,000.00	247,737.50	
	GOV OF CANADA	230,000.00	230,535.90	
	GOV OF CANADA	170,000.00	173,811.40	
	GOV OF CANADA	250,000.00	249,865.00	
	GOV OF CANADA	380,000.00	375,428.60	
	GOV OF CANADA	210,000.00	209,048.70	
	GOV OF CANADA	100,000.00	100,030.00	
	GOV OF CANADA	480,000.00	470,328.00	
	GOV OF CANADA	220,000.00	226,415.20	
	GOV OF CANADA	200,000.00	197,662.00	
	GOV OF CANADA	240,000.00	242,265.60	
	GOV OF CANADA	190,000.00	190,378.10	
	GOV OF CANADA	230,000.00	234,650.60	
	GOV OF CANADA	230,000.00	237,941.90	
	GOV OF CANADA	160,000.00	167,492.80	
	GOV OF CANADA	170,000.00	170,858.50	
	GOV OF CANADA	80,000.00	79,512.80	
	GOV OF CANADA	250,000.00	261,192.50	

		GOV OF CANADA	160,000.00	161,227.20	
		GOV OF CANADA	180,000.00	175,237.20	
		GOV OF CANADA	60,000.00	87,480.60	
		GOV OF CANADA	210,000.00	220,346.70	
		GOV OF CANADA	120,000.00	165,524.40	
		GOV OF CANADA	250,000.00	269,337.50	
		GOV OF CANADA	120,000.00	118,578.00	
		GOV OF CANADA	160,000.00	243,860.80	
		GOV OF CANADA	190,000.00	292,183.90	
		GOV OF CANADA	200,000.00	290,820.00	
		GOV OF CANADA	240,000.00	342,076.80	
		GOV OF CANADA	210,000.00	271,341.00	
		GOV OF CANADA	140,000.00	158,284.00	
		GOV OF CANADA	70,000.00	99,191.40	
		カナダドル 小計	6,350,000.00	6,960,644.60 (577,315,863)	
メキシコペソ		UNITED MEXICAN STATE	3,250,000.00	3,240,477.50	
		UNITED MEXICAN STATE	3,330,000.00	3,364,332.30	
		UNITED MEXICAN STATE	3,690,000.00	3,674,206.80	
		UNITED MEXICAN STATE	800,000.00	801,080.00	
		UNITED MEXICAN STATE	4,720,000.00	4,923,243.20	
		UNITED MEXICAN STATE	2,400,000.00	2,522,373.36	
		UNITED MEXICAN STATE	3,810,000.00	4,328,807.70	
		UNITED MEXICAN STATE	2,250,000.00	2,139,930.00	
		UNITED MEXICAN STATE	3,950,000.00	4,117,124.50	
		UNITED MEXICAN STATE	3,680,000.00	4,110,412.80	
		UNITED MEXICAN STATE	2,090,000.00	2,236,843.40	
		UNITED MEXICAN STATE	1,460,000.00	1,573,252.20	
		UNITED MEXICAN STATE	1,310,000.00	1,700,511.00	
		UNITED MEXICAN STATE	2,400,000.00	2,762,640.00	
		UNITED MEXICAN STATE	2,870,000.00	3,084,102.00	
		UNITED MEXICAN STATE	1,770,000.00	1,966,628.41	
		メキシコペソ 小計	43,780,000.00	46,545,965.17 (269,501,138)	
ユーロ		GOV OF AUSTRIA	120,000.00	128,088.12	
		GOV OF AUSTRIA	160,000.00	175,292.80	

GOV OF AUSTRIA	210,000.00	213,281.25	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	66,805.80	
GOV OF AUSTRIA	170,000.00	173,239.35	
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	228,124.68	
GOV OF AUSTRIA	30,000.00	30,644.31	
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	154,222.32	
GOV OF AUSTRIA	240,000.00	262,214.88	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	211,867.36	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	118,040.45	
GOV OF AUSTRIA	180,000.00	190,474.56	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	194,325.30	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	107,994.01	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	116,621.39	
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	145,644.73	
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	350,152.53	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	165,123.00	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	126,709.00	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	131,133.00	
GOV OF AUSTRIA	74,000.00	130,067.28	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	67,415.10	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	291,943.92	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	110,039.20	
GOV OF BELGIUM	280,000.00	316,354.02	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	175,378.88	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	143,756.90	
GOV OF BELGIUM	210,000.00	238,642.11	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	156,638.40	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	287,367.48	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	208,323.36	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	206,084.45	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	215,428.00	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	426,528.52	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	205,585.13	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	175,016.64	
GOV OF BELGIUM	220,000.00	243,844.70	

		GOV OF BELGIUM	120,000.00	177,393.60	
		GOV OF BELGIUM	40,000.00	45,823.16	
		GOV OF BELGIUM	140,000.00	195,897.66	
		GOV OF BELGIUM	270,000.00	460,884.60	
		GOV OF BELGIUM	90,000.00	106,032.15	
		GOV OF BELGIUM	130,000.00	163,843.68	
		GOV OF BELGIUM	260,000.00	455,168.22	
		GOV OF BELGIUM	160,000.00	278,544.00	
		GOV OF BELGIUM	120,000.00	148,100.40	
		GOV OF BELGIUM	90,000.00	113,233.50	
		GOV OF BELGIUM	70,000.00	101,573.92	
		GOV OF BELGIUM	70,000.00	102,964.40	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	105,014.30	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	81,053.12	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	95,278.41	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	96,023.25	
		GOV OF FINLAND	20,000.00	20,394.76	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	99,616.59	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	51,084.15	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	99,557.92	
		GOV OF FINLAND	30,000.00	32,158.86	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	84,251.04	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	95,229.63	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	75,192.44	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	63,655.66	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	84,916.88	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	65,283.00	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	68,676.30	
		GOV OF FINLAND	70,000.00	105,744.24	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	62,837.05	
		GOV OF FRANCE	550,000.00	553,438.60	
		GOV OF FRANCE	590,000.00	621,928.44	
		GOV OF FRANCE	290,000.00	292,243.15	
		GOV OF FRANCE	480,000.00	512,307.84	
		GOV OF FRANCE	270,000.00	273,216.87	

		GOV OF FRANCE	800,000.00	864,825.60	
		GOV OF FRANCE	270,000.00	273,669.84	
		GOV OF FRANCE	670,000.00	722,313.60	
		GOV OF FRANCE	600,000.00	610,691.49	
		GOV OF FRANCE	710,000.00	764,911.81	
		GOV OF FRANCE	640,000.00	756,035.84	
		GOV OF FRANCE	190,000.00	194,002.31	
		GOV OF FRANCE	660,000.00	739,460.56	
		GOV OF FRANCE	640,000.00	709,066.88	
		GOV OF FRANCE	480,000.00	490,351.20	
		GOV OF FRANCE	610,000.00	640,449.98	
		GOV OF FRANCE	340,000.00	466,073.70	
		GOV OF FRANCE	460,000.00	497,245.28	
		GOV OF FRANCE	630,000.00	783,432.09	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	516,124.35	
		GOV OF FRANCE	430,000.00	446,300.44	
		GOV OF FRANCE	350,000.00	382,775.40	
		GOV OF FRANCE	670,000.00	827,865.40	
		GOV OF FRANCE	420,000.00	453,516.00	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	605,444.00	
		GOV OF FRANCE	620,000.00	947,539.80	
		GOV OF FRANCE	570,000.00	603,069.12	
		GOV OF FRANCE	660,000.00	834,923.76	
		GOV OF FRANCE	600,000.00	700,787.40	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	844,078.90	
		GOV OF FRANCE	270,000.00	310,171.14	
		GOV OF FRANCE	410,000.00	688,824.60	
		GOV OF FRANCE	440,000.00	505,448.24	
		GOV OF FRANCE	480,000.00	795,732.48	
		GOV OF FRANCE	240,000.00	299,505.60	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	890,070.30	
		GOV OF FRANCE	370,000.00	599,903.94	
		GOV OF FRANCE	360,000.00	482,040.00	
		GOV OF FRANCE	310,000.00	373,458.24	
		GOV OF FRANCE	280,000.00	555,823.46	

		GOV OF FRANCE	220,000.00	457,804.60	
		GOV OF FRANCE	180,000.00	238,775.40	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	329,523.52	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	211,451.94	
		GOV OF GERMANY	410,000.00	412,982.09	
		GOV OF GERMANY	100,000.00	100,837.50	
		GOV OF GERMANY	280,000.00	295,581.16	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	261,530.25	
		GOV OF GERMANY	80,000.00	80,794.19	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	313,250.97	
		GOV OF GERMANY	110,000.00	111,275.34	
		GOV OF GERMANY	120,000.00	126,208.32	
		GOV OF GERMANY	350,000.00	354,886.55	
		GOV OF GERMANY	490,000.00	518,645.93	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	264,017.50	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	172,903.51	
		GOV OF GERMANY	270,000.00	287,841.60	
		GOV OF GERMANY	180,000.00	183,697.38	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	342,803.20	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	229,851.30	
		GOV OF GERMANY	340,000.00	347,974.14	
		GOV OF GERMANY	220,000.00	241,400.72	
		GOV OF GERMANY	370,000.00	379,551.55	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	229,339.53	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	311,455.36	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	328,994.24	
		GOV OF GERMANY	380,000.00	401,088.48	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	348,224.00	
		GOV OF GERMANY	460,000.00	489,537.06	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	269,010.30	
		GOV OF GERMANY	510,000.00	537,466.56	
		GOV OF GERMANY	140,000.00	214,001.62	
		GOV OF GERMANY	270,000.00	290,353.95	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	253,747.10	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	269,608.75	

		GOV OF GERMANY	190,000.00	274,771.16	
		GOV OF GERMANY	280,000.00	296,615.76	
		GOV OF GERMANY	440,000.00	466,458.08	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	176,054.04	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	351,113.49	
		GOV OF GERMANY	250,000.00	412,507.50	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	414,150.48	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	493,196.04	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	477,850.62	
		GOV OF GERMANY	220,000.00	435,204.88	
		GOV OF GERMANY	270,000.00	464,039.55	
		GOV OF GERMANY	390,000.00	618,133.23	
		GOV OF GERMANY	340,000.00	551,036.64	
		GOV OF GERMANY	300,000.00	391,596.00	
		GOV OF GERMANY	60,000.00	56,671.62	
		GOV OF IRELAND	80,000.00	82,223.71	
		GOV OF IRELAND	80,000.00	81,091.60	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	136,668.78	
		GOV OF IRELAND	150,000.00	173,978.10	
		GOV OF IRELAND	160,000.00	207,532.48	
		GOV OF IRELAND	140,000.00	151,311.44	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	130,513.68	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	133,161.00	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	149,745.24	
		GOV OF IRELAND	100,000.00	114,234.00	
		GOV OF IRELAND	60,000.00	68,639.40	
		GOV OF IRELAND	90,000.00	109,479.06	
		GOV OF IRELAND	140,000.00	185,716.30	
		GOV OF IRELAND	50,000.00	60,155.50	
		GOV OF ITALY	310,000.00	323,641.55	
		GOV OF ITALY	50,000.00	50,147.75	
		GOV OF ITALY	400,000.00	419,821.20	
		GOV OF ITALY	80,000.00	80,661.04	
		GOV OF ITALY	390,000.00	412,807.62	
		GOV OF ITALY	420,000.00	452,434.45	

		GOV OF ITALY	280,000.00	291,379.76	
		GOV OF ITALY	140,000.00	141,015.42	
		GOV OF ITALY	350,000.00	364,514.50	
		GOV OF ITALY	210,000.00	232,086.96	
		GOV OF ITALY	120,000.00	123,104.92	
		GOV OF ITALY	190,000.00	195,509.43	
		GOV OF ITALY	250,000.00	255,737.00	
		GOV OF ITALY	640,000.00	653,250.56	
		GOV OF ITALY	230,000.00	262,319.83	
		GOV OF ITALY	120,000.00	124,269.24	
		GOV OF ITALY	340,000.00	390,157.82	
		GOV OF ITALY	210,000.00	209,186.25	
		GOV OF ITALY	240,000.00	245,483.76	
		GOV OF ITALY	240,000.00	245,568.96	
		GOV OF ITALY	390,000.00	443,852.76	
		GOV OF ITALY	340,000.00	393,171.24	
		GOV OF ITALY	300,000.00	323,295.00	
		GOV OF ITALY	200,000.00	202,843.00	
		GOV OF ITALY	460,000.00	536,135.06	
		GOV OF ITALY	170,000.00	180,179.26	
		GOV OF ITALY	200,000.00	211,172.22	
		GOV OF ITALY	370,000.00	424,383.45	
		GOV OF ITALY	180,000.00	187,963.99	
		GOV OF ITALY	380,000.00	415,485.54	
		GOV OF ITALY	290,000.00	354,119.81	
		GOV OF ITALY	200,000.00	208,464.80	
		GOV OF ITALY	320,000.00	334,489.60	
		GOV OF ITALY	220,000.00	242,222.11	
		GOV OF ITALY	450,000.00	483,313.95	
		GOV OF ITALY	390,000.00	477,333.48	
		GOV OF ITALY	250,000.00	263,035.75	
		GOV OF ITALY	300,000.00	324,390.30	
		GOV OF ITALY	330,000.00	339,501.36	
		GOV OF ITALY	40,000.00	39,949.12	
		GOV OF ITALY	310,000.00	338,265.49	

		GOV OF ITALY	310,000.00	335,009.25	
		GOV OF ITALY	350,000.00	494,887.75	
		GOV OF ITALY	280,000.00	302,385.72	
		GOV OF ITALY	390,000.00	508,737.06	
		GOV OF ITALY	210,000.00	240,659.79	
		GOV OF ITALY	210,000.00	245,226.45	
		GOV OF ITALY	510,000.00	700,718.58	
		GOV OF ITALY	370,000.00	449,905.20	
		GOV OF ITALY	120,000.00	121,490.16	
		GOV OF ITALY	470,000.00	698,918.20	
		GOV OF ITALY	340,000.00	350,061.62	
		GOV OF ITALY	320,000.00	479,210.88	
		GOV OF ITALY	180,000.00	199,917.54	
		GOV OF ITALY	350,000.00	501,204.55	
		GOV OF ITALY	150,000.00	182,894.70	
		GOV OF ITALY	120,000.00	128,806.56	
		GOV OF ITALY	480,000.00	632,373.60	
		GOV OF ITALY	160,000.00	186,247.84	
		GOV OF ITALY	410,000.00	611,463.75	
		GOV OF ITALY	130,000.00	153,219.95	
		GOV OF ITALY	270,000.00	403,150.77	
		GOV OF ITALY	260,000.00	387,205.52	
		GOV OF ITALY	260,000.00	315,920.02	
		GOV OF ITALY	260,000.00	287,817.92	
		GOV OF ITALY	290,000.00	364,272.48	
		GOV OF ITALY	120,000.00	160,384.92	
		GOV OF ITALY	120,000.00	130,519.92	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	253,671.12	
		GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	151,775.25	
		GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	278,598.84	
		GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	293,989.54	
		GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	248,869.66	
		GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	132,864.16	
		GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	323,153.09	
		GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	187,187.04	

		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	254,462.16	
		GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	260,036.40	
		GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	323,871.24	
		GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	152,744.76	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	198,899.98	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	254,262.75	
		GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	367,664.00	
		GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	117,869.09	
		GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	411,573.50	
		GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	351,990.24	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	331,699.83	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	300,846.28	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	305,374.50	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	282,120.16	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	371,443.71	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	305,213.40	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	234,982.49	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	398,383.10	
		GOV OF SPAIN	270,000.00	275,639.05	
		GOV OF SPAIN	310,000.00	364,064.00	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	300,223.75	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	327,445.44	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	254,518.07	
		GOV OF SPAIN	380,000.00	432,405.60	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	359,228.43	
		GOV OF SPAIN	400,000.00	503,462.00	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	258,847.52	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	257,660.95	
		GOV OF SPAIN	400,000.00	551,731.64	
		GOV OF SPAIN	230,000.00	249,068.84	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	351,843.52	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	329,594.40	
		GOV OF SPAIN	360,000.00	394,740.00	
		GOV OF SPAIN	140,000.00	153,613.60	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	455,360.28	

	GOV OF SPAIN	340,000.00	513,101.68	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	320,011.23	
	GOV OF SPAIN	390,000.00	399,405.24	
	GOV OF SPAIN	330,000.00	382,150.15	
	GOV OF SPAIN	410,000.00	670,285.22	
	GOV OF SPAIN	170,000.00	207,734.26	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	208,329.38	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	400,915.54	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	520,381.17	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	359,946.30	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	468,034.00	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	332,792.88	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	269,693.50	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	292,077.18	
	ユーロ 小計	76,404,000.00	91,950,299.58 (11,061,621,039)	
英ポンド	UK TREASURY	340,000.00	343,413.56	
	UK TREASURY	430,000.00	452,985.55	
	UK TREASURY	180,000.00	193,691.44	
	UK TREASURY	270,000.00	270,898.07	
	UK TREASURY	440,000.00	455,853.28	
	UK TREASURY	290,000.00	293,691.70	
	UK TREASURY	290,000.00	309,458.82	
	UK TREASURY	380,000.00	389,797.31	
	UK TREASURY	140,000.00	155,108.57	
	UK TREASURY	250,000.00	308,274.15	
	UK TREASURY	150,000.00	151,651.98	
	UK TREASURY	240,000.00	261,912.00	
	UK TREASURY	240,000.00	256,997.56	
	UK TREASURY	180,000.00	190,785.24	
	UK TREASURY	240,000.00	310,772.06	
	UK TREASURY	430,000.00	471,864.80	
	UK TREASURY	170,000.00	251,371.48	
	UK TREASURY	230,000.00	236,785.36	
	UK TREASURY	240,000.00	345,113.08	

		UK TREASURY	130,000.00	184,659.28	
		UK TREASURY	210,000.00	316,857.49	
		UK TREASURY	300,000.00	451,845.00	
		UK TREASURY	390,000.00	439,837.32	
		UK TREASURY	250,000.00	414,452.20	
		UK TREASURY	190,000.00	300,949.28	
		UK TREASURY	220,000.00	353,958.30	
		UK TREASURY	320,000.00	545,712.00	
		UK TREASURY	310,000.00	453,501.10	
		UK TREASURY	310,000.00	475,689.17	
		UK TREASURY	330,000.00	575,668.76	
		UK TREASURY	220,000.00	242,885.01	
		UK TREASURY	160,000.00	187,341.28	
		UK TREASURY	240,000.00	436,402.36	
		UK TREASURY	240,000.00	421,636.89	
		UK TREASURY	110,000.00	130,031.00	
		UK TREASURY	280,000.00	555,674.11	
		UK TREASURY	230,000.00	286,694.35	
		UK TREASURY	260,000.00	522,746.53	
		UK TREASURY	240,000.00	377,153.76	
		UK TREASURY	220,000.00	436,735.20	
		UK TREASURY	140,000.00	179,932.81	
	英ポンド 小計		10,430,000.00	13,940,789.21 (1,986,701,870)	
	スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,650,000.00	1,798,412.55	
		GOV OF SWEDEN	1,180,000.00	1,259,701.44	
		GOV OF SWEDEN	930,000.00	1,064,322.50	
		GOV OF SWEDEN	1,030,000.00	1,109,328.54	
		GOV OF SWEDEN	660,000.00	704,247.06	
		GOV OF SWEDEN	750,000.00	800,388.75	
		GOV OF SWEDEN	720,000.00	1,121,711.04	
	スウェーデンクローナ 小計		6,920,000.00	7,858,111.88 (89,582,475)	
	ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,310,000.00	1,351,605.60	
		GOV OF NORWAY	1,100,000.00	1,125,472.70	
		GOV OF NORWAY	810,000.00	865,768.50	

	GOV OF NORWAY	450,000.00	460,883.25	
	GOV OF NORWAY	620,000.00	628,233.60	
	GOV OF NORWAY	490,000.00	505,082.20	
	GOV OF NORWAY	640,000.00	674,086.40	
	GOV OF NORWAY	430,000.00	445,783.15	
ノルウェークローネ 小計		5,850,000.00	6,056,915.40 (72,985,830)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,030,000.00	1,098,428.05	
	GOV OF DENMARK	930,000.00	1,005,471.36	
	GOV OF DENMARK	920,000.00	1,043,870.64	
	GOV OF DENMARK	1,300,000.00	1,398,181.20	
	GOV OF DENMARK	660,000.00	713,955.00	
	GOV OF DENMARK	1,810,000.00	3,451,175.50	
デンマーククローネ 小計		6,650,000.00	8,711,081.75 (140,248,416)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	170,000.00	171,268.20	
	GOV OF POLAND	360,000.00	353,350.33	
	GOV OF POLAND	480,000.00	481,754.48	
	GOV OF POLAND	180,000.00	192,999.60	
	GOV OF POLAND	570,000.00	578,223.39	
	GOV OF POLAND	310,000.00	342,649.20	
	GOV OF POLAND	580,000.00	593,011.02	
	GOV OF POLAND	270,000.00	291,426.93	
	GOV OF POLAND	510,000.00	523,558.45	
	GOV OF POLAND	100,000.00	101,517.29	
	GOV OF POLAND	480,000.00	510,367.34	
	GOV OF POLAND	510,000.00	521,334.79	
	GOV OF POLAND	530,000.00	540,503.80	
	GOV OF POLAND	380,000.00	394,193.00	
	GOV OF POLAND	170,000.00	222,071.00	
	GOV OF POLAND	280,000.00	292,278.00	
ポーランドズロチ 小計		5,880,000.00	6,110,506.82 (172,744,027)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	372,285.93	
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	235,370.74	

		GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	460,208.68	
		GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	187,619.16	
		GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	426,045.93	
		GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	443,444.84	
		GOV OF AUSTRALIA	420,000.00	471,635.22	
		GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	601,165.75	
		GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	505,542.68	
		GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	531,519.75	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	339,967.66	
		GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	536,661.79	
		GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	452,413.89	
		GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	507,960.32	
		GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	408,913.41	
		GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	228,522.64	
		GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	337,284.14	
		GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	168,176.14	
		GOV OF AUSTRALIA	110,000.00	149,621.67	
		GOV OF AUSTRALIA	150,000.00	194,356.35	
		GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	84,713.73	
		GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	231,210.07	
	オーストラリアドル 小計		6,810,000.00	7,874,640.49 (585,085,788)	
シンガポールドル		GOV OF SINGAPORE	90,000.00	91,016.16	
		GOV OF SINGAPORE	130,000.00	129,688.00	
		GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,225.87	
		GOV OF SINGAPORE	130,000.00	135,700.73	
		GOV OF SINGAPORE	70,000.00	70,733.41	
		GOV OF SINGAPORE	80,000.00	83,568.86	
		GOV OF SINGAPORE	60,000.00	61,370.61	
		GOV OF SINGAPORE	70,000.00	74,817.40	
		GOV OF SINGAPORE	70,000.00	73,270.52	
		GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,874.80	
		GOV OF SINGAPORE	110,000.00	124,429.04	
		GOV OF SINGAPORE	70,000.00	75,606.76	
		GOV OF SINGAPORE	70,000.00	77,488.95	
		GOV OF SINGAPORE	90,000.00	100,227.93	

	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	95,395.60	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,917.41	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	43,277.44	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	79,979.18	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	103,025.25	
シンガポールドル 小計		1,450,000.00	1,554,613.92 (125,301,881)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	112,067.97	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	224,558.81	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	203,008.80	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,971.69	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	141,931.98	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	132,950.98	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	162,912.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	102,788.85	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	123,691.90	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	173,726.91	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	210,172.42	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	104,719.13	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	104,174.00	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	198,930.00	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	204,054.24	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	83,789.16	
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	251,434.05	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	102,452.02	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	242,014.59	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	270,528.64	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	201,275.75	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	277,000.00	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	228,480.00	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	359,210.00	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	45,800.00	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	106,855.23	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	77,693.94	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	211,839.48	

		GOV OF MALAYSIA	120,000.00	143,702.84	
		GOV OF MALAYSIA	140,000.00	166,880.00	
		GOV OF MALAYSIA	80,000.00	92,240.00	
		GOV OF MALAYSIA	150,000.00	179,371.39	
	マレーシアリンギット 小計		5,050,000.00	5,383,226.77 (144,647,303)	
	南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	940,000.00	942,162.00	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,010,000.00	1,035,149.00	
		GOV OF SOUTH AFRICA	3,900,000.00	4,385,882.67	
		GOV OF SOUTH AFRICA	2,340,000.00	2,185,091.06	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	1,646,366.64	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,340,000.00	1,228,380.54	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,849,999.52	
		GOV OF SOUTH AFRICA	930,000.00	664,429.29	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,753,972.26	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,580,000.00	1,436,829.72	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,060,000.00	736,817.34	
		GOV OF SOUTH AFRICA	1,950,000.00	1,706,640.00	
		GOV OF SOUTH AFRICA	3,770,000.00	3,287,063.00	
	南アフリカランド 小計		24,740,000.00	22,858,783.04 (172,812,399)	
合計				29,807,773,813 (29,807,773,813)	

(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	221銘柄	100.0%	48.3%
カナダドル	国債証券	32銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.9%
ユーロ	国債証券	296銘柄	100.0%	37.1%
英ポンド	国債証券	41銘柄	100.0%	6.7%

スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	22銘柄	100.0%	2.0%
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	32銘柄	100.0%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.6%

（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 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,700,893
コール・ローン	11,471,555
投資信託受益証券	6,004,390,747
未収入金	73,610,000
未収配当金	84,374,479
流動資産合計	6,180,547,674
資産合計	6,180,547,674
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	159,410
未払金	39,667,303
未払解約金	40,000,000
未払利息	31
流動負債合計	79,826,744
負債合計	79,826,744

	2020年 1月27日現在
純資産の部	
元本等	
元本	5,408,384,361
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	692,336,569
元本等合計	6,100,720,930
純資産合計	6,100,720,930
負債純資産合計	6,180,547,674

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 1月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	2,237,772,471円
期中追加設定元本額	4,178,147,843円
期中一部解約元本額	1,007,535,953円
期末元本額	5,408,384,361円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	525,138,072円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	377,233,743円
りそなラップ型ファンド（成長型）	194,658,577円
ＤＣりそな　グローバルバランス	9,152,026円

つみたてバランスファンド	245,175,001円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	102,193,909円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	48,901,118円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	28,234,710円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	2,117,286円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,350,382円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	396,853円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	392,022円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	92,904,467円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	2,086,671,579円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	13,851,723円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	36,005,929円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	37,061,599円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	106,477,440円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	324,730,401円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	591,454,177円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	337,175,868円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	246,616,512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）	490,967円
２．　計算日における受益権の総数	
	5,408,384,361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	1.1280円
(10,000口当たり純資産額)	(11,280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 1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 1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。 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 1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 1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	△10,298,702
合計	△10,298,702

(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 1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	42,074,386	－	41,914,976	△159,410
	米ドル	42,074,386	－	41,914,976	△159,410
合計		42,074,386	－	41,914,976	△159,410

（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
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	498,965	30,127,506.70	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	733,834	24,928,340.98	
		米ドル 小計	1,232,799	55,055,847.68 (6,004,390,747)	
合計				6,004,390,747 (6,004,390,747)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	793,282,477
株式	40,348,833,940
未収入金	161,770,000
未収配当金	67,679,328
差入委託証拠金	21,600,000
流動資産合計	41,393,165,745
資産合計	41,393,165,745
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,119,750
前受金	5,830,000
未払金	276,164,756
未払解約金	58,111,000
未払利息	2,151
流動負債合計	346,227,657
負債合計	346,227,657
純資産の部	
元本等	
元本	34,456,230,681
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,590,707,407
元本等合計	41,046,938,088
純資産合計	41,046,938,088

	2020年 1月27日現在
負債純資産合計	41,393,165,745

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 1月27日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	23,469,138,912円
期中追加設定元本額	25,634,689,921円
期中一部解約元本額	14,647,598,152円
期末元本額	34,456,230,681円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,742,935,848円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,983,412,431円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,420,203,859円
ＤＣりそな　グローバルバランス	42,318,018円
つみたてバランスファンド	1,396,541,529円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	468,365,313円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	223,685,683円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	126,458,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	9,314,643円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	6,187,321円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,785,408円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,726,721円
ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	409,404,641円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	19,411,557,058円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	560,405,708円

Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	52,712,966円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	161,870,070円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	182,055,214円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	200,111,438円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	610,296,074円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,111,581,950円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	633,692,229円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	463,501,764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）	4,058,158円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	532,375,773円
りそなＦＴ　ＴＯＰＩＸインデックス（適格機関投資家専用）	156,447,954円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,543,042,033円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	182,524円
２．　計算日における受益権の総数	
	34,456,230,681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	1.1913円
(10,000口当たり純資産額)	(11,913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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	2,394,682,562
合計	2,394,682,562

(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 1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	772,694,750	－	766,575,000	△6,119,750
合計		772,694,750	－	766,575,000	△6,119,750

（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	800	2,870.00	2,296,000	
日本水産	22,800	596.00	13,588,800	
マルハニチロ	3,300	2,647.00	8,735,100	
カネコ種苗	700	1,311.00	917,700	
サカタのタネ	2,700	3,515.00	9,490,500	
ホクト	1,700	1,938.00	3,294,600	
ホクリヨウ	400	707.00	282,800	
住石ホールディングス	4,900	142.00	695,800	
日鉄鉱業	500	4,620.00	2,310,000	
三井松島ホールディングス	900	1,185.00	1,066,500	
国際石油開発帝石	91,600	1,053.00	96,454,800	
石油資源開発	3,000	2,883.00	8,649,000	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,100	1,684.00	1,852,400	
ヒノキヤグループ	600	2,033.00	1,219,800	
ショーボンドホールディングス	3,300	4,575.00	15,097,500	
ミライト・ホールディングス	6,800	1,680.00	11,424,000	
タマホーム	1,100	1,338.00	1,471,800	
サンヨーホームズ	200	705.00	141,000	
日本アクア	1,000	593.00	593,000	
ファーストコーポレーション	700	590.00	413,000	
ベステラ	400	1,242.00	496,800	
ＴＡＴＥＲＵ	4,700	214.00	1,005,800	

スペースバリューホールディングス	2,800	561.00	1,570,800	
ダイセキ環境ソリューション	400	1,158.00	463,200	
第一カッター興業	300	1,782.00	534,600	
明豊ファシリティワークス	600	787.00	472,200	
安藤・間	13,600	937.00	12,743,200	
東急建設	6,700	769.00	5,152,300	
コムシスホールディングス	8,100	3,165.00	25,636,500	
ビーアールホールディングス	2,600	481.00	1,250,600	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,743.00	3,840,200	
東建コーポレーション	700	7,530.00	5,271,000	
ソネック	200	810.00	162,000	
ヤマウラ	1,000	917.00	917,000	
大成建設	17,600	4,490.00	79,024,000	
大林組	52,700	1,214.00	63,977,800	
清水建設	53,500	1,144.00	61,204,000	
飛島建設	1,500	1,425.00	2,137,500	
長谷工コーポレーション	20,400	1,482.00	30,232,800	
松井建設	2,100	758.00	1,591,800	
錢高組	200	4,050.00	810,000	
鹿島建設	41,400	1,422.00	58,870,800	
不動テトラ	1,400	1,723.00	2,412,200	
大末建設	600	987.00	592,200	
鉄建建設	1,100	2,799.00	3,078,900	
西松建設	4,100	2,463.00	10,098,300	
三井住友建設	12,700	629.00	7,988,300	
大豊建設	1,200	2,768.00	3,321,600	
前田建設工業	13,200	1,134.00	14,968,800	
佐田建設	1,200	467.00	560,400	
ナカノフドー建設	1,500	472.00	708,000	
奥村組	2,900	2,959.00	8,581,100	
東鉄工業	2,300	3,190.00	7,337,000	
イチケン	400	1,771.00	708,400	
富士ピー・エス	800	565.00	452,000	
淺沼組	600	4,805.00	2,883,000	
戸田建設	21,900	722.00	15,811,800	
熊谷組	2,400	3,180.00	7,632,000	
北野建設	300	2,519.00	755,700	
植木組	200	2,504.00	500,800	
矢作建設工業	2,300	826.00	1,899,800	
ピーエス三菱	1,700	713.00	1,212,100	
日本ハウスホールディングス	3,600	485.00	1,746,000	
大東建託	6,300	12,835.00	80,860,500	

新日本建設	2,200	912.00	2,006,400	
ＮＩＰＰＯ	4,400	2,725.00	11,990,000	
東亜道路工業	300	3,485.00	1,045,500	
前田道路	5,600	3,630.00	20,328,000	
日本道路	500	7,350.00	3,675,000	
東亜建設工業	1,600	1,636.00	2,617,600	
日本国土開発	3,100	614.00	1,903,400	
若築建設	900	1,703.00	1,532,700	
東洋建設	5,900	558.00	3,292,200	
五洋建設	20,900	665.00	13,898,500	
世紀東急工業	2,500	964.00	2,410,000	
福田組	600	4,855.00	2,913,000	
住友林業	13,400	1,541.00	20,649,400	
日本基礎技術	1,800	395.00	711,000	
巴コーポレーション	2,300	434.00	998,200	
大和ハウス工業	52,200	3,495.00	182,439,000	
ライト工業	3,000	1,581.00	4,743,000	
積水ハウス	57,700	2,431.00	140,268,700	
日特建設	1,400	863.00	1,208,200	
北陸電気工事	900	1,123.00	1,010,700	
ユアテック	3,000	670.00	2,010,000	
四電工	300	2,861.00	858,300	
中電工	2,100	2,496.00	5,241,600	
関電工	7,500	1,021.00	7,657,500	
きんでん	12,500	1,665.00	20,812,500	
東京エネシス	1,700	885.00	1,504,500	
トーエネック	500	3,790.00	1,895,000	
住友電設	1,500	2,738.00	4,107,000	
日本電設工業	2,900	2,225.00	6,452,500	
協和エクシオ	8,000	2,761.00	22,088,000	
新日本空調	1,400	2,071.00	2,899,400	
九電工	3,700	3,260.00	12,062,000	
三機工業	3,800	1,520.00	5,776,000	
日揮ホールディングス	16,200	1,638.00	26,535,600	
中外炉工業	600	1,752.00	1,051,200	
ヤマト	1,700	889.00	1,511,300	
太平電業	1,300	2,331.00	3,030,300	
高砂熱学工業	4,600	1,918.00	8,822,800	
三晃金属工業	200	2,615.00	523,000	
朝日工業社	400	3,420.00	1,368,000	
明星工業	3,400	897.00	3,049,800	
大氣社	2,600	3,780.00	9,828,000	

ダイダン	1,300	2,580.00	3,354,000	
日比谷総合設備	1,700	1,902.00	3,233,400	
ＯＳＪＢホールディングス	8,300	275.00	2,282,500	
東洋エンジニアリング	2,200	609.00	1,339,800	
レイズネクスト	2,800	1,355.00	3,794,000	
日本製粉	4,900	1,662.00	8,143,800	
日清製粉グループ本社	19,100	1,795.00	34,284,500	
日東富士製粉	100	6,220.00	622,000	
昭和産業	1,500	3,020.00	4,530,000	
鳥越製粉	1,500	835.00	1,252,500	
中部飼料	2,100	1,637.00	3,437,700	
フィード・ワン	11,300	180.00	2,034,000	
東洋精糖	300	1,205.00	361,500	
日本甜菜製糖	900	1,901.00	1,710,900	
三井製糖	1,500	2,144.00	3,216,000	
塩水港精糖	1,800	219.00	394,200	
日新製糖	800	2,003.00	1,602,400	
森永製菓	4,000	5,260.00	21,040,000	
中村屋	400	4,130.00	1,652,000	
江崎グリコ	5,000	4,720.00	23,600,000	
名糖産業	800	1,386.00	1,108,800	
井村屋グループ	700	1,890.00	1,323,000	
不二家	900	2,136.00	1,922,400	
山崎製パン	12,600	2,069.00	26,069,400	
第一屋製パン	300	915.00	274,500	
モロゾフ	200	5,100.00	1,020,000	
亀田製菓	1,000	4,925.00	4,925,000	
寿スピリッツ	1,600	7,750.00	12,400,000	
カルビー	7,700	3,660.00	28,182,000	
森永乳業	3,100	4,260.00	13,206,000	
六甲バター	1,100	1,634.00	1,797,400	
ヤクルト本社	11,600	5,870.00	68,092,000	
明治ホールディングス	11,200	7,820.00	87,584,000	
雪印メグミルク	4,100	2,499.00	10,245,900	
プリマハム	2,600	2,426.00	6,307,600	
日本ハム	6,400	4,770.00	30,528,000	
林兼産業	600	688.00	412,800	
丸大食品	1,800	2,129.00	3,832,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,300	2,679.00	3,482,700	
柿安本店	600	3,250.00	1,950,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	10,800	698.00	7,538,400	
サッポロホールディングス	5,800	2,678.00	15,532,400	

アサヒグループホールディングス	35,300	5,101.00	180,065,300	
キリンホールディングス	71,600	2,460.50	176,171,800	
宝ホールディングス	12,600	980.00	12,348,000	
オエノンホールディングス	4,400	381.00	1,676,400	
養命酒製造	500	1,989.00	994,500	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	11,800	2,808.00	33,134,400	
サントリー食品インターナショナル	11,300	4,595.00	51,923,500	
ダイドーグループホールディングス	900	4,260.00	3,834,000	
伊藤園	5,100	5,340.00	27,234,000	
キーコーヒー	1,700	2,274.00	3,865,800	
ユニカフェ	500	966.00	483,000	
ジャパンフーズ	200	1,289.00	257,800	
日清オイリオグループ	2,200	3,700.00	8,140,000	
不二製油グループ本社	4,100	2,851.00	11,689,100	
かどや製油	100	3,840.00	384,000	
Ｊ－オイルミルズ	900	4,125.00	3,712,500	
キッコーマン	12,100	5,280.00	63,888,000	
味の素	37,300	1,796.00	66,990,800	
キユーピー	9,400	2,320.00	21,808,000	
ハウス食品グループ本社	6,300	3,720.00	23,436,000	
カゴメ	6,400	2,688.00	17,203,200	
焼津水産化学工業	800	1,026.00	820,800	
アリアケジャパン	1,500	7,470.00	11,205,000	
ピエトロ	200	1,635.00	327,000	
エバラ食品工業	400	2,205.00	882,000	
やまみ	100	2,287.00	228,700	
ニチレイ	8,000	2,605.00	20,840,000	
東洋水産	8,700	4,485.00	39,019,500	
イートアンド	600	1,873.00	1,123,800	
大冷	200	1,947.00	389,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	1,022.00	919,800	
日清食品ホールディングス	7,200	8,300.00	59,760,000	
永谷園ホールディングス	800	2,145.00	1,716,000	
一正蒲鉾	700	981.00	686,700	
フジッコ	1,800	1,923.00	3,461,400	
ロック・フィールド	1,800	1,453.00	2,615,400	
日本たばこ産業	97,400	2,317.00	225,675,800	
ケンコーマヨネーズ	900	2,433.00	2,189,700	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,874.00	2,061,400	
なとり	900	1,702.00	1,531,800	
イフジ産業	200	741.00	148,200	
ピックルスコーポレーション	400	2,609.00	1,043,600	

北の達人コーポレーション	5,900	606.00	3,575,400	
ユーグレナ	7,200	737.00	5,306,400	
ミヨシ油脂	600	1,175.00	705,000	
理研ビタミン	800	3,950.00	3,160,000	
片倉工業	2,400	1,245.00	2,988,000	
グンゼ	1,200	4,560.00	5,472,000	
東洋紡	6,500	1,519.00	9,873,500	
ユニチカ	4,800	333.00	1,598,400	
富士紡ホールディングス	800	4,020.00	3,216,000	
倉敷紡績	1,700	2,334.00	3,967,800	
シキボウ	900	1,407.00	1,266,300	
日本毛織	5,400	1,069.00	5,772,600	
ダイトウボウ	2,300	86.00	197,800	
トーア紡コーポレーション	700	511.00	357,700	
ダイドーリミテッド	2,200	276.00	607,200	
帝国繊維	1,800	2,367.00	4,260,600	
帝人	13,400	1,984.00	26,585,600	
東レ	119,200	725.60	86,491,520	
サカイオーベックス	400	1,854.00	741,600	
住江織物	500	2,410.00	1,205,000	
日本フエルト	1,000	494.00	494,000	
イチカワ	200	1,454.00	290,800	
日東製網	200	1,712.00	342,400	
アツギ	1,400	843.00	1,180,200	
ダイニック	600	806.00	483,600	
セーレン	4,000	1,405.00	5,620,000	
ソトー	700	970.00	679,000	
東海染工	200	1,132.00	226,400	
小松マテーレ	2,700	750.00	2,025,000	
ワコールホールディングス	4,300	2,945.00	12,663,500	
ホギメディカル	1,900	3,880.00	7,372,000	
レナウン	4,300	110.00	473,000	
クラウディアホールディングス	400	482.00	192,800	
ＴＳＩホールディングス	5,500	545.00	2,997,500	
マツオカコーポレーション	500	2,030.00	1,015,000	
ワールド	2,300	2,449.00	5,632,700	
三陽商会	900	1,277.00	1,149,300	
ナイガイ	600	445.00	267,000	
オンワードホールディングス	9,900	630.00	6,237,000	
ルックホールディングス	600	1,075.00	645,000	
キムラタン	8,600	29.00	249,400	
ゴールドウイン	3,000	6,660.00	19,980,000	

デサント	3,200	1,788.00	5,721,600	
キング	800	564.00	451,200	
ヤマトインターナショナル	1,000	403.00	403,000	
特種東海製紙	1,000	3,960.00	3,960,000	
王子ホールディングス	68,800	575.00	39,560,000	
日本製紙	7,300	1,818.00	13,271,400	
三菱製紙	2,000	462.00	924,000	
北越コーポレーション	10,900	524.00	5,711,600	
中越パルプ工業	700	1,596.00	1,117,200	
巴川製紙所	500	860.00	430,000	
大王製紙	7,200	1,448.00	10,425,600	
阿波製紙	400	571.00	228,400	
レンゴー	15,600	796.00	12,417,600	
トーモク	1,000	1,780.00	1,780,000	
ザ・パック	1,200	3,820.00	4,584,000	
クラレ	25,900	1,321.00	34,213,900	
旭化成	109,100	1,129.00	123,173,900	
共和レザー	900	797.00	717,300	
昭和電工	11,700	2,684.00	31,402,800	
住友化学	121,000	477.00	57,717,000	
住友精化	700	3,190.00	2,233,000	
日産化学	9,200	4,525.00	41,630,000	
ラサ工業	600	1,462.00	877,200	
クレハ	1,400	6,520.00	9,128,000	
多木化学	500	4,340.00	2,170,000	
テイカ	1,200	1,922.00	2,306,400	
石原産業	3,000	939.00	2,817,000	
片倉コープアグリ	500	1,224.00	612,000	
日本曹達	2,400	3,020.00	7,248,000	
東ソー	25,500	1,602.00	40,851,000	
トクヤマ	4,700	2,658.00	12,492,600	
セントラル硝子	3,400	2,441.00	8,299,400	
東亞合成	10,300	1,218.00	12,545,400	
大阪ソーダ	1,700	2,999.00	5,098,300	
関東電化工業	3,900	1,016.00	3,962,400	
デンカ	6,000	3,010.00	18,060,000	
信越化学工業	28,300	12,395.00	350,778,500	
日本カーバイド工業	600	1,379.00	827,400	
堺化学工業	1,100	2,226.00	2,448,600	
第一稀元素化学工業	1,800	929.00	1,672,200	
エア・ウォーター	15,300	1,523.00	23,301,900	
大陽日酸	15,800	2,401.00	37,935,800	

日本化学工業	500	3,255.00	1,627,500	
東邦アセチレン	300	1,365.00	409,500	
日本パーカライジング	8,300	1,154.00	9,578,200	
高圧ガス工業	2,600	803.00	2,087,800	
チタン工業	200	2,516.00	503,200	
四国化成工業	2,500	1,261.00	3,152,500	
戸田工業	400	2,090.00	836,000	
ステラ　ケミファ	900	3,125.00	2,812,500	
保土谷化学工業	600	3,980.00	2,388,000	
日本触媒	2,600	6,470.00	16,822,000	
大日精化工業	1,500	2,960.00	4,440,000	
カネカ	4,300	3,380.00	14,534,000	
三菱瓦斯化学	15,500	1,669.00	25,869,500	
三井化学	15,000	2,454.00	36,810,000	
ＪＳＲ	15,300	2,003.00	30,645,900	
東京応化工業	2,800	4,785.00	13,398,000	
大阪有機化学工業	1,500	1,868.00	2,802,000	
三菱ケミカルホールディングス	110,100	797.10	87,760,710	
ＫＨネオケム	2,900	2,291.00	6,643,900	
ダイセル	22,500	1,033.00	23,242,500	
住友ベークライト	2,600	4,150.00	10,790,000	
積水化学工業	35,400	1,882.00	66,622,800	
日本ゼオン	14,900	1,259.00	18,759,100	
アイカ工業	4,900	3,475.00	17,027,500	
宇部興産	8,300	2,244.00	18,625,200	
積水樹脂	3,000	2,259.00	6,777,000	
タキロンシーアイ	3,500	711.00	2,488,500	
旭有機材	900	1,692.00	1,522,800	
日立化成	7,600	4,595.00	34,922,000	
ニチバン	900	1,730.00	1,557,000	
リケンテクノス	4,100	493.00	2,021,300	
大倉工業	800	1,779.00	1,423,200	
積水化成品工業	2,200	773.00	1,700,600	
群栄化学工業	400	2,503.00	1,001,200	
タイガースポリマー	900	584.00	525,600	
ミライアル	600	1,299.00	779,400	
ダイキアクシス	600	872.00	523,200	
ダイキョーニシカワ	3,500	764.00	2,674,000	
竹本容器	600	903.00	541,800	
森六ホールディングス	900	2,240.00	2,016,000	
日本化薬	10,200	1,291.00	13,168,200	
カーリットホールディングス	1,700	585.00	994,500	

日本精化	1,300	1,425.00	1,852,500	
扶桑化学工業	1,700	3,185.00	5,414,500	
トリケミカル研究所	400	10,670.00	4,268,000	
ＡＤＥＫＡ	7,600	1,624.00	12,342,400	
日油	6,200	3,490.00	21,638,000	
新日本理化	2,700	197.00	531,900	
ハリマ化成グループ	1,400	1,133.00	1,586,200	
花王	40,300	9,100.00	366,730,000	
第一工業製薬	600	4,330.00	2,598,000	
石原ケミカル	400	1,957.00	782,800	
日華化学	600	860.00	516,000	
ニイタカ	300	2,795.00	838,500	
三洋化成工業	1,000	5,210.00	5,210,000	
有機合成薬品工業	1,200	288.00	345,600	
大日本塗料	1,900	1,149.00	2,183,100	
日本ペイントホールディングス	13,600	5,150.00	70,040,000	
関西ペイント	18,500	2,609.00	48,266,500	
神東塗料	1,300	211.00	274,300	
中国塗料	4,700	1,053.00	4,949,100	
日本特殊塗料	1,200	1,332.00	1,598,400	
藤倉化成	2,200	561.00	1,234,200	
太陽ホールディングス	1,200	4,630.00	5,556,000	
ＤＩＣ	7,000	2,928.00	20,496,000	
サカタインクス	3,600	1,126.00	4,053,600	
東洋インキＳＣホールディングス	3,500	2,502.00	8,757,000	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,300	990.00	1,287,000	
富士フイルムホールディングス	32,200	5,656.00	182,123,200	
資生堂	33,400	7,060.00	235,804,000	
ライオン	21,900	2,091.00	45,792,900	
高砂香料工業	1,100	2,394.00	2,633,400	
マンダム	3,800	2,884.00	10,959,200	
ミルボン	2,200	6,180.00	13,596,000	
ファンケル	6,800	2,797.00	19,019,600	
コーセー	3,200	15,060.00	48,192,000	
コタ	900	1,596.00	1,436,400	
シーボン	100	2,483.00	248,300	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	2,361.00	16,999,200	
ノエビアホールディングス	1,600	5,460.00	8,736,000	
アジュバンコスメジャパン	400	992.00	396,800	
エステー	1,100	1,642.00	1,806,200	
アグロ　カネショウ	500	1,464.00	732,000	
コニシ	2,800	1,580.00	4,424,000	

長谷川香料	2,200	2,251.00	4,952,200	
星光ＰＭＣ	1,000	958.00	958,000	
小林製薬	4,700	8,860.00	41,642,000	
荒川化学工業	1,500	1,536.00	2,304,000	
メック	1,200	1,496.00	1,795,200	
日本高純度化学	500	2,628.00	1,314,000	
タカラバイオ	4,400	2,095.00	9,218,000	
ＪＣＵ	2,000	3,290.00	6,580,000	
新田ゼラチン	1,100	666.00	732,600	
ＯＡＴアグリオ	300	1,400.00	420,000	
デクセリアルズ	4,300	995.00	4,278,500	
アース製薬	1,300	5,760.00	7,488,000	
北興化学工業	1,800	636.00	1,144,800	
大成ラミック	600	2,848.00	1,708,800	
クミアイ化学工業	6,900	898.00	6,196,200	
日本農薬	3,000	579.00	1,737,000	
アキレス	1,200	1,752.00	2,102,400	
有沢製作所	2,700	1,025.00	2,767,500	
日東電工	11,600	6,120.00	70,992,000	
レック	1,800	1,212.00	2,181,600	
三光合成	2,000	367.00	734,000	
きもと	2,900	176.00	510,400	
藤森工業	1,500	3,385.00	5,077,500	
前澤化成工業	1,100	1,160.00	1,276,000	
未来工業	900	2,195.00	1,975,500	
ウェーブロックホールディングス	600	793.00	475,800	
ＪＳＰ	1,000	1,965.00	1,965,000	
エフピコ	1,800	6,360.00	11,448,000	
天馬	1,100	1,986.00	2,184,600	
信越ポリマー	3,000	1,034.00	3,102,000	
東リ	4,200	292.00	1,226,400	
ニフコ	6,200	2,858.00	17,719,600	
バルカー	1,400	2,552.00	3,572,800	
ユニ・チャーム	32,400	3,710.00	120,204,000	
ショーエイコーポレーション	200	820.00	164,000	
協和キリン	16,900	2,653.00	44,835,700	
武田薬品工業	139,900	4,297.00	601,150,300	
アステラス製薬	147,900	1,890.50	279,604,950	
大日本住友製薬	12,500	2,023.00	25,287,500	
塩野義製薬	21,500	6,691.00	143,856,500	
わかもと製薬	2,000	277.00	554,000	
あすか製薬	1,900	1,210.00	2,299,000	

日本新薬	4,400	9,900.00	43,560,000	
ビオフェルミン製薬	300	2,327.00	698,100	
中外製薬	17,500	10,605.00	185,587,500	
科研製薬	2,900	5,850.00	16,965,000	
エーザイ	20,100	8,245.00	165,724,500	
ロート製薬	8,600	3,175.00	27,305,000	
小野薬品工業	38,600	2,575.50	99,414,300	
久光製薬	4,400	5,830.00	25,652,000	
持田製薬	2,300	4,220.00	9,706,000	
参天製薬	31,300	2,093.00	65,510,900	
扶桑薬品工業	600	1,921.00	1,152,600	
日本ケミファ	200	2,999.00	599,800	
ツムラ	5,200	3,070.00	15,964,000	
日医工	4,800	1,343.00	6,446,400	
キッセイ薬品工業	3,000	3,050.00	9,150,000	
生化学工業	3,300	1,182.00	3,900,600	
栄研化学	3,000	2,327.00	6,981,000	
日水製薬	700	1,339.00	937,300	
鳥居薬品	1,100	3,775.00	4,152,500	
ＪＣＲファーマ	1,200	9,550.00	11,460,000	
東和薬品	2,200	2,592.00	5,702,400	
富士製薬工業	1,100	1,570.00	1,727,000	
沢井製薬	3,500	7,250.00	25,375,000	
ゼリア新薬工業	3,100	1,997.00	6,190,700	
第一三共	48,100	7,469.00	359,258,900	
キョーリン製薬ホールディングス	3,700	2,004.00	7,414,800	
大幸薬品	700	4,420.00	3,094,000	
ダイト	1,000	3,610.00	3,610,000	
大塚ホールディングス	32,000	4,882.00	156,224,000	
大正製薬ホールディングス	3,600	7,900.00	28,440,000	
ペプチドリーム	8,500	5,390.00	45,815,000	
日本コークス工業	14,100	77.00	1,085,700	
ニチレキ	2,000	1,344.00	2,688,000	
ユシロ化学工業	900	1,350.00	1,215,000	
ビーピー・カストロール	600	1,440.00	864,000	
富士石油	4,700	231.00	1,085,700	
ＭＯＲＥＳＣＯ	600	1,416.00	849,600	
出光興産	18,900	2,852.00	53,902,800	
ＪＸＴＧホールディングス	252,900	479.80	121,341,420	
コスモエネルギーホールディングス	4,900	2,220.00	10,878,000	
横浜ゴム	9,700	1,914.00	18,565,800	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	9,700	1,387.00	13,453,900	

ブリヂストン	51,700	3,895.00	201,371,500	
住友ゴム工業	15,100	1,202.00	18,150,200	
藤倉コンポジット	1,500	445.00	667,500	
オカモト	1,000	3,850.00	3,850,000	
フコク	800	721.00	576,800	
ニッタ	1,900	3,030.00	5,757,000	
住友理工	3,300	875.00	2,887,500	
三ツ星ベルト	2,200	1,921.00	4,226,200	
バンドー化学	2,900	841.00	2,438,900	
日東紡績	2,500	4,975.00	12,437,500	
ＡＧＣ	16,600	3,885.00	64,491,000	
日本板硝子	8,000	647.00	5,176,000	
石塚硝子	300	2,578.00	773,400	
日本山村硝子	700	1,235.00	864,500	
日本電気硝子	6,800	2,221.00	15,102,800	
オハラ	700	1,303.00	912,100	
住友大阪セメント	3,200	4,550.00	14,560,000	
太平洋セメント	10,600	3,015.00	31,959,000	
日本ヒューム	1,700	809.00	1,375,300	
日本コンクリート工業	3,800	281.00	1,067,800	
三谷セキサン	800	3,805.00	3,044,000	
アジアパイルホールディングス	2,400	567.00	1,360,800	
東海カーボン	17,600	994.00	17,494,400	
日本カーボン	900	3,815.00	3,433,500	
東洋炭素	1,000	2,096.00	2,096,000	
ノリタケカンパニーリミテド	900	4,420.00	3,978,000	
ＴＯＴＯ	12,000	4,630.00	55,560,000	
日本碍子	20,500	1,902.00	38,991,000	
日本特殊陶業	13,100	2,015.00	26,396,500	
ダントーホールディングス	1,400	113.00	158,200	
ＭＡＲＵＷＡ	600	8,530.00	5,118,000	
品川リフラクトリーズ	400	3,130.00	1,252,000	
黒崎播磨	300	6,520.00	1,956,000	
ヨータイ	1,400	710.00	994,000	
イソライト工業	900	639.00	575,100	
東京窯業	2,200	327.00	719,400	
ニッカトー	800	711.00	568,800	
フジミインコーポレーテッド	1,500	3,080.00	4,620,000	
クニミネ工業	700	1,315.00	920,500	
エーアンドエーマテリアル	300	1,592.00	477,600	
ニチアス	4,600	2,713.00	12,479,800	
ニチハ	2,300	2,510.00	5,773,000	

日本製鉄	74,400	1,584.50	117,886,800	
神戸製鋼所	30,400	526.00	15,990,400	
中山製鋼所	2,400	503.00	1,207,200	
合同製鐵	900	2,627.00	2,364,300	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	44,900	1,380.00	61,962,000	
東京製鐵	8,100	827.00	6,698,700	
共英製鋼	1,900	2,060.00	3,914,000	
大和工業	3,500	2,610.00	9,135,000	
東京鐵鋼	700	1,502.00	1,051,400	
大阪製鐵	900	1,555.00	1,399,500	
淀川製鋼所	2,200	1,965.00	4,323,000	
丸一鋼管	5,400	3,045.00	16,443,000	
モリ工業	500	2,471.00	1,235,500	
大同特殊鋼	2,700	4,355.00	11,758,500	
日本高周波鋼業	600	435.00	261,000	
日本冶金工業	1,400	2,170.00	3,038,000	
山陽特殊製鋼	1,200	1,555.00	1,866,000	
愛知製鋼	900	3,555.00	3,199,500	
日立金属	17,900	1,741.00	31,163,900	
日本金属	400	867.00	346,800	
大平洋金属	1,100	2,098.00	2,307,800	
新日本電工	10,600	159.00	1,685,400	
栗本鐵工所	800	2,115.00	1,692,000	
虹技	300	1,412.00	423,600	
日本鋳鉄管	200	1,824.00	364,800	
三菱製鋼	1,200	1,010.00	1,212,000	
日亜鋼業	2,600	368.00	956,800	
日本精線	300	3,720.00	1,116,000	
エンビプロ・ホールディングス	700	784.00	548,800	
シンニッタン	2,700	467.00	1,260,900	
新家工業	400	1,442.00	576,800	
大紀アルミニウム工業所	2,700	730.00	1,971,000	
日本軽金属ホールディングス	42,100	209.00	8,798,900	
三井金属鉱業	4,500	2,631.00	11,839,500	
東邦亜鉛	900	1,855.00	1,669,500	
三菱マテリアル	11,000	2,812.00	30,932,000	
住友金属鉱山	21,300	3,194.00	68,032,200	
ＤＯＷＡホールディングス	4,200	4,010.00	16,842,000	
古河機械金属	3,000	1,354.00	4,062,000	
エス・サイエンス	7,900	46.00	363,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,700	1,433.00	2,436,100	
東邦チタニウム	3,000	880.00	2,640,000	

ＵＡＣＪ	2,500	2,207.00	5,517,500	
ＣＫサンエツ	300	3,300.00	990,000	
古河電気工業	5,200	2,667.00	13,868,400	
住友電気工業	62,200	1,548.50	96,316,700	
フジクラ	20,000	402.00	8,040,000	
昭和電線ホールディングス	1,900	1,401.00	2,661,900	
東京特殊電線	200	2,478.00	495,600	
タツタ電線	3,300	601.00	1,983,300	
カナレ電気	300	1,812.00	543,600	
平河ヒューテック	600	1,502.00	901,200	
リョービ	2,000	1,813.00	3,626,000	
アーレスティ	2,200	527.00	1,159,400	
アサヒホールディングス	2,900	2,863.00	8,302,700	
稲葉製作所	900	1,388.00	1,249,200	
宮地エンジニアリンググループ	500	1,985.00	992,500	
トーカロ	4,600	1,181.00	5,432,600	
アルファＣｏ	600	1,317.00	790,200	
ＳＵＭＣＯ	19,900	1,828.00	36,377,200	
川田テクノロジーズ	300	6,360.00	1,908,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	500	3,115.00	1,557,500	
信和	700	1,105.00	773,500	
東洋製罐グループホールディングス	10,600	1,886.00	19,991,600	
ホッカンホールディングス	900	1,901.00	1,710,900	
コロナ	900	1,029.00	926,100	
横河ブリッジホールディングス	3,100	1,893.00	5,868,300	
駒井ハルテック	300	1,882.00	564,600	
高田機工	200	2,703.00	540,600	
三和ホールディングス	15,900	1,202.00	19,111,800	
文化シヤッター	4,900	883.00	4,326,700	
三協立山	2,300	1,399.00	3,217,700	
アルインコ	1,200	1,216.00	1,459,200	
東洋シヤッター	400	781.00	312,400	
ＬＩＸＩＬグループ	24,500	1,872.00	45,864,000	
日本フイルコン	1,300	551.00	716,300	
ノーリツ	3,400	1,357.00	4,613,800	
長府製作所	1,700	2,310.00	3,927,000	
リンナイ	3,200	8,010.00	25,632,000	
ダイニチ工業	900	679.00	611,100	
日東精工	2,300	598.00	1,375,400	
三洋工業	200	1,965.00	393,000	
岡部	3,400	859.00	2,920,600	
ジーテクト	2,100	1,650.00	3,465,000	

東プレ	3,100	1,685.00	5,223,500	
高周波熱錬	3,200	860.00	2,752,000	
東京製綱	1,200	1,113.00	1,335,600	
サンコール	1,000	534.00	534,000	
モリテック　スチール	1,300	368.00	478,400	
パイオラックス	2,500	1,991.00	4,977,500	
エイチワン	1,700	752.00	1,278,400	
日本発條	17,800	918.00	16,340,400	
中央発條	200	2,981.00	596,200	
アドバネクス	300	1,694.00	508,200	
立川ブラインド工業	700	1,230.00	861,000	
三益半導体工業	1,500	2,496.00	3,744,000	
日本ドライケミカル	400	1,813.00	725,200	
日本製鋼所	5,000	2,092.00	10,460,000	
三浦工業	7,200	3,905.00	28,116,000	
タクマ	5,600	1,217.00	6,815,200	
ツガミ	3,400	1,066.00	3,624,400	
オークマ	1,900	5,210.00	9,899,000	
東芝機械	1,900	3,365.00	6,393,500	
アマダホールディングス	21,100	1,199.00	25,298,900	
アイダエンジニアリング	4,300	908.00	3,904,400	
滝澤鉄工所	500	1,354.00	677,000	
ＦＵＪＩ	7,100	1,809.00	12,843,900	
牧野フライス製作所	1,900	4,450.00	8,455,000	
オーエスジー	7,700	1,939.00	14,930,300	
ダイジェット工業	200	1,451.00	290,200	
旭ダイヤモンド工業	4,300	611.00	2,627,300	
ＤＭＧ森精機	10,500	1,600.00	16,800,000	
ソディック	3,900	925.00	3,607,500	
ディスコ	2,300	26,720.00	61,456,000	
日東工器	900	2,317.00	2,085,300	
日進工具	500	2,858.00	1,429,000	
パンチ工業	1,600	484.00	774,400	
冨士ダイス	800	754.00	603,200	
豊和工業	900	888.00	799,200	
ＯＫＫ	700	621.00	434,700	
石川製作所	400	1,690.00	676,000	
東洋機械金属	1,200	541.00	649,200	
津田駒工業	300	1,126.00	337,800	
エンシュウ	400	1,265.00	506,000	
島精機製作所	2,700	2,203.00	5,948,100	
オプトラン	1,900	3,185.00	6,051,500	

ＮＣホールディングス	500	643.00	321,500	
イワキポンプ	800	1,199.00	959,200	
フリュー	1,600	1,181.00	1,889,600	
ヤマシンフィルタ	3,600	764.00	2,750,400	
日阪製作所	2,000	918.00	1,836,000	
やまびこ	3,200	1,106.00	3,539,200	
平田機工	800	6,570.00	5,256,000	
ペガサスミシン製造	1,800	498.00	896,400	
マルマエ	700	985.00	689,500	
タツモ	800	1,361.00	1,088,800	
ナブテスコ	9,800	3,320.00	32,536,000	
三井海洋開発	1,800	2,545.00	4,581,000	
レオン自動機	1,600	1,532.00	2,451,200	
ＳＭＣ	5,300	49,590.00	262,827,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	1,500	521.00	781,500	
ホソカワミクロン	600	5,030.00	3,018,000	
ユニオンツール	600	3,180.00	1,908,000	
オイレス工業	2,100	1,562.00	3,280,200	
日精エー・エス・ビー機械	600	4,010.00	2,406,000	
サトーホールディングス	2,400	3,185.00	7,644,000	
技研製作所	1,500	4,770.00	7,155,000	
日本エアーテック	500	1,029.00	514,500	
カワタ	500	977.00	488,500	
日精樹脂工業	1,400	973.00	1,362,200	
オカダアイヨン	500	1,235.00	617,500	
ワイエイシイホールディングス	800	669.00	535,200	
小松製作所	76,200	2,567.00	195,605,400	
住友重機械工業	9,600	2,960.00	28,416,000	
日立建機	6,700	3,170.00	21,239,000	
日工	2,300	816.00	1,876,800	
巴工業	700	2,216.00	1,551,200	
井関農機	1,700	1,476.00	2,509,200	
ＴＯＷＡ	1,700	1,069.00	1,817,300	
丸山製作所	400	1,226.00	490,400	
北川鉄工所	800	2,283.00	1,826,400	
ローツェ	700	4,515.00	3,160,500	
タカキタ	600	608.00	364,800	
クボタ	89,200	1,740.50	155,252,600	
荏原実業	400	2,191.00	876,400	
三菱化工機	600	1,811.00	1,086,600	
月島機械	3,100	1,526.00	4,730,600	
帝国電機製作所	1,400	1,375.00	1,925,000	

東京機械製作所	700	365.00	255,500	
新東工業	4,000	945.00	3,780,000	
澁谷工業	1,500	3,110.00	4,665,000	
アイチ　コーポレーション	2,900	798.00	2,314,200	
小森コーポレーション	4,300	1,067.00	4,588,100	
鶴見製作所	1,300	1,790.00	2,327,000	
住友精密工業	200	3,165.00	633,000	
日本ギア工業	500	398.00	199,000	
酒井重工業	300	2,687.00	806,100	
荏原製作所	7,000	3,140.00	21,980,000	
石井鐵工所	200	2,779.00	555,800	
酉島製作所	1,700	880.00	1,496,000	
北越工業	1,700	1,305.00	2,218,500	
ダイキン工業	21,400	15,780.00	337,692,000	
オルガノ	600	7,400.00	4,440,000	
トーヨーカネツ	700	2,235.00	1,564,500	
栗田工業	9,100	3,235.00	29,438,500	
椿本チエイン	2,400	3,555.00	8,532,000	
大同工業	800	795.00	636,000	
木村化工機	1,400	627.00	877,800	
アネスト岩田	2,600	1,000.00	2,600,000	
ダイフク	8,600	7,100.00	61,060,000	
サムコ	500	2,121.00	1,060,500	
加藤製作所	900	1,578.00	1,420,200	
油研工業	300	1,714.00	514,200	
タダノ	8,100	961.00	7,784,100	
フジテック	6,100	1,817.00	11,083,700	
ＣＫＤ	4,700	1,864.00	8,760,800	
キトー	1,300	1,700.00	2,210,000	
平和	4,700	2,278.00	10,706,600	
理想科学工業	1,500	1,881.00	2,821,500	
ＳＡＮＫＹＯ	3,700	3,690.00	13,653,000	
日本金銭機械	1,900	849.00	1,613,100	
マースグループホールディングス	1,100	1,989.00	2,187,900	
フクシマガリレイ	1,000	4,025.00	4,025,000	
オーイズミ	700	610.00	427,000	
ダイコク電機	800	1,603.00	1,282,400	
竹内製作所	2,800	1,926.00	5,392,800	
アマノ	4,400	3,265.00	14,366,000	
ＪＵＫＩ	2,300	794.00	1,826,200	
サンデンホールディングス	2,200	688.00	1,513,600	
蛇の目ミシン工業	1,600	406.00	649,600	

マックス	2,600	2,074.00	5,392,400	
グローリー	4,300	3,235.00	13,910,500	
新晃工業	1,600	1,735.00	2,776,000	
大和冷機工業	2,400	1,157.00	2,776,800	
セガサミーホールディングス	16,700	1,544.00	25,784,800	
日本ピストンリング	600	1,497.00	898,200	
リケン	800	3,725.00	2,980,000	
ＴＰＲ	2,300	1,881.00	4,326,300	
ツバキ・ナカシマ	3,400	1,319.00	4,484,600	
ホシザキ	4,900	10,050.00	49,245,000	
大豊工業	1,400	766.00	1,072,400	
日本精工	31,700	932.00	29,544,400	
ＮＴＮ	38,800	315.00	12,222,000	
ジェイテクト	16,100	1,201.00	19,336,100	
不二越	1,600	4,200.00	6,720,000	
日本トムソン	5,000	462.00	2,310,000	
ＴＨＫ	9,800	2,946.00	28,870,800	
ユーシン精機	1,300	970.00	1,261,000	
前澤給装工業	600	2,313.00	1,387,800	
イーグル工業	2,100	1,000.00	2,100,000	
前澤工業	1,100	395.00	434,500	
日本ピラー工業	1,700	1,510.00	2,567,000	
キッツ	6,800	696.00	4,732,800	
マキタ	21,900	3,985.00	87,271,500	
日立造船	13,300	409.00	5,439,700	
三菱重工業	28,200	4,108.00	115,845,600	
ＩＨＩ	12,100	2,734.00	33,081,400	
スター精密	2,600	1,460.00	3,796,000	
日清紡ホールディングス	11,200	988.00	11,065,600	
イビデン	10,300	2,620.00	26,986,000	
コニカミノルタ	36,700	705.00	25,873,500	
ブラザー工業	20,500	2,248.00	46,084,000	
ミネベアミツミ	31,200	2,285.00	71,292,000	
日立製作所	80,800	4,443.00	358,994,400	
三菱電機	168,100	1,561.50	262,488,150	
富士電機	10,100	3,360.00	33,936,000	
東洋電機製造	700	1,501.00	1,050,700	
安川電機	18,100	3,895.00	70,499,500	
シンフォニアテクノロジー	2,200	1,258.00	2,767,600	
明電舎	3,100	2,323.00	7,201,300	
オリジン	500	1,607.00	803,500	
山洋電気	800	5,240.00	4,192,000	

デンヨー	1,400	2,182.00	3,054,800	
東芝テック	2,100	4,485.00	9,418,500	
芝浦メカトロニクス	300	4,180.00	1,254,000	
マブチモーター	4,700	4,145.00	19,481,500	
日本電産	20,200	14,675.00	296,435,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	440.00	440,000	
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,548.00	1,548,000	
東光高岳	900	1,174.00	1,056,600	
ダブル・スコープ	2,700	833.00	2,249,100	
宮越ホールディングス	600	939.00	563,400	
ダイヘン	1,800	3,490.00	6,282,000	
ヤーマン	2,400	692.00	1,660,800	
ＪＶＣケンウッド	13,600	258.00	3,508,800	
ミマキエンジニアリング	1,600	508.00	812,800	
第一精工	700	2,389.00	1,672,300	
日新電機	3,900	1,338.00	5,218,200	
大崎電気工業	3,300	656.00	2,164,800	
オムロン	15,100	6,250.00	94,375,000	
日東工業	2,500	2,398.00	5,995,000	
ＩＤＥＣ	2,400	2,064.00	4,953,600	
正興電機製作所	400	897.00	358,800	
不二電機工業	200	1,282.00	256,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,600	2,290.00	12,824,000	
サクサホールディングス	400	2,156.00	862,400	
メルコホールディングス	600	2,777.00	1,666,200	
テクノメディカ	400	2,056.00	822,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	996.00	298,800	
日本電気	20,400	5,070.00	103,428,000	
富士通	16,200	10,790.00	174,798,000	
沖電気工業	6,800	1,397.00	9,499,600	
岩崎通信機	800	822.00	657,600	
電気興業	800	3,695.00	2,956,000	
サンケン電気	1,800	2,989.00	5,380,200	
ナカヨ	300	1,670.00	501,000	
アイホン	1,000	1,710.00	1,710,000	
ルネサスエレクトロニクス	80,300	753.00	60,465,900	
セイコーエプソン	20,900	1,628.00	34,025,200	
ワコム	11,200	414.00	4,636,800	
アルバック	3,300	4,325.00	14,272,500	
アクセル	700	891.00	623,700	
ＥＩＺＯ	1,300	3,630.00	4,719,000	
ジャパンディスプレイ	48,300	71.00	3,429,300	

日本信号	4,300	1,420.00	6,106,000	
京三製作所	3,900	588.00	2,293,200	
能美防災	2,200	2,481.00	5,458,200	
ホーチキ	1,200	1,565.00	1,878,000	
星和電機	900	549.00	494,100	
エレコム	1,800	4,565.00	8,217,000	
パナソニック	192,100	1,110.50	213,327,050	
シャープ	19,500	1,595.00	31,102,500	
アンリツ	10,800	2,171.00	23,446,800	
富士通ゼネラル	4,600	2,527.00	11,624,200	
ソニー	106,300	7,865.00	836,049,500	
ＴＤＫ	8,100	12,430.00	100,683,000	
帝国通信工業	700	1,239.00	867,300	
タムラ製作所	5,600	690.00	3,864,000	
アルプスアルパイン	14,900	2,343.00	34,910,700	
池上通信機	500	1,227.00	613,500	
日本電波工業	1,600	529.00	846,400	
鈴木	900	764.00	687,600	
日本トリム	200	4,685.00	937,000	
ローランド　ディー．ジー．	900	2,028.00	1,825,200	
フォスター電機	1,800	1,805.00	3,249,000	
ＳＭＫ	400	3,005.00	1,202,000	
ヨコオ	1,100	3,160.00	3,476,000	
ティアック	1,100	208.00	228,800	
ホシデン	4,600	1,323.00	6,085,800	
ヒロセ電機	2,600	14,140.00	36,764,000	
日本航空電子工業	3,900	2,163.00	8,435,700	
ＴＯＡ	1,800	1,142.00	2,055,600	
マクセルホールディングス	3,600	1,530.00	5,508,000	
古野電気	2,200	1,133.00	2,492,600	
ユニデンホールディングス	500	2,105.00	1,052,500	
スミダコーポレーション	1,300	1,139.00	1,480,700	
アイコム	900	2,548.00	2,293,200	
リオン	700	3,725.00	2,607,500	
本多通信工業	1,500	555.00	832,500	
船井電機	1,700	660.00	1,122,000	
横河電機	15,400	2,000.00	30,800,000	
新電元工業	600	3,520.00	2,112,000	
アズビル	10,600	3,030.00	32,118,000	
東亜ディーケーケー	800	996.00	796,800	
日本光電工業	6,900	3,135.00	21,631,500	
チノー	600	1,431.00	858,600	

共和電業	1,800	433.00	779,400	
日本電子材料	700	1,026.00	718,200	
堀場製作所	3,300	7,120.00	23,496,000	
アドバンテスト	12,500	6,060.00	75,750,000	
小野測器	700	557.00	389,900	
エスペック	1,500	2,240.00	3,360,000	
キーエンス	15,200	39,120.00	594,624,000	
日置電機	900	3,955.00	3,559,500	
シスメックス	12,000	7,975.00	95,700,000	
日本マイクロニクス	2,900	1,384.00	4,013,600	
メガチップス	1,600	1,792.00	2,867,200	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	900	3,520.00	3,168,000	
澤藤電機	200	2,220.00	444,000	
原田工業	800	990.00	792,000	
コーセル	2,100	1,228.00	2,578,800	
イリソ電子工業	1,400	4,350.00	6,090,000	
オプテックスグループ	2,800	1,621.00	4,538,800	
千代田インテグレ	800	2,067.00	1,653,600	
アイ・オー・データ機器	600	1,041.00	624,600	
レーザーテック	6,900	5,930.00	40,917,000	
スタンレー電気	11,800	2,968.00	35,022,400	
岩崎電気	700	1,434.00	1,003,800	
ウシオ電機	9,800	1,678.00	16,444,400	
岡谷電機産業	1,300	376.00	488,800	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,600	443.00	708,800	
エノモト	500	1,248.00	624,000	
日本セラミック	1,700	2,544.00	4,324,800	
遠藤照明	900	714.00	642,600	
古河電池	1,200	771.00	925,200	
双信電機	800	450.00	360,000	
山一電機	1,200	1,770.00	2,124,000	
図研	1,100	2,640.00	2,904,000	
日本電子	3,300	3,745.00	12,358,500	
カシオ計算機	14,900	2,256.00	33,614,400	
ファナック	16,000	20,000.00	320,000,000	
日本シイエムケイ	3,900	551.00	2,148,900	
エンプラス	900	3,135.00	2,821,500	
大真空	600	2,057.00	1,234,200	
ローム	7,500	8,800.00	66,000,000	
浜松ホトニクス	12,100	4,735.00	57,293,500	
三井ハイテック	1,900	1,707.00	3,243,300	
新光電気工業	5,600	1,325.00	7,420,000	

京セラ	23,700	7,612.00	180,404,400	
太陽誘電	7,500	3,450.00	25,875,000	
村田製作所	49,400	6,591.00	325,595,400	
双葉電子工業	2,700	1,308.00	3,531,600	
北陸電気工業	700	1,268.00	887,600	
ニチコン	5,700	1,041.00	5,933,700	
日本ケミコン	1,300	1,796.00	2,334,800	
ＫＯＡ	2,500	1,345.00	3,362,500	
市光工業	2,500	726.00	1,815,000	
小糸製作所	10,100	4,815.00	48,631,500	
ミツバ	3,100	677.00	2,098,700	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,900	7,700.00	22,330,000	
キヤノン電子	1,800	2,151.00	3,871,800	
キヤノン	90,500	3,028.00	274,034,000	
リコー	42,800	1,269.00	54,313,200	
象印マホービン	4,900	2,201.00	10,784,900	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,729.00	345,800	
東京エレクトロン	11,200	24,490.00	274,288,000	
トヨタ紡織	4,900	1,642.00	8,045,800	
芦森工業	300	1,406.00	421,800	
ユニプレス	3,300	1,421.00	4,689,300	
豊田自動織機	13,600	6,280.00	85,408,000	
モリタホールディングス	2,900	1,738.00	5,040,200	
三櫻工業	2,100	1,061.00	2,228,100	
デンソー	37,000	4,651.00	172,087,000	
東海理化電機製作所	4,400	1,980.00	8,712,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	6,100	992.00	6,051,200	
川崎重工業	13,100	2,255.00	29,540,500	
名村造船所	5,400	249.00	1,344,600	
サノヤスホールディングス	2,200	181.00	398,200	
日本車輌製造	600	3,115.00	1,869,000	
三菱ロジスネクスト	2,200	1,703.00	3,746,600	
近畿車輛	300	1,670.00	501,000	
日産自動車	198,300	597.70	118,523,910	
いすゞ自動車	48,700	1,130.50	55,055,350	
トヨタ自動車	187,600	7,752.00	1,454,275,200	
日野自動車	21,000	1,072.00	22,512,000	
三菱自動車工業	62,200	419.00	26,061,800	
エフテック	1,200	773.00	927,600	
レシップホールディングス	700	664.00	464,800	
ＧＭＢ	300	817.00	245,100	
ファルテック	300	1,071.00	321,300	

武蔵精密工業	3,700	1,337.00	4,946,900	
日産車体	3,300	1,024.00	3,379,200	
新明和工業	4,500	1,468.00	6,606,000	
極東開発工業	3,100	1,516.00	4,699,600	
日信工業	3,200	2,232.00	7,142,400	
トピー工業	1,400	1,812.00	2,536,800	
ティラド	600	1,881.00	1,128,600	
曙ブレーキ工業	9,200	230.00	2,116,000	
タチエス	2,800	1,328.00	3,718,400	
ＮＯＫ	9,000	1,520.00	13,680,000	
フタバ産業	4,700	691.00	3,247,700	
ＫＹＢ	1,900	2,998.00	5,696,200	
大同メタル工業	3,200	687.00	2,198,400	
プレス工業	8,300	378.00	3,137,400	
ミクニ	2,200	341.00	750,200	
太平洋工業	3,500	1,412.00	4,942,000	
ケーヒン	3,800	2,579.00	9,800,200	
河西工業	2,300	830.00	1,909,000	
アイシン精機	13,800	3,715.00	51,267,000	
マツダ	49,500	930.00	46,035,000	
今仙電機製作所	1,600	908.00	1,452,800	
本田技研工業	132,400	2,910.50	385,350,200	
スズキ	33,300	4,800.00	159,840,000	
ＳＵＢＡＲＵ	52,200	2,765.00	144,333,000	
安永	800	1,199.00	959,200	
ヤマハ発動機	21,900	2,090.00	45,771,000	
ショーワ	3,800	2,281.00	8,667,800	
ＴＢＫ	2,100	461.00	968,100	
エクセディ	2,300	2,240.00	5,152,000	
豊田合成	5,400	2,571.00	13,883,400	
愛三工業	2,600	725.00	1,885,000	
盟和産業	200	1,122.00	224,400	
日本プラスト	1,400	678.00	949,200	
ヨロズ	1,600	1,437.00	2,299,200	
エフ・シー・シー	2,700	2,275.00	6,142,500	
シマノ	6,300	16,920.00	106,596,000	
テイ・エス　テック	3,900	3,115.00	12,148,500	
ジャムコ	800	1,381.00	1,104,800	
テルモ	47,600	3,939.00	187,496,400	
クリエートメディック	600	1,071.00	642,600	
日機装	5,000	1,333.00	6,665,000	
日本エム・ディ・エム	1,000	2,522.00	2,522,000	

島津製作所	20,100	3,200.00	64,320,000	
ＪＭＳ	1,500	755.00	1,132,500	
クボテック	400	403.00	161,200	
長野計器	1,200	1,011.00	1,213,200	
ブイ・テクノロジー	800	5,040.00	4,032,000	
東京計器	1,100	1,071.00	1,178,100	
愛知時計電機	200	4,340.00	868,000	
インターアクション	900	2,579.00	2,321,100	
オーバル	1,500	247.00	370,500	
東京精密	3,000	4,260.00	12,780,000	
マニー	6,700	2,950.00	19,765,000	
ニコン	27,200	1,362.00	37,046,400	
トプコン	8,500	1,616.00	13,736,000	
オリンパス	93,000	1,785.00	166,005,000	
理研計器	1,500	2,161.00	3,241,500	
タムロン	1,400	2,421.00	3,389,400	
ＨＯＹＡ	33,600	11,010.00	369,936,000	
シード	700	1,014.00	709,800	
ノーリツ鋼機	1,100	1,498.00	1,647,800	
エー・アンド・デイ	1,500	980.00	1,470,000	
朝日インテック	14,300	3,085.00	44,115,500	
シチズン時計	19,700	547.00	10,775,900	
リズム時計工業	500	908.00	454,000	
大研医器	1,200	703.00	843,600	
メニコン	2,300	5,100.00	11,730,000	
シンシア	200	701.00	140,200	
松風	800	1,907.00	1,525,600	
セイコーホールディングス	2,400	2,853.00	6,847,200	
ニプロ	11,600	1,260.00	14,616,000	
中本パックス	400	1,612.00	644,800	
スノーピーク	800	1,030.00	824,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,575.00	8,235,000	
トランザクション	1,100	1,121.00	1,233,100	
粧美堂	500	393.00	196,500	
ニホンフラッシュ	800	2,643.00	2,114,400	
前田工繊	1,900	2,160.00	4,104,000	
永大産業	2,300	346.00	795,800	
アートネイチャー	1,800	802.00	1,443,600	
バンダイナムコホールディングス	17,400	6,409.00	111,516,600	
アイフィスジャパン	400	717.00	286,800	
共立印刷	2,800	168.00	470,400	
ＳＨＯＥＩ	800	4,850.00	3,880,000	

フランスベッドホールディングス	2,400	951.00	2,282,400	
パイロットコーポレーション	2,700	4,275.00	11,542,500	
萩原工業	900	1,634.00	1,470,600	
トッパン・フォームズ	3,600	1,256.00	4,521,600	
フジシールインターナショナル	3,800	2,330.00	8,854,000	
タカラトミー	7,500	1,227.00	9,202,500	
廣済堂	1,200	920.00	1,104,000	
エステールホールディングス	500	698.00	349,000	
アーク	6,500	94.00	611,000	
タカノ	700	795.00	556,500	
プロネクサス	1,400	1,226.00	1,716,400	
ホクシン	1,100	166.00	182,600	
ウッドワン	600	1,181.00	708,600	
大建工業	1,100	1,863.00	2,049,300	
凸版印刷	23,700	2,243.00	53,159,100	
大日本印刷	22,000	3,020.00	66,440,000	
共同印刷	500	2,997.00	1,498,500	
ＮＩＳＳＨＡ	3,500	1,036.00	3,626,000	
光村印刷	100	1,671.00	167,100	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	800	1,685.00	1,348,000	
アシックス	13,900	1,653.00	22,976,700	
ツツミ	500	2,197.00	1,098,500	
小松ウオール工業	500	2,178.00	1,089,000	
ヤマハ	10,000	6,020.00	60,200,000	
河合楽器製作所	500	3,670.00	1,835,000	
クリナップ	1,600	684.00	1,094,400	
ピジョン	10,200	3,715.00	37,893,000	
オリバー	400	3,165.00	1,266,000	
兼松サステック	100	1,899.00	189,900	
キングジム	1,400	855.00	1,197,000	
リンテック	4,000	2,409.00	9,636,000	
イトーキ	3,600	480.00	1,728,000	
任天堂	10,300	42,400.00	436,720,000	
三菱鉛筆	2,800	1,602.00	4,485,600	
タカラスタンダード	3,500	1,908.00	6,678,000	
コクヨ	8,100	1,630.00	13,203,000	
ナカバヤシ	1,600	621.00	993,600	
グローブライド	800	2,441.00	1,952,800	
オカムラ	5,900	1,079.00	6,366,100	
美津濃	1,500	2,630.00	3,945,000	
東京電力ホールディングス	134,200	429.00	57,571,800	
中部電力	51,400	1,459.00	74,992,600	

関西電力	63,700	1,214.50	77,363,650	
中国電力	23,200	1,404.00	32,572,800	
北陸電力	15,400	813.00	12,520,200	
東北電力	42,000	1,000.00	42,000,000	
四国電力	15,100	944.00	14,254,400	
九州電力	34,600	881.00	30,482,600	
北海道電力	15,700	498.00	7,818,600	
沖縄電力	3,100	2,014.00	6,243,400	
電源開発	13,400	2,504.00	33,553,600	
エフオン	800	752.00	601,600	
イーレックス	2,400	1,658.00	3,979,200	
レノバ	2,800	1,199.00	3,357,200	
東京瓦斯	32,300	2,460.00	79,458,000	
大阪瓦斯	32,600	1,917.00	62,494,200	
東邦瓦斯	8,300	4,265.00	35,399,500	
北海道瓦斯	900	1,616.00	1,454,400	
広島ガス	3,600	350.00	1,260,000	
西部瓦斯	1,900	2,365.00	4,493,500	
静岡ガス	4,800	893.00	4,286,400	
メタウォーター	800	4,300.00	3,440,000	
ＳＢＳホールディングス	1,500	1,879.00	2,818,500	
東武鉄道	17,700	3,875.00	68,587,500	
相鉄ホールディングス	5,400	2,950.00	15,930,000	
東急	42,400	1,939.00	82,213,600	
京浜急行電鉄	21,600	2,013.00	43,480,800	
小田急電鉄	25,000	2,402.00	60,050,000	
京王電鉄	8,700	6,290.00	54,723,000	
京成電鉄	11,700	4,070.00	47,619,000	
富士急行	2,300	3,930.00	9,039,000	
新京成電鉄	400	2,480.00	992,000	
東日本旅客鉄道	29,600	9,910.00	293,336,000	
西日本旅客鉄道	15,000	9,316.00	139,740,000	
東海旅客鉄道	14,000	21,895.00	306,530,000	
西武ホールディングス	22,600	1,694.00	38,284,400	
鴻池運輸	2,700	1,570.00	4,239,000	
西日本鉄道	4,700	2,519.00	11,839,300	
ハマキョウレックス	1,300	3,380.00	4,394,000	
サカイ引越センター	900	6,600.00	5,940,000	
近鉄グループホールディングス	15,900	5,850.00	93,015,000	
阪急阪神ホールディングス	21,200	4,500.00	95,400,000	
南海電気鉄道	7,500	2,892.00	21,690,000	
京阪ホールディングス	7,100	5,090.00	36,139,000	

神戸電鉄	400	3,970.00	1,588,000	
名古屋鉄道	13,100	3,270.00	42,837,000	
山陽電気鉄道	1,100	2,106.00	2,316,600	
日本通運	5,600	6,380.00	35,728,000	
ヤマトホールディングス	27,900	1,753.00	48,908,700	
山九	4,400	5,480.00	24,112,000	
丸運	1,000	353.00	353,000	
丸全昭和運輸	1,300	2,955.00	3,841,500	
センコーグループホールディングス	8,800	904.00	7,955,200	
トナミホールディングス	400	5,000.00	2,000,000	
ニッコンホールディングス	5,700	2,595.00	14,791,500	
日本石油輸送	200	2,898.00	579,600	
福山通運	2,000	3,730.00	7,460,000	
セイノーホールディングス	11,900	1,446.00	17,207,400	
エスライン	500	1,011.00	505,500	
神奈川中央交通	400	4,005.00	1,602,000	
日立物流	2,900	3,145.00	9,120,500	
丸和運輸機関	1,700	2,338.00	3,974,600	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,600	1,351.00	2,161,600	
九州旅客鉄道	14,200	3,595.00	51,049,000	
ＳＧホールディングス	16,700	2,371.00	39,595,700	
日本郵船	13,300	1,804.00	23,993,200	
商船三井	10,100	2,740.00	27,674,000	
川崎汽船	4,900	1,536.00	7,526,400	
ＮＳユナイテッド海運	900	2,056.00	1,850,400	
明治海運	1,700	358.00	608,600	
飯野海運	7,500	347.00	2,602,500	
共栄タンカー	300	980.00	294,000	
乾汽船	900	1,150.00	1,035,000	
日本航空	28,700	3,134.00	89,945,800	
ＡＮＡホールディングス	29,100	3,441.00	100,133,100	
パスコ	300	2,121.00	636,300	
トランコム	400	8,050.00	3,220,000	
日新	1,400	1,750.00	2,450,000	
三菱倉庫	5,100	2,780.00	14,178,000	
三井倉庫ホールディングス	1,800	1,901.00	3,421,800	
住友倉庫	5,900	1,462.00	8,625,800	
澁澤倉庫	900	2,218.00	1,996,200	
東陽倉庫	2,900	321.00	930,900	
日本トランスシティ	3,500	489.00	1,711,500	
ケイヒン	300	1,302.00	390,600	
中央倉庫	1,000	1,120.00	1,120,000	

川西倉庫	300	1,042.00	312,600	
安田倉庫	1,300	1,044.00	1,357,200	
ファイズホールディングス	300	515.00	154,500	
東洋埠頭	500	1,414.00	707,000	
宇徳	1,400	589.00	824,600	
上組	9,100	2,361.00	21,485,100	
サンリツ	400	742.00	296,800	
キムラユニティー	400	1,126.00	450,400	
キユーソー流通システム	400	1,925.00	770,000	
近鉄エクスプレス	3,400	1,907.00	6,483,800	
東海運	1,000	286.00	286,000	
エーアイテイー	1,100	1,001.00	1,101,100	
内外トランスライン	600	1,268.00	760,800	
日本コンセプト	500	1,535.00	767,500	
ＮＥＣネッツエスアイ	1,600	4,295.00	6,872,000	
クロスキャット	400	1,257.00	502,800	
システナ	5,900	1,917.00	11,310,300	
デジタルアーツ	800	5,470.00	4,376,000	
日鉄ソリューションズ	2,500	3,345.00	8,362,500	
キューブシステム	900	803.00	722,700	
エイジア	300	1,335.00	400,500	
コア	700	1,491.00	1,043,700	
ソリトンシステムズ	700	1,225.00	857,500	
ソフトクリエイトホールディングス	700	1,736.00	1,215,200	
ＴＩＳ	5,500	6,640.00	36,520,000	
ネオス	700	772.00	540,400	
電算システム	600	2,964.00	1,778,400	
グリー	11,300	463.00	5,231,900	
コーエーテクモホールディングス	3,400	2,780.00	9,452,000	
三菱総合研究所	700	4,565.00	3,195,500	
ボルテージ	300	529.00	158,700	
電算	100	2,272.00	227,200	
ＡＧＳ	1,000	815.00	815,000	
ファインデックス	1,400	1,197.00	1,675,800	
ブレインパッド	300	6,350.00	1,905,000	
ＫＬａｂ	3,200	813.00	2,601,600	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,000	926.00	1,852,000	
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,032.00	406,400	
ネクソン	47,000	1,486.00	69,842,000	
アイスタイル	4,200	487.00	2,045,400	
エムアップ	500	2,800.00	1,400,000	
エイチーム	1,100	1,011.00	1,112,100	

エニグモ	1,200	871.00	1,045,200	
テクノスジャパン	1,300	492.00	639,600	
ｅｎｉｓｈ	800	580.00	464,000	
コロプラ	5,400	1,133.00	6,118,200	
オルトプラス	1,200	891.00	1,069,200	
ブロードリーフ	8,100	630.00	5,103,000	
クロス・マーケティンググループ	700	350.00	245,000	
デジタルハーツホールディングス	900	965.00	868,500	
システム情報	800	1,029.00	823,200	
メディアドゥホールディングス	500	3,290.00	1,645,000	
じげん	4,100	498.00	2,041,800	
ブイキューブ	1,100	631.00	694,100	
エンカレッジ・テクノロジ	300	885.00	265,500	
サイバーリンクス	300	1,205.00	361,500	
ディー・エル・イー	1,200	184.00	220,800	
フィックスターズ	1,800	1,617.00	2,910,600	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	800	1,046.00	836,800	
オプティム	400	3,965.00	1,586,000	
セレス	500	1,221.00	610,500	
ＳＨＩＦＴ	400	8,010.00	3,204,000	
ティーガイア	1,500	2,720.00	4,080,000	
セック	200	3,865.00	773,000	
日本アジアグループ	1,800	380.00	684,000	
豆蔵ホールディングス	1,100	1,491.00	1,640,100	
テクマトリックス	1,200	2,616.00	3,139,200	
プロシップ	500	1,499.00	749,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,000	2,114.00	8,456,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,700	7,310.00	19,737,000	
ザッパラス	900	404.00	363,600	
システムリサーチ	400	1,826.00	730,400	
インターネットイニシアティブ	2,400	3,080.00	7,392,000	
さくらインターネット	1,800	702.00	1,263,600	
ヴィンクス	500	1,108.00	554,000	
GMOクラウド	300	2,450.00	735,000	
ＳＲＡホールディングス	900	2,552.00	2,296,800	
システムインテグレータ	500	922.00	461,000	
朝日ネット	1,200	704.00	844,800	
ｅＢＡＳＥ	1,000	1,526.00	1,526,000	
アバント	1,200	1,171.00	1,405,200	
アドソル日進	600	2,396.00	1,437,600	
フリービット	1,000	901.00	901,000	
コムチュア	1,900	2,480.00	4,712,000	

サイバーコム	300	2,172.00	651,600	
アステリア	1,100	560.00	616,000	
アイル	600	1,944.00	1,166,400	
マークラインズ	800	1,953.00	1,562,400	
メディカル・データ・ビジョン	1,300	828.00	1,076,400	
ｇｕｍｉ	2,100	818.00	1,717,800	
ショーケース	400	695.00	278,000	
モバイルファクトリー	400	1,361.00	544,400	
テラスカイ	600	3,200.00	1,920,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	700	1,748.00	1,223,600	
ＰＣＩホールディングス	300	2,176.00	652,800	
パイプドＨＤ	200	1,840.00	368,000	
アイビーシー	300	1,542.00	462,600	
ネオジャパン	300	1,214.00	364,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	100	2,466.00	246,600	
ランドコンピュータ	300	1,158.00	347,400	
ダブルスタンダード	200	4,350.00	870,000	
オープンドア	800	1,348.00	1,078,400	
マイネット	600	705.00	423,000	
アカツキ	600	5,270.00	3,162,000	
ベネフィットジャパン	100	1,878.00	187,800	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	400	1,332.00	532,800	
ＬＩＮＥ	3,800	5,360.00	20,368,000	
カナミックネットワーク	1,000	808.00	808,000	
ノムラシステムコーポレーション	400	515.00	206,000	
チェンジ	300	3,200.00	960,000	
シンクロ・フード	700	552.00	386,400	
オークネット	1,000	1,168.00	1,168,000	
セグエグループ	300	841.00	252,300	
エイトレッド	200	1,459.00	291,800	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,700	704.00	1,196,800	
マクロミル	2,900	1,065.00	3,088,500	
ビーグリー	300	1,188.00	356,400	
オロ	400	3,670.00	1,468,000	
ユーザーローカル	100	3,150.00	315,000	
テモナ	200	524.00	104,800	
ニーズウェル	200	782.00	156,400	
サインポスト	300	1,957.00	587,100	
ソルクシーズ	700	1,008.00	705,600	
フェイス	600	775.00	465,000	
プロトコーポレーション	1,500	1,382.00	2,073,000	
ハイマックス	200	1,974.00	394,800	

野村総合研究所	27,600	2,380.00	65,688,000	
サイバネットシステム	1,200	920.00	1,104,000	
ＣＥホールディングス	1,000	499.00	499,000	
日本システム技術	300	1,399.00	419,700	
インテージホールディングス	2,100	875.00	1,837,500	
東邦システムサイエンス	500	909.00	454,500	
ソースネクスト	7,800	528.00	4,118,400	
インフォコム	1,800	2,938.00	5,288,400	
ラクスル	900	3,600.00	3,240,000	
ＦＩＧ	1,800	300.00	540,000	
システムサポート	100	2,419.00	241,900	
イーソル	600	2,601.00	1,560,600	
アルテリア・ネットワークス	1,800	1,958.00	3,524,400	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,690.00	676,000	
フォーカスシステムズ	1,000	998.00	998,000	
クレスコ	500	3,920.00	1,960,000	
フジ・メディア・ホールディングス	15,900	1,538.00	24,454,200	
オービック	5,700	15,500.00	88,350,000	
ジャストシステム	2,700	6,240.00	16,848,000	
ＴＤＣソフト	1,400	1,079.00	1,510,600	
Ｚホールディングス	226,600	443.00	100,383,800	
トレンドマイクロ	7,300	5,780.00	42,194,000	
ＩＤホールディングス	600	1,557.00	934,200	
日本オラクル	3,300	9,690.00	31,977,000	
アルファシステムズ	500	2,892.00	1,446,000	
フューチャー	2,000	1,983.00	3,966,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,100	1,489.00	1,637,900	
ＳＢテクノロジー	600	2,190.00	1,314,000	
トーセ	500	900.00	450,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,920.00	8,364,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,500	3,310.00	24,825,000	
アイティフォー	2,000	881.00	1,762,000	
東計電算	200	3,555.00	711,000	
エックスネット	300	1,030.00	309,000	
大塚商会	8,900	4,545.00	40,450,500	
サイボウズ	1,900	1,890.00	3,591,000	
ソフトブレーン	1,000	646.00	646,000	
電通国際情報サービス	1,000	4,720.00	4,720,000	
デジタルガレージ	3,000	4,215.00	12,645,000	
ＥＭシステムズ	2,300	951.00	2,187,300	
ウェザーニューズ	600	3,855.00	2,313,000	
ＣＩＪ	1,200	904.00	1,084,800	

ビジネスエンジニアリング	200	3,275.00	655,000	
日本エンタープライズ	1,700	234.00	397,800	
WOWOW	800	2,645.00	2,116,000	
スカラ	1,200	762.00	914,400	
インテリジェント　ウェイブ	600	805.00	483,000	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,500	543.00	814,500	
ネットワンシステムズ	6,300	1,672.00	10,533,600	
システムソフト	3,900	105.00	409,500	
アルゴグラフィックス	1,400	3,400.00	4,760,000	
マーベラス	2,500	701.00	1,752,500	
エイベックス	2,800	1,221.00	3,418,800	
日本ユニシス	5,200	3,355.00	17,446,000	
兼松エレクトロニクス	900	3,555.00	3,199,500	
東京放送ホールディングス	10,000	1,868.00	18,680,000	
日本テレビホールディングス	13,800	1,474.00	20,341,200	
朝日放送グループホールディングス	1,600	745.00	1,192,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,500	2,096.00	9,432,000	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	10,800	476.00	5,140,800	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,358.00	3,301,200	
日本ＢＳ放送	600	1,197.00	718,200	
ビジョン	1,500	1,527.00	2,290,500	
スマートバリュー	500	801.00	400,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	600	1,765.00	1,059,000	
ワイヤレスゲート	800	736.00	588,800	
コネクシオ	900	1,786.00	1,607,400	
日本通信	12,700	235.00	2,984,500	
クロップス	300	756.00	226,800	
日本電信電話	220,500	2,796.50	616,628,250	
ＫＤＤＩ	122,900	3,266.00	401,391,400	
ソフトバンク	149,900	1,478.50	221,627,150	
光通信	1,700	27,140.00	46,138,000	
ＮＴＴドコモ	121,900	3,116.00	379,840,400	
エムティーアイ	1,600	699.00	1,118,400	
GMOインターネット	6,500	2,172.00	14,118,000	
ファイバーゲート	300	1,317.00	395,100	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	645.00	322,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	4,400	1,941.00	8,540,400	
学研ホールディングス	600	7,420.00	4,452,000	
ゼンリン	3,300	1,657.00	5,468,100	
昭文社	800	380.00	304,000	
インプレスホールディングス	1,500	171.00	256,500	
アイネット	800	1,553.00	1,242,400	

松竹	1,100	14,980.00	16,478,000	
東宝	9,900	4,145.00	41,035,500	
東映	600	15,230.00	9,138,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	43,900	1,547.00	67,913,300	
ピー・シー・エー	200	5,240.00	1,048,000	
ビジネスブレイン太田昭和	300	2,506.00	751,800	
ＤＴＳ	3,700	2,588.00	9,575,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,000	5,520.00	38,640,000	
シーイーシー	1,800	2,127.00	3,828,600	
カプコン	7,800	3,010.00	23,478,000	
アイ・エス・ビー	300	1,961.00	588,300	
ジャステック	1,100	1,103.00	1,213,300	
ＳＣＳＫ	3,800	5,970.00	22,686,000	
日本システムウエア	500	2,651.00	1,325,500	
アイネス	1,600	1,468.00	2,348,800	
ＴＫＣ	1,400	5,370.00	7,518,000	
富士ソフト	2,100	4,350.00	9,135,000	
ＮＳＤ	5,400	1,791.00	9,671,400	
コナミホールディングス	6,000	4,505.00	27,030,000	
福井コンピュータホールディングス	600	3,415.00	2,049,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,100	2,095.00	2,304,500	
ミロク情報サービス	1,500	3,200.00	4,800,000	
ソフトバンクグループ	130,900	4,575.00	598,867,500	
ホウスイ	100	882.00	88,200	
高千穂交易	600	1,177.00	706,200	
伊藤忠食品	400	5,110.00	2,044,000	
エレマテック	1,500	1,175.00	1,762,500	
ＪＡＬＵＸ	500	2,364.00	1,182,000	
あらた	1,300	4,570.00	5,941,000	
トーメンデバイス	200	3,650.00	730,000	
東京エレクトロン　デバイス	600	2,840.00	1,704,000	
フィールズ	1,300	589.00	765,700	
双日	91,500	350.00	32,025,000	
アルフレッサ　ホールディングス	18,400	2,230.00	41,032,000	
横浜冷凍	4,600	959.00	4,411,400	
神栄	200	830.00	166,000	
ラサ商事	900	1,008.00	907,200	
ラクーンホールディングス	800	787.00	629,600	
アルコニックス	1,800	1,381.00	2,485,800	
神戸物産	5,700	4,295.00	24,481,500	
あい　ホールディングス	2,400	1,905.00	4,572,000	
ディーブイエックス	600	890.00	534,000	

ダイワボウホールディングス	1,400	6,690.00	9,366,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,900	1,750.00	6,825,000	
ラクト・ジャパン	600	3,895.00	2,337,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	1,037.00	3,214,700	
八洲電機	1,300	912.00	1,185,600	
メディアスホールディングス	1,000	838.00	838,000	
レスターホールディングス	1,700	1,892.00	3,216,400	
ジューテックホールディングス	400	1,262.00	504,800	
大光	700	664.00	464,800	
ＯＣＨＩホールディングス	400	1,470.00	588,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	8,700	1,065.00	9,265,500	
黒谷	400	485.00	194,000	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	300	820.00	246,000	
三洋貿易	800	2,738.00	2,190,400	
ビューティガレージ	300	2,371.00	711,300	
ウイン・パートナーズ	1,200	1,227.00	1,472,400	
ミタチ産業	500	734.00	367,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,700	5,030.00	13,581,000	
明治電機工業	500	1,557.00	778,500	
デリカフーズホールディングス	600	695.00	417,000	
スターティアホールディングス	400	768.00	307,200	
コメダホールディングス	3,600	2,201.00	7,923,600	
アセンテック	100	2,410.00	241,000	
富士興産	500	660.00	330,000	
協栄産業	200	1,449.00	289,800	
小野建	1,500	1,348.00	2,022,000	
南陽	400	1,816.00	726,400	
佐鳥電機	1,200	867.00	1,040,400	
エコートレーディング	400	571.00	228,400	
伯東	1,000	1,295.00	1,295,000	
コンドーテック	1,300	1,123.00	1,459,900	
中山福	1,000	547.00	547,000	
ナガイレーベン	2,400	2,367.00	5,680,800	
三菱食品	1,800	3,135.00	5,643,000	
松田産業	1,200	1,578.00	1,893,600	
第一興商	2,500	5,470.00	13,675,000	
メディパルホールディングス	17,900	2,376.00	42,530,400	
ＳＰＫ	400	2,763.00	1,105,200	
萩原電気ホールディングス	600	2,658.00	1,594,800	
アズワン	1,100	10,160.00	11,176,000	
スズデン	600	1,438.00	862,800	
尾家産業	500	1,370.00	685,000	

シモジマ	1,000	1,161.00	1,161,000	
ドウシシャ	1,600	1,670.00	2,672,000	
小津産業	400	1,900.00	760,000	
高速	1,000	1,245.00	1,245,000	
たけびし	600	1,473.00	883,800	
リックス	400	1,713.00	685,200	
丸文	1,500	606.00	909,000	
ハピネット	1,400	1,340.00	1,876,000	
橋本総業ホールディングス	300	1,808.00	542,400	
日本ライフライン	4,900	1,355.00	6,639,500	
タカショー	800	474.00	379,200	
エクセル	500	1,596.00	798,000	
マルカ	600	2,083.00	1,249,800	
ＩＤＯＭ	4,400	607.00	2,670,800	
進和	1,000	2,236.00	2,236,000	
エスケイジャパン	300	465.00	139,500	
ダイトロン	700	1,838.00	1,286,600	
シークス	2,100	1,362.00	2,860,200	
田中商事	500	720.00	360,000	
オーハシテクニカ	900	1,545.00	1,390,500	
白銅	600	1,435.00	861,000	
伊藤忠商事	115,800	2,610.00	302,238,000	
丸紅	172,400	801.90	138,247,560	
高島	300	1,962.00	588,600	
長瀬産業	9,300	1,564.00	14,545,200	
蝶理	1,100	2,101.00	2,311,100	
豊田通商	18,500	3,845.00	71,132,500	
三共生興	2,500	586.00	1,465,000	
兼松	6,200	1,427.00	8,847,400	
ツカモトコーポレーション	300	1,118.00	335,400	
三井物産	145,500	1,957.00	284,743,500	
日本紙パルプ商事	900	3,985.00	3,586,500	
日立ハイテクノロジーズ	5,800	7,840.00	45,472,000	
カメイ	2,200	1,157.00	2,545,400	
東都水産	200	2,754.00	550,800	
ＯＵＧホールディングス	200	2,635.00	527,000	
スターゼン	600	4,415.00	2,649,000	
山善	6,500	1,046.00	6,799,000	
椿本興業	300	4,080.00	1,224,000	
住友商事	104,500	1,646.00	172,007,000	
内田洋行	700	7,180.00	5,026,000	
三菱商事	116,200	2,847.50	330,879,500	

第一実業	800	3,640.00	2,912,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,700	2,566.00	12,060,200	
西華産業	900	1,294.00	1,164,600	
佐藤商事	1,400	971.00	1,359,400	
菱洋エレクトロ	1,700	2,047.00	3,479,900	
東京産業	1,500	643.00	964,500	
ユアサ商事	1,600	3,540.00	5,664,000	
神鋼商事	400	2,674.00	1,069,600	
小林産業	1,000	282.00	282,000	
阪和興業	3,100	2,700.00	8,370,000	
正栄食品工業	1,100	3,775.00	4,152,500	
カナデン	1,300	1,331.00	1,730,300	
菱電商事	1,200	1,599.00	1,918,800	
フルサト工業	900	1,709.00	1,538,100	
岩谷産業	3,700	3,675.00	13,597,500	
すてきナイスグループ	700	1,276.00	893,200	
昭光通商	600	713.00	427,800	
ニチモウ	300	1,977.00	593,100	
極東貿易	500	2,166.00	1,083,000	
イワキ	2,300	535.00	1,230,500	
三愛石油	4,100	1,101.00	4,514,100	
稲畑産業	3,600	1,547.00	5,569,200	
ＧＳＩクレオス	400	1,321.00	528,400	
明和産業	1,600	609.00	974,400	
クワザワ	600	660.00	396,000	
ワキタ	3,500	1,041.00	3,643,500	
東邦ホールディングス	5,300	2,314.00	12,264,200	
サンゲツ	4,500	1,977.00	8,896,500	
ミツウロコグループホールディングス	2,400	1,117.00	2,680,800	
シナネンホールディングス	700	1,973.00	1,381,100	
伊藤忠エネクス	3,700	915.00	3,385,500	
サンリオ	4,600	2,152.00	9,899,200	
サンワテクノス	1,200	1,040.00	1,248,000	
リョーサン	1,800	2,627.00	4,728,600	
新光商事	2,600	867.00	2,254,200	
トーホー	700	1,841.00	1,288,700	
三信電気	900	1,747.00	1,572,300	
東陽テクニカ	1,900	1,283.00	2,437,700	
モスフードサービス	2,200	2,960.00	6,512,000	
加賀電子	1,600	2,392.00	3,827,200	
ソーダニッカ	1,800	616.00	1,108,800	
立花エレテック	1,200	1,804.00	2,164,800	

フォーバル	700	1,091.00	763,700	
ＰＡＬＴＡＣ	2,700	5,060.00	13,662,000	
三谷産業	2,300	342.00	786,600	
太平洋興発	700	780.00	546,000	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	300	3,650.00	1,095,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	2,284.00	228,400	
国際紙パルプ商事	4,100	288.00	1,180,800	
ヤマタネ	800	1,550.00	1,240,000	
丸紅建材リース	200	1,874.00	374,800	
日鉄物産	1,200	5,020.00	6,024,000	
泉州電業	500	3,165.00	1,582,500	
トラスコ中山	3,400	2,595.00	8,823,000	
オートバックスセブン	6,100	1,612.00	9,833,200	
モリト	1,200	783.00	939,600	
加藤産業	2,600	3,380.00	8,788,000	
北恵	300	887.00	266,100	
イノテック	1,000	1,207.00	1,207,000	
イエローハット	3,100	1,785.00	5,533,500	
ＪＫホールディングス	1,500	725.00	1,087,500	
日伝	1,500	2,029.00	3,043,500	
北沢産業	1,300	275.00	357,500	
杉本商事	900	1,985.00	1,786,500	
因幡電機産業	4,700	2,764.00	12,990,800	
東テク	500	2,728.00	1,364,000	
ミスミグループ本社	20,700	2,918.00	60,402,600	
アルテック	1,300	251.00	326,300	
タキヒヨー	500	1,888.00	944,000	
蔵王産業	300	1,468.00	440,400	
スズケン	7,000	4,275.00	29,925,000	
ジェコス	1,100	1,084.00	1,192,400	
グローセル	1,700	462.00	785,400	
ローソン	4,200	6,470.00	27,174,000	
サンエー	1,400	4,550.00	6,370,000	
カワチ薬品	1,300	2,203.00	2,863,900	
エービーシー・マート	2,600	6,950.00	18,070,000	
ハードオフコーポレーション	700	827.00	578,900	
アスクル	1,700	3,545.00	6,026,500	
ゲオホールディングス	3,000	1,255.00	3,765,000	
アダストリア	2,300	2,193.00	5,043,900	
ジーフット	1,000	620.00	620,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	691.00	138,200	
くら寿司	900	5,670.00	5,103,000	

キャンドゥ	800	1,607.00	1,285,600	
パルグループホールディングス	800	3,330.00	2,664,000	
エディオン	7,600	1,147.00	8,717,200	
サーラコーポレーション	3,300	620.00	2,046,000	
ワッツ	800	627.00	501,600	
ハローズ	600	2,719.00	1,631,400	
フジオフードシステム	1,400	1,779.00	2,490,600	
あみやき亭	400	3,640.00	1,456,000	
ひらまつ	3,000	270.00	810,000	
大黒天物産	400	3,605.00	1,442,000	
ハニーズホールディングス	1,500	1,381.00	2,071,500	
ファーマライズホールディングス	400	669.00	267,600	
アルペン	1,300	1,634.00	2,124,200	
ハブ	500	1,022.00	511,000	
クオールホールディングス	2,400	1,411.00	3,386,400	
ジンズホールディングス	900	7,630.00	6,867,000	
ビックカメラ	9,800	1,206.00	11,818,800	
ＤＣＭホールディングス	8,900	1,031.00	9,175,900	
ペッパーフードサービス	1,300	975.00	1,267,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	11,800	2,650.00	31,270,000	
東京一番フーズ	400	625.00	250,000	
ＤＤホールディングス	700	1,713.00	1,199,100	
きちりホールディングス	500	764.00	382,000	
アークランドサービスホールディングス	1,200	2,014.00	2,416,800	
Ｊ．フロント　リテイリング	19,800	1,364.00	27,007,200	
ドトール・日レスホールディングス	2,600	2,084.00	5,418,400	
マツモトキヨシホールディングス	6,800	4,275.00	29,070,000	
ブロンコビリー	900	2,627.00	2,364,300	
ＺＯＺＯ	11,400	1,798.00	20,497,200	
トレジャー・ファクトリー	500	891.00	445,500	
物語コーポレーション	400	9,120.00	3,648,000	
ココカラファイン	1,700	6,510.00	11,067,000	
三越伊勢丹ホールディングス	28,900	912.00	26,356,800	
Ｈａｍｅｅ	500	1,521.00	760,500	
ウエルシアホールディングス	4,900	6,340.00	31,066,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,400	2,837.00	6,808,800	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,000	364.00	728,000	
ミサワ	300	699.00	209,700	
ティーライフ	200	893.00	178,600	
エー・ピーカンパニー	300	625.00	187,500	
チムニー	500	2,310.00	1,155,000	
シュッピン	1,100	1,148.00	1,262,800	

ネクステージ	2,400	1,100.00	2,640,000	
ジョイフル本田	4,800	1,253.00	6,014,400	
鳥貴族	500	2,560.00	1,280,000	
キリン堂ホールディングス	700	1,810.00	1,267,000	
ホットランド	1,100	1,282.00	1,410,200	
すかいらーくホールディングス	18,600	2,035.00	37,851,000	
ＳＦＰホールディングス	700	2,414.00	1,689,800	
綿半ホールディングス	600	1,789.00	1,073,400	
ヨシックス	300	2,956.00	886,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,800	966.00	4,636,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	649.00	519,200	
ＢＥＥＮＯＳ	629	1,200.00	754,800	
あさひ	1,200	1,320.00	1,584,000	
日本調剤	500	3,785.00	1,892,500	
コスモス薬品	700	23,890.00	16,723,000	
トーエル	800	789.00	631,200	
オンリー	300	799.00	239,700	
セブン&アイ・ホールディングス	64,800	4,206.00	272,548,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,400	2,352.00	10,348,800	
ツルハホールディングス	3,600	13,350.00	48,060,000	
サンマルクホールディングス	1,300	2,321.00	3,017,300	
フェリシモ	400	1,000.00	400,000	
トリドールホールディングス	2,000	2,633.00	5,266,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,600	505.00	808,000	
ウイルプラスホールディングス	300	863.00	258,900	
ジャパンミート	800	2,205.00	1,764,000	
サツドラホールディングス	200	1,856.00	371,200	
アレンザホールディングス	800	978.00	782,400	
串カツ田中ホールディングス	300	2,367.00	710,100	
バロックジャパンリミテッド	1,200	1,068.00	1,281,600	
クスリのアオキホールディングス	1,600	6,390.00	10,224,000	
力の源ホールディングス	800	1,050.00	840,000	
スシローグローバルホールディングス	1,800	9,810.00	17,658,000	
ＬＩＸＩＬビバ	1,600	2,040.00	3,264,000	
メディカルシステムネットワーク	1,700	516.00	877,200	
はるやまホールディングス	800	868.00	694,400	
ノジマ	2,900	2,214.00	6,420,600	
カッパ・クリエイト	2,300	1,497.00	3,443,100	
ライトオン	1,300	590.00	767,000	
ジーンズメイト	400	305.00	122,000	
良品計画	22,000	1,893.00	41,646,000	

三城ホールディングス	1,900	306.00	581,400	
アドヴァン	2,500	1,298.00	3,245,000	
アルビス	600	2,227.00	1,336,200	
コナカ	2,000	407.00	814,000	
ハウス　オブ　ローゼ	100	1,685.00	168,500	
Ｇ－７ホールディングス	1,000	2,694.00	2,694,000	
イオン北海道	1,700	791.00	1,344,700	
コジマ	2,800	532.00	1,489,600	
ヒマラヤ	600	840.00	504,000	
コーナン商事	2,400	2,387.00	5,728,800	
エコス	600	1,698.00	1,018,800	
ワタミ	2,000	1,290.00	2,580,000	
マルシェ	500	781.00	390,500	
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	39,700	1,735.00	68,879,500	
西松屋チェーン	3,600	940.00	3,384,000	
ゼンショーホールディングス	7,900	2,423.00	19,141,700	
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,926.00	2,118,600	
ハークスレイ	300	1,299.00	389,700	
サイゼリヤ	2,700	2,454.00	6,625,800	
ＶＴホールディングス	6,800	450.00	3,060,000	
魚力	500	1,581.00	790,500	
ポプラ	400	506.00	202,400	
フジ・コーポレーション	400	2,180.00	872,000	
ユナイテッドアローズ	1,700	2,925.00	4,972,500	
ハイデイ日高	2,400	2,004.00	4,809,600	
京都きもの友禅	1,100	341.00	375,100	
コロワイド	5,500	2,315.00	12,732,500	
ピーシーデポコーポレーション	2,300	585.00	1,345,500	
壱番屋	1,200	5,930.00	7,116,000	
トップカルチャー	500	333.00	166,500	
ＰＬＡＮＴ	400	573.00	229,200	
スギホールディングス	3,300	5,520.00	18,216,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,169.00	1,518,300	
ヴィア・ホールディングス	2,000	660.00	1,320,000	
スクロール	2,700	358.00	966,600	
ヨンドシーホールディングス	1,700	2,439.00	4,146,300	
ファミリーマート	13,200	2,438.00	32,181,600	
木曽路	2,200	3,015.00	6,633,000	
ＳＲＳホールディングス	2,000	1,052.00	2,104,000	
千趣会	3,000	448.00	1,344,000	
タカキュー	1,400	186.00	260,400	
ケーヨー	3,400	545.00	1,853,000	

上新電機	2,000	2,390.00	4,780,000	
日本瓦斯	2,600	3,410.00	8,866,000	
ロイヤルホールディングス	2,900	2,395.00	6,945,500	
東天紅	100	1,272.00	127,200	
いなげや	2,100	1,439.00	3,021,900	
島忠	3,100	3,065.00	9,501,500	
チヨダ	1,700	1,461.00	2,483,700	
ライフコーポレーション	1,300	2,423.00	3,149,900	
リンガーハット	2,000	2,491.00	4,982,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,400	471.00	1,130,400	
テンアライド	1,600	439.00	702,400	
ＡＯＫＩホールディングス	3,300	1,071.00	3,534,300	
オークワ	2,600	1,488.00	3,868,800	
コメリ	2,600	2,134.00	5,548,400	
青山商事	3,400	1,410.00	4,794,000	
しまむら	1,900	7,980.00	15,162,000	
はせがわ	900	400.00	360,000	
高島屋	12,100	1,211.00	14,653,100	
松屋	3,300	744.00	2,455,200	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	7,800	1,105.00	8,619,000	
近鉄百貨店	600	3,580.00	2,148,000	
パルコ	1,600	1,848.00	2,956,800	
丸井グループ	15,200	2,579.00	39,200,800	
アクシアル　リテイリング	1,400	3,650.00	5,110,000	
井筒屋	900	240.00	216,000	
イオン	63,700	2,252.00	143,452,400	
イズミ	3,400	3,505.00	11,917,000	
平和堂	3,400	1,952.00	6,636,800	
フジ	2,000	1,821.00	3,642,000	
ヤオコー	1,900	5,620.00	10,678,000	
ゼビオホールディングス	2,000	1,180.00	2,360,000	
ケーズホールディングス	16,000	1,337.00	21,392,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	900	611.00	549,900	
日産東京販売ホールディングス	2,500	278.00	695,000	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	800	2,006.00	1,604,800	
ナルミヤ・インターナショナル	300	1,268.00	380,400	
総合メディカルホールディングス	1,400	2,033.00	2,846,200	
ブックオフグループホールディングス	1,000	1,014.00	1,014,000	
アインホールディングス	2,200	6,290.00	13,838,000	
元気寿司	400	3,000.00	1,200,000	
ヤマダ電機	50,400	552.00	27,820,800	
アークランドサカモト	2,600	1,193.00	3,101,800	

ニトリホールディングス	7,200	17,015.00	122,508,000	
グルメ杵屋	1,200	1,209.00	1,450,800	
愛眼	1,300	246.00	319,800	
ケーユーホールディングス	900	898.00	808,200	
吉野家ホールディングス	5,400	2,599.00	14,034,600	
松屋フーズホールディングス	800	4,750.00	3,800,000	
サガミホールディングス	2,200	1,351.00	2,972,200	
関西スーパーマーケット	1,400	1,015.00	1,421,000	
王将フードサービス	1,200	6,530.00	7,836,000	
プレナス	1,900	1,989.00	3,779,100	
ミニストップ	1,200	1,572.00	1,886,400	
アークス	3,400	1,969.00	6,694,600	
バローホールディングス	3,700	1,930.00	7,141,000	
藤久	100	727.00	72,700	
ベルク	800	5,950.00	4,760,000	
大庄	900	1,646.00	1,481,400	
ファーストリテイリング	2,200	58,460.00	128,612,000	
サンドラッグ	6,200	3,735.00	23,157,000	
サックスバー　ホールディングス	1,400	866.00	1,212,400	
ヤマザワ	400	1,691.00	676,400	
やまや	300	2,210.00	663,000	
ベルーナ	3,500	652.00	2,282,000	
島根銀行	300	639.00	191,700	
じもとホールディングス	11,100	107.00	1,187,700	
めぶきフィナンシャルグループ	86,000	244.00	20,984,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,200	1,299.00	2,857,800	
九州フィナンシャルグループ	27,200	456.00	12,403,200	
ゆうちょ銀行	47,000	1,011.00	47,517,000	
富山第一銀行	3,900	312.00	1,216,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	97,500	420.00	40,950,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,300	735.00	8,305,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	9,800	641.00	6,281,800	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,606.00	2,409,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,665.00	7,728,500	
新生銀行	12,200	1,645.00	20,069,000	
あおぞら銀行	9,900	2,864.00	28,353,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,141,500	566.50	646,659,750	
りそなホールディングス	180,700	459.70	83,067,790	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,300	4,088.00	127,954,400	
三井住友フィナンシャルグループ	114,700	3,871.00	444,003,700	
千葉銀行	57,000	606.00	34,542,000	
群馬銀行	32,600	350.00	11,410,000	

武蔵野銀行	2,500	1,717.00	4,292,500	
千葉興業銀行	4,500	353.00	1,588,500	
筑波銀行	6,800	213.00	1,448,400	
七十七銀行	5,600	1,645.00	9,212,000	
青森銀行	1,300	2,693.00	3,500,900	
秋田銀行	1,100	2,025.00	2,227,500	
山形銀行	1,900	1,403.00	2,665,700	
岩手銀行	1,100	2,592.00	2,851,200	
東邦銀行	14,700	251.00	3,689,700	
東北銀行	800	1,013.00	810,400	
みちのく銀行	1,100	1,418.00	1,559,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	14,000	1,936.00	27,104,000	
静岡銀行	41,000	766.00	31,406,000	
十六銀行	2,100	2,268.00	4,762,800	
スルガ銀行	16,900	427.00	7,216,300	
八十二銀行	40,000	416.00	16,640,000	
山梨中央銀行	1,900	1,016.00	1,930,400	
大垣共立銀行	3,300	2,249.00	7,421,700	
福井銀行	1,400	1,649.00	2,308,600	
北國銀行	1,700	3,165.00	5,380,500	
清水銀行	700	2,062.00	1,443,400	
富山銀行	300	2,206.00	661,800	
滋賀銀行	3,300	2,594.00	8,560,200	
南都銀行	2,800	2,653.00	7,428,400	
百五銀行	14,800	329.00	4,869,200	
京都銀行	5,900	4,515.00	26,638,500	
紀陽銀行	5,900	1,568.00	9,251,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	11,000	1,056.00	11,616,000	
広島銀行	24,400	489.00	11,931,600	
山陰合同銀行	9,800	609.00	5,968,200	
中国銀行	14,300	1,020.00	14,586,000	
鳥取銀行	600	1,336.00	801,600	
伊予銀行	23,600	562.00	13,263,200	
百十四銀行	1,800	1,964.00	3,535,200	
四国銀行	2,500	947.00	2,367,500	
阿波銀行	2,700	2,282.00	6,161,400	
大分銀行	1,000	2,557.00	2,557,000	
宮崎銀行	1,100	2,423.00	2,665,300	
佐賀銀行	1,000	1,562.00	1,562,000	
沖縄銀行	1,500	3,470.00	5,205,000	
琉球銀行	3,800	1,067.00	4,054,600	
セブン銀行	55,300	328.00	18,138,400	

みずほフィナンシャルグループ	2,253,300	162.10	365,259,930	
高知銀行	600	827.00	496,200	
山口フィナンシャルグループ	20,700	658.00	13,620,600	
長野銀行	500	1,592.00	796,000	
名古屋銀行	1,300	3,295.00	4,283,500	
北洋銀行	24,800	220.00	5,456,000	
愛知銀行	600	3,430.00	2,058,000	
中京銀行	700	2,210.00	1,547,000	
大光銀行	600	1,644.00	986,400	
愛媛銀行	2,300	1,117.00	2,569,100	
トマト銀行	700	1,038.00	726,600	
京葉銀行	7,000	583.00	4,081,000	
栃木銀行	8,000	207.00	1,656,000	
北日本銀行	500	2,138.00	1,069,000	
東和銀行	2,900	804.00	2,331,600	
福島銀行	1,600	237.00	379,200	
大東銀行	900	632.00	568,800	
トモニホールディングス	12,700	372.00	4,724,400	
フィデアホールディングス	16,000	127.00	2,032,000	
池田泉州ホールディングス	18,900	199.00	3,761,100	
ＦＰＧ	5,100	1,026.00	5,232,600	
マーキュリアインベストメント	800	713.00	570,400	
ＳＢＩホールディングス	18,500	2,395.00	44,307,500	
日本アジア投資	1,400	271.00	379,400	
ジャフコ	2,500	4,555.00	11,387,500	
大和証券グループ本社	133,100	556.00	74,003,600	
野村ホールディングス	291,800	560.00	163,408,000	
岡三証券グループ	14,000	380.00	5,320,000	
丸三証券	4,900	503.00	2,464,700	
東洋証券	5,900	145.00	855,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,900	339.00	6,407,100	
光世証券	400	610.00	244,000	
水戸証券	4,800	223.00	1,070,400	
いちよし証券	3,100	615.00	1,906,500	
松井証券	9,500	877.00	8,331,500	
だいこう証券ビジネス	800	698.00	558,400	
マネックスグループ	12,400	270.00	3,348,000	
極東証券	2,200	738.00	1,623,600	
岩井コスモホールディングス	1,600	1,284.00	2,054,400	
藍澤證券	3,000	733.00	2,199,000	
マネーパートナーズグループ	1,700	240.00	408,000	
スパークス・グループ	5,700	264.00	1,504,800	

小林洋行	400	271.00	108,400	
かんぽ生命保険	5,900	1,902.00	11,221,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	31,200	4,197.00	130,946,400	
アニコム　ホールディングス	1,400	3,975.00	5,565,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	43,400	3,639.00	157,932,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,600	2,569.00	34,938,400	
第一生命ホールディングス	93,800	1,654.00	155,145,200	
東京海上ホールディングス	59,300	5,999.00	355,740,700	
Ｔ＆Ｄホールディングス	49,600	1,200.00	59,520,000	
アドバンスクリエイト	400	1,855.00	742,000	
全国保証	4,700	4,700.00	22,090,000	
ジェイリース	500	391.00	195,500	
イントラスト	600	841.00	504,600	
日本モーゲージサービス	300	2,073.00	621,900	
Ｃａｓａ	600	1,578.00	946,800	
アルヒ	2,600	2,020.00	5,252,000	
プレミアグループ	900	2,083.00	1,874,700	
クレディセゾン	11,600	1,851.00	21,471,600	
芙蓉総合リース	1,700	6,980.00	11,866,000	
みずほリース	2,600	3,295.00	8,567,000	
東京センチュリー	3,300	5,630.00	18,579,000	
日本証券金融	7,300	510.00	3,723,000	
アイフル	25,300	306.00	7,741,800	
リコーリース	1,300	4,380.00	5,694,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,100	1,680.00	16,968,000	
アコム	33,300	527.00	17,549,100	
ジャックス	1,800	2,624.00	4,723,200	
オリエントコーポレーション	44,900	171.00	7,677,900	
日立キャピタル	3,900	2,990.00	11,661,000	
アプラスフィナンシャル	8,600	99.00	851,400	
オリックス	103,700	1,868.00	193,711,600	
三菱ＵＦＪリース	42,100	698.00	29,385,800	
九州リースサービス	800	597.00	477,600	
日本取引所グループ	47,600	2,002.00	95,295,200	
イー・ギャランティ	1,800	1,327.00	2,388,600	
アサックス	900	711.00	639,900	
ＮＥＣキャピタルソリューション	700	2,789.00	1,952,300	
いちご	21,000	427.00	8,967,000	
日本駐車場開発	18,100	145.00	2,624,500	
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,653.00	1,487,700	
ヒューリック	35,400	1,332.00	47,152,800	
三栄建築設計	700	1,484.00	1,038,800	

野村不動産ホールディングス	10,100	2,793.00	28,209,300	
三重交通グループホールディングス	3,300	606.00	1,999,800	
サムティ	2,400	1,891.00	4,538,400	
ディア・ライフ	2,100	582.00	1,222,200	
コーセーアールイー	500	703.00	351,500	
エー・ディー・ワークス	32,700	29.00	948,300	
日本商業開発	1,000	1,698.00	1,698,000	
プレサンスコーポレーション	2,700	1,263.00	3,410,100	
ユニゾホールディングス	2,500	5,160.00	12,900,000	
ＴＨＥグローバル社	900	449.00	404,100	
ハウスコム	200	1,540.00	308,000	
日本管理センター	1,100	1,347.00	1,481,700	
サンセイランディック	500	883.00	441,500	
エストラスト	200	864.00	172,800	
フージャースホールディングス	3,300	708.00	2,336,400	
オープンハウス	4,800	2,919.00	14,011,200	
東急不動産ホールディングス	45,100	769.00	34,681,900	
飯田グループホールディングス	13,800	1,934.00	26,689,200	
イーグランド	300	839.00	251,700	
ムゲンエステート	1,200	711.00	853,200	
ビーロット	400	1,718.00	687,200	
ファーストブラザーズ	400	1,248.00	499,200	
ハウスドゥ	900	1,349.00	1,214,100	
シーアールイー	400	1,180.00	472,000	
プロパティエージェント	300	1,167.00	350,100	
ケイアイスター不動産	500	1,933.00	966,500	
アグレ都市デザイン	300	572.00	171,600	
グッドコムアセット	400	2,456.00	982,400	
ジェイ・エス・ビー	200	5,290.00	1,058,000	
テンポイノベーション	400	880.00	352,000	
グローバル・リンク・マネジメント	300	625.00	187,500	
パーク２４	8,900	2,718.00	24,190,200	
パラカ	400	1,994.00	797,600	
三井不動産	81,800	2,858.50	233,825,300	
三菱地所	116,200	2,262.50	262,902,500	
平和不動産	3,000	3,200.00	9,600,000	
東京建物	18,100	1,754.00	31,747,400	
ダイビル	4,300	1,372.00	5,899,600	
京阪神ビルディング	2,700	1,488.00	4,017,600	
住友不動産	37,300	3,963.00	147,819,900	
テーオーシー	3,200	913.00	2,921,600	
東京楽天地	300	5,960.00	1,788,000	

レオパレス２１	21,700	374.00	8,115,800	
スターツコーポレーション	2,300	2,746.00	6,315,800	
フジ住宅	1,900	677.00	1,286,300	
空港施設	1,700	545.00	926,500	
明和地所	1,000	616.00	616,000	
ゴールドクレスト	1,300	2,020.00	2,626,000	
エスリード	600	2,049.00	1,229,400	
日神グループホールディングス	2,400	542.00	1,300,800	
日本エスコン	3,000	967.00	2,901,000	
タカラレーベン	7,500	478.00	3,585,000	
ＡＶＡＮＴＩＡ	900	998.00	898,200	
イオンモール	8,300	1,865.00	15,479,500	
毎日コムネット	400	934.00	373,600	
ファースト住建	700	1,225.00	857,500	
ランド	95,200	12.00	1,142,400	
カチタス	2,100	4,555.00	9,565,500	
トーセイ	2,300	1,465.00	3,369,500	
穴吹興産	400	1,706.00	682,400	
サンフロンティア不動産	2,300	1,260.00	2,898,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,400	1,232.00	1,724,800	
インテリックス	500	734.00	367,000	
ランドビジネス	700	723.00	506,100	
日本社宅サービス	400	1,078.00	431,200	
グランディハウス	1,300	494.00	642,200	
日本空港ビルデング	5,300	4,970.00	26,341,000	
日本工営	1,100	3,545.00	3,899,500	
ＬＩＦＵＬＬ	5,600	550.00	3,080,000	
ジェイエイシーリクルートメント	1,100	1,755.00	1,930,500	
日本M&Aセンター	12,100	3,955.00	47,855,500	
メンバーズ	500	1,923.00	961,500	
中広	100	545.00	54,500	
ＵＴグループ	1,900	2,895.00	5,500,500	
アイティメディア	500	904.00	452,000	
タケエイ	1,500	1,200.00	1,800,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	200	1,819.00	363,800	
ビーネックスグループ	1,800	1,247.00	2,244,600	
コシダカホールディングス	3,900	1,784.00	6,957,600	
アルトナー	400	861.00	344,400	
パソナグループ	2,000	1,543.00	3,086,000	
ＣＤＳ	400	1,532.00	612,800	
リンクアンドモチベーション	3,500	551.00	1,928,500	
ＧＣＡ	1,900	936.00	1,778,400	

エス・エム・エス	5,000	2,819.00	14,095,000	
サニーサイドアップグループ	400	1,181.00	472,400	
パーソルホールディングス	16,100	1,999.00	32,183,900	
リニカル	800	1,036.00	828,800	
クックパッド	5,600	339.00	1,898,400	
エスクリ	500	788.00	394,000	
アイ・ケイ・ケイ	800	732.00	585,600	
学情	600	2,246.00	1,347,600	
スタジオアリス	800	1,916.00	1,532,800	
シミックホールディングス	900	1,742.00	1,567,800	
エプコ	300	1,318.00	395,400	
ＮＪＳ	400	1,797.00	718,800	
綜合警備保障	6,400	5,920.00	37,888,000	
カカクコム	12,000	2,920.00	35,040,000	
アイロムグループ	600	1,353.00	811,800	
セントケア・ホールディング	1,100	479.00	526,900	
サイネックス	300	694.00	208,200	
ルネサンス	900	1,718.00	1,546,200	
ディップ	2,300	3,550.00	8,165,000	
オプトホールディング	900	1,512.00	1,360,800	
新日本科学	1,800	647.00	1,164,600	
ツクイ	3,800	587.00	2,230,600	
キャリアデザインセンター	400	1,311.00	524,400	
ベネフィット・ワン	4,400	2,180.00	9,592,000	
エムスリー	35,400	3,170.00	112,218,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,100	579.00	636,900	
ブラス	200	777.00	155,400	
アウトソーシング	9,200	1,037.00	9,540,400	
ウェルネット	1,600	689.00	1,102,400	
ワールドホールディングス	500	1,690.00	845,000	
ディー・エヌ・エー	7,900	1,805.00	14,259,500	
博報堂ＤＹホールディングス	22,300	1,608.00	35,858,400	
ぐるなび	2,800	938.00	2,626,400	
タカミヤ	1,700	654.00	1,111,800	
ジャパンベストレスキューシステム	1,100	1,058.00	1,163,800	
ファンコミュニケーションズ	4,400	448.00	1,971,200	
ライク	600	1,618.00	970,800	
ビジネス・ブレークスルー	700	403.00	282,100	
エスプール	3,100	825.00	2,557,500	
ＷＤＢホールディングス	700	2,716.00	1,901,200	
ティア	1,000	591.00	591,000	
ＣＤＧ	200	1,432.00	286,400	

バリューコマース	900	2,380.00	2,142,000	
インフォマート	17,600	908.00	15,980,800	
ＪＰホールディングス	5,000	319.00	1,595,000	
エコナックホールディングス	3,100	140.00	434,000	
ＥＰＳホールディングス	2,400	1,388.00	3,331,200	
レッグス	400	1,617.00	646,800	
プレステージ・インターナショナル	6,000	955.00	5,730,000	
アミューズ	900	2,932.00	2,638,800	
ドリームインキュベータ	500	1,545.00	772,500	
クイック	1,000	1,592.00	1,592,000	
ＴＡＣ	900	222.00	199,800	
ケネディクス	15,200	554.00	8,420,800	
電通グループ	16,600	3,660.00	60,756,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	1,072.00	643,200	
ぴあ	500	4,505.00	2,252,500	
イオンファンタジー	600	2,361.00	1,416,600	
シーティーエス	1,800	712.00	1,281,600	
ネクシィーズグループ	600	1,735.00	1,041,000	
みらかホールディングス	4,500	2,883.00	12,973,500	
アルプス技研	1,400	1,892.00	2,648,800	
サニックス	2,800	339.00	949,200	
ダイオーズ	300	1,346.00	403,800	
日本空調サービス	1,700	790.00	1,343,000	
オリエンタルランド	17,100	14,500.00	247,950,000	
ダスキン	4,100	3,060.00	12,546,000	
明光ネットワークジャパン	1,900	981.00	1,863,900	
ファルコホールディングス	900	2,047.00	1,842,300	
秀英予備校	300	446.00	133,800	
田谷	300	625.00	187,500	
ラウンドワン	4,500	1,044.00	4,698,000	
リゾートトラスト	7,400	1,730.00	12,802,000	
ビー・エム・エル	2,100	3,055.00	6,415,500	
ワタベウェディング	200	541.00	108,200	
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,478.00	4,286,200	
リソー教育	7,300	348.00	2,540,400	
早稲田アカデミー	500	1,159.00	579,500	
ユー・エス・エス	18,000	1,960.00	35,280,000	
東京個別指導学院	600	718.00	430,800	
サイバーエージェント	9,200	3,820.00	35,144,000	
楽天	74,900	875.00	65,537,500	
クリーク・アンド・リバー社	800	1,041.00	832,800	
テー・オー・ダブリュー	1,400	997.00	1,395,800	

山田コンサルティンググループ	800	1,539.00	1,231,200	
セントラルスポーツ	600	3,090.00	1,854,000	
フルキャストホールディングス	1,600	2,498.00	3,996,800	
エン・ジャパン	2,900	4,375.00	12,687,500	
リソルホールディングス	100	4,145.00	414,500	
テクノプロ・ホールディングス	3,200	7,450.00	23,840,000	
アトラ	300	329.00	98,700	
インターワークス	300	542.00	162,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	5,750.00	4,025,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	600	1,274.00	764,400	
ファーストロジック	400	591.00	236,400	
三機サービス	400	1,047.00	418,800	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,100	1,195.00	1,314,500	
デザインワン・ジャパン	200	323.00	64,600	
イー・ガーディアン	800	1,901.00	1,520,800	
リブセンス	1,000	285.00	285,000	
ジャパンマテリアル	4,900	1,703.00	8,344,700	
ベクトル	2,000	1,139.00	2,278,000	
ウチヤマホールディングス	800	539.00	431,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,200	915.00	1,098,000	
ライクキッズ	400	798.00	319,200	
キャリアリンク	500	618.00	309,000	
ＩＢＪ	1,100	1,308.00	1,438,800	
アサンテ	600	2,005.00	1,203,000	
Ｎ・フィールド	1,200	610.00	732,000	
バリューＨＲ	300	3,130.00	939,000	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,100	4,290.00	4,719,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	2,026.00	1,215,600	
ＥＲＩホールディングス	500	771.00	385,500	
アビスト	200	2,659.00	531,800	
シグマクシス	1,100	2,171.00	2,388,100	
ウィルグループ	1,000	1,169.00	1,169,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	215.00	473,000	
リクルートホールディングス	115,100	4,394.00	505,749,400	
エラン	900	1,694.00	1,524,600	
土木管理総合試験所	700	440.00	308,000	
ネットマーケティング	600	1,017.00	610,200	
日本郵政	131,700	1,006.00	132,490,200	
ベルシステム２４ホールディングス	2,700	1,545.00	4,171,500	
鎌倉新書	1,200	1,668.00	2,001,600	
ＳＭＮ	300	804.00	241,200	
一蔵	200	780.00	156,000	

ＬＩＴＡＬＩＣＯ	600	2,669.00	1,601,400	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	200	755.00	151,000	
エアトリ	700	1,729.00	1,210,300	
アトラエ	400	3,765.00	1,506,000	
ストライク	600	5,380.00	3,228,000	
ソラスト	4,400	1,173.00	5,161,200	
セラク	500	1,320.00	660,000	
インソース	800	3,545.00	2,836,000	
ベイカレント・コンサルティング	1,000	8,100.00	8,100,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	1,277.00	383,100	
アイモバイル	500	699.00	349,500	
キャリアインデックス	600	388.00	232,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	500	1,450.00	725,000	
船場	300	1,069.00	320,700	
グレイステクノロジー	700	2,912.00	2,038,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,700	2,563.00	4,357,100	
フルテック	200	1,320.00	264,000	
グリーンズ	600	979.00	587,400	
ツナググループ・ホールディングス	200	748.00	149,600	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	400	757.00	302,800	
ソウルドアウト	200	2,027.00	405,400	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	200	1,058.00	211,600	
日総工産	1,100	1,047.00	1,151,700	
キュービーネットホールディングス	1,000	2,396.00	2,396,000	
ＲＰＡホールディングス	900	989.00	890,100	
スプリックス	500	1,069.00	534,500	
マネジメントソリューションズ	200	3,265.00	653,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	927.00	741,600	
リログループ	8,800	3,055.00	26,884,000	
東祥	1,000	2,202.00	2,202,000	
エイチ・アイ・エス	2,500	2,548.00	6,370,000	
ラックランド	400	2,184.00	873,600	
共立メンテナンス	2,700	4,345.00	11,731,500	
イチネンホールディングス	1,800	1,559.00	2,806,200	
建設技術研究所	1,100	2,459.00	2,704,900	
スペース	1,000	1,233.00	1,233,000	
長大	600	1,272.00	763,200	
燦ホールディングス	700	1,430.00	1,001,000	
スバル興業	100	10,110.00	1,011,000	
東京テアトル	600	1,371.00	822,600	
タナベ経営	300	1,297.00	389,100	
ナガワ	500	7,390.00	3,695,000	

よみうりランド	300	4,360.00	1,308,000	
東京都競馬	1,100	3,185.00	3,503,500	
常磐興産	600	1,649.00	989,400	
カナモト	2,600	2,736.00	7,113,600	
東京ドーム	6,500	1,053.00	6,844,500	
西尾レントオール	1,600	2,997.00	4,795,200	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	10,900	31.00	337,900	
トランス・コスモス	1,500	2,814.00	4,221,000	
乃村工藝社	6,900	1,285.00	8,866,500	
藤田観光	700	2,678.00	1,874,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,000	1,378.00	1,378,000	
日本管財	1,700	1,949.00	3,313,300	
トーカイ	1,600	2,550.00	4,080,000	
白洋舎	200	2,816.00	563,200	
セコム	17,000	9,755.00	165,835,000	
セントラル警備保障	800	6,000.00	4,800,000	
丹青社	3,000	1,289.00	3,867,000	
メイテック	2,000	6,360.00	12,720,000	
応用地質	1,700	1,411.00	2,398,700	
船井総研ホールディングス	3,300	2,728.00	9,002,400	
進学会ホールディングス	600	518.00	310,800	
オオバ	1,300	832.00	1,081,600	
いであ	300	2,836.00	850,800	
学究社	500	1,425.00	712,500	
ベネッセホールディングス	5,400	3,045.00	16,443,000	
イオンディライト	2,000	3,720.00	7,440,000	
ナック	900	1,032.00	928,800	
ニチイ学館	2,300	1,521.00	3,498,300	
ダイセキ	2,700	2,975.00	8,032,500	
ステップ	600	1,573.00	943,800	
合　計	19,919,029		40,348,833,940	

(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 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	10,181,075,931
コール・ローン	28,300,893
株式	42,429,608,621
投資証券	1,189,796,101
派生商品評価勘定	365,506,885
未収入金	939,240,000
未収配当金	33,787,669
差入委託証拠金	2,150,843,092
流動資産合計	57,318,159,192
資産合計	57,318,159,192
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	12,292,432
未払解約金	2,108,000
未払利息	76
流動負債合計	14,400,508
負債合計	14,400,508
純資産の部	
元本等	
元本	40,465,219,618
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	16,838,539,066
元本等合計	57,303,758,684
純資産合計	57,303,758,684
負債純資産合計	57,318,159,192

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 1月27日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	16,003,677,154円
期中追加設定元本額	37,497,918,027円
期中一部解約元本額	13,036,375,563円
期末元本額	40,465,219,618円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,458,591,769円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	2,676,244,973円
りそなラップ型ファンド（成長型）	3,454,544,460円
ＤＣりそな　グローバルバランス	14,291,150円
つみたてバランスファンド	781,929,363円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	446,451,498円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	213,753,513円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	121,841,499円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	8,929,250円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	5,894,604円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,698,440円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,659,972円
ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	61,782,316円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	64,935,591円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	12,236,655,573円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	1,736,593,921円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	55,438,468円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	151,058,008円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	164,849,855円

りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	1,013,659,711円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	3,091,536,010円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	5,630,824,860円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	3,209,987,244円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	2,347,876,242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）	3,819,977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）	139,187,288円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,370,998,463円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	185,600円
２．　計算日における受益権の総数	
	40,465,219,618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	1.4161円
(10,000口当たり純資産額)	(14,161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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	5,559,650,206
投資証券	117,989,340
合計	5,677,639,546

(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 1月27日現在）　（単位：円）

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

	買建	13,401,904,242	—	13,760,276,187	358,371,945
合計		13,401,904,242	—	13,760,276,187	358,371,945

（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 1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	1,055,692,252	—	1,050,534,760	△5,157,492
	米ドル	721,751,918	—	718,464,560	△3,287,358
	カナダドル	40,856,772	—	40,635,100	△221,672
	ユーロ	122,099,704	—	121,503,000	△596,704
	英ポンド	63,805,261	—	63,411,200	△394,061
	スイスフラン	38,388,517	—	38,212,600	△175,917
	スウェーデンクローナ	9,178,200	—	9,120,000	△58,200
	ノルウェークローネ	2,068,005	—	2,046,800	△21,205
	デンマーククローネ	9,225,531	—	9,177,000	△48,531
	オーストラリアドル	30,720,432	—	30,458,900	△261,532
	ニュージーランドドル	724,940	—	718,100	△6,840
	香港ドル	11,550,180	—	11,496,400	△53,780
	シンガポールドル	4,055,600	—	4,029,500	△26,100
	イスラエルシュケル	1,267,192	—	1,261,600	△5,592
合計		1,055,692,252	—	1,050,534,760	△5,157,492

（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	APACHE CORP	2,974	29.98	89,160.52	
	BAKER HUGHES COMPANY	6,688	22.86	152,887.68	
	CABOT OIL & GAS CORP	4,462	14.64	65,323.68	
	CHENIERE ENERGY INC	2,413	61.15	147,554.95	
	CHEVRON CORP	18,034	111.85	2,017,102.90	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	82.55	148,342.35	
	CONOCOPHILLIPS	10,963	62.62	686,503.06	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	29.46	11,224.26	
	DEVON ENERGY CORP	3,284	23.95	78,651.80	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	82.84	137,265.88	
	EOG RESOURCES INC	5,698	79.85	454,985.30	
	EXXON MOBIL CORP	40,849	66.32	2,709,105.68	
	HALLIBURTON CO	7,683	23.10	177,477.30	
	HESS CORP	2,840	64.41	182,924.40	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	46.53	79,426.71	
	KINDER MORGAN INC	20,081	21.56	432,946.36	
	MARATHON OIL CORP	6,470	11.93	77,187.10	
	MARATHON PETROLEUM CORP	6,558	54.49	357,345.42	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	21.88	66,799.64	

NOBLE ENERGY INC	5,029	21.67	108,978.43	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	8,884	42.22	375,082.48	
ONEOK INC	4,138	74.84	309,687.92	
PHILLIPS 66	4,437	100.32	445,119.84	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,751	142.03	248,694.53	
SCHLUMBERGER LTD	13,564	35.77	485,184.28	
TARGA RESOURCES CORP	1,839	38.68	71,132.52	
TECHNIPFMC PLC	3,213	17.97	57,737.61	
VALERO ENERGY CORP	4,114	89.26	367,215.64	
WILLIAMS COS INC	12,256	22.19	271,960.64	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,136	243.95	521,077.20	
ALBEMARLE CORP	669	81.18	54,309.42	
AMCOR PLC	17,320	10.49	181,686.80	
AVERY DENNISON CORP	757	129.68	98,167.76	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	28.85	48,641.10	
BALL CORP	2,772	71.93	199,389.96	
CELANESE CORP	1,133	114.51	129,739.83	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	40.93	63,646.15	
CORTEVA INC	6,565	27.95	183,491.75	
CROWN HOLDINGS INC	1,469	75.00	110,175.00	
DOW INC	7,349	48.49	356,353.01	
DUPONT DE NEMOURS INC	7,311	59.39	434,200.29	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	73.17	90,950.31	
ECOLAB INC	2,525	198.01	499,975.25	
FMC CORP	1,380	95.68	132,038.40	
FREEPORT-MCMORAN INC	13,013	11.84	154,073.92	
INTERNATIONAL PAPER CO	3,372	43.53	146,783.16	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	909	135.79	123,433.11	
LINDE PLC	5,170	209.99	1,085,648.30	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,702	84.95	229,534.90	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	557	263.89	146,986.73	
MOSAIC CO/THE	3,288	19.14	62,932.32	
NEWMONT CORP	8,135	44.29	360,299.15	
NUCOR CORP	3,180	50.33	160,049.40	
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	105.65	89,591.20	

PPG INDUSTRIES INC	2,351	125.81	295,779.31	
RPM INTERNATIONAL INC	1,390	73.03	101,511.70	
SEALED AIR CORP	1,397	37.03	51,730.91	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	809	594.84	481,225.56	
STEEL DYNAMICS INC	2,352	30.75	72,324.00	
VULCAN MATERIALS CO	1,164	140.52	163,565.28	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	65.97	10,819.08	
WESTROCK CO	2,274	40.94	93,097.56	
3M CO	5,548	178.15	988,376.20	
ACUITY BRANDS INC	445	121.49	54,063.05	
AERCAP HOLDINGS NV	853	60.09	51,256.77	
ALLEGION PLC	839	128.00	107,392.00	
AMETEK INC	1,991	99.57	198,243.87	
ARCONIC INC	3,134	29.11	91,230.74	
BOEING CO/THE	5,202	323.05	1,680,506.10	
CATERPILLAR INC	5,474	140.38	768,440.12	
CUMMINS INC	1,575	169.15	266,411.25	
DEERE & CO	2,917	170.12	496,240.04	
DOVER CORP	1,297	117.11	151,891.67	
EATON CORP PLC	4,146	96.84	401,498.64	
EMERSON ELECTRIC CO	5,983	76.70	458,896.10	
FASTENAL CO	5,025	35.52	178,488.00	
FLOWSERVE CORP	1,171	48.26	56,512.46	
FORTIVE CORP	2,633	76.91	202,504.03	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	69.51	76,739.04	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,389	185.07	442,132.23	
GENERAL ELECTRIC CO	83,141	11.71	973,581.11	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	40.11	61,127.64	
HEICO CORP	242	122.39	29,618.38	
HEICO CORP-CLASS A	819	96.42	78,967.98	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	6,910	177.13	1,223,968.30	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	432	276.47	119,435.04	
IDEX CORP	788	172.14	135,646.32	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,147	176.30	554,816.10	
INGERSOLL-RAND PLC	2,385	130.60	311,481.00	

JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	97.00	104,663.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,200	56.66	124,652.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	32.00	73,600.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	7,843	41.35	324,308.05	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,153	222.98	480,075.94	
LENNOX INTERNATIONAL INC	367	240.97	88,435.99	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,426	432.50	1,049,245.00	
MASCO CORP	3,055	48.55	148,320.25	
MIDDLEBY CORP	299	114.17	34,136.83	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,558	381.64	594,595.12	
OWENS CORNING	860	65.33	56,183.80	
PACCAR INC	3,453	76.79	265,155.87	
PARKER HANNIFIN CORP	1,114	198.28	220,883.92	
PENTAIR PLC	1,289	46.20	59,551.80	
RAYTHEON COMPANY	2,697	231.24	623,654.28	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,038	199.72	207,309.36	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,019	376.84	383,999.96	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	50.30	84,604.60	
SMITH (A.O.) CORP	762	45.43	34,617.66	
SNAP-ON INC	437	165.97	72,528.89	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,077	70.45	75,874.65	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,320	166.48	219,753.60	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	390	361.87	141,129.30	
TEXTRON INC	2,450	44.70	109,515.00	
TRANSDIGM GROUP INC	477	656.73	313,260.21	
UNITED RENTALS INC	621	151.65	94,174.65	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	7,786	153.19	1,192,737.34	
WABCO HOLDINGS INC	536	135.87	72,826.32	
WABTEC CORP	1,937	79.04	153,100.48	
WW GRAINGER INC	490	329.00	161,210.00	
XYLEM INC	1,606	81.48	130,856.88	
CINTAS CORP	937	283.44	265,583.28	
COPART INC	1,839	100.29	184,433.31	
COSTAR GROUP INC	321	650.65	208,858.65	
EQUIFAX INC	966	154.01	148,773.66	

IHS MARKIT LTD	3,294	79.89	263,157.66	
MANPOWERGROUP INC	288	95.25	27,432.00	
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	21.16	57,830.28	
REPUBLIC SERVICES INC	2,301	94.64	217,766.64	
ROBERT HALF INTL INC	673	61.95	41,692.35	
ROLLINS INC	1,190	36.61	43,565.90	
TRANSUNION	1,685	92.88	156,502.80	
VERISK ANALYTICS INC	1,353	165.30	223,650.90	
WASTE CONNECTIONS INC	2,708	98.42	266,521.36	
WASTE MANAGEMENT INC	4,184	121.00	506,264.00	
AMERCO	106	371.27	39,354.62	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	27.64	5,472.72	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	973	79.62	77,470.26	
CSX CORP	7,564	76.70	580,158.80	
DELTA AIR LINES INC	1,316	58.81	77,393.96	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,790	74.34	133,068.60	
FEDEX CORP	2,427	154.07	373,927.89	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	115.71	84,931.14	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,094	166.58	182,238.52	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	37.06	38,690.64	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,634	207.86	547,503.24	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	521	204.47	106,528.87	
SOUTHWEST AIRLINES CO	1,459	56.55	82,506.45	
UBER TECHNOLOGIES INC	1,082	36.80	39,817.60	
UNION PACIFIC CORP	6,759	185.68	1,255,011.12	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	364	81.90	29,811.60	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	6,747	116.66	787,105.02	
XPO LOGISTICS INC	977	91.84	89,727.68	
APTIV PLC	2,746	91.54	251,368.84	
AUTOLIV INC	743	77.35	57,471.05	
BORGWARNER INC	2,199	39.24	86,288.76	
FORD MOTOR CO	38,960	9.00	350,640.00	
GENERAL MOTORS CO	12,516	34.31	429,423.96	
HARLEY-DAVIDSON INC	1,270	35.23	44,742.10	
LEAR CORP	352	133.75	47,080.00	

TESLA INC	1,283	564.82	724,664.06	
CAPRI HOLDINGS LTD	1,619	35.38	57,280.22	
DR HORTON INC	3,205	58.51	187,524.55	
GARMIN LTD	1,217	99.59	121,201.03	
HANESBRANDS INC	4,021	14.25	57,299.25	
HASBRO INC	1,095	104.68	114,624.60	
LEGGETT & PLATT INC	1,466	50.88	74,590.08	
LENNAR CORP-A	2,614	66.64	174,196.96	
LULULEMON ATHLETICA INC	984	240.35	236,504.40	
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	141.86	80,009.04	
NEWELL RUBBERMAID INC	4,193	19.89	83,398.77	
NIKE INC -CL B	11,985	102.03	1,222,829.55	
NVR INC	36	3,983.60	143,409.60	
POLARIS INC	641	91.83	58,863.03	
PULTEGROUP INC	2,237	43.71	97,779.27	
PVH CORP	792	94.95	75,200.40	
RALPH LAUREN CORP	478	116.23	55,557.94	
TAPESTRY INC	2,976	27.29	81,215.04	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	20.99	8,584.91	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,055	18.61	19,633.55	
VF CORP	3,495	84.53	295,432.35	
WHIRLPOOL CORP	686	149.42	102,502.12	
ARAMARK	2,216	46.09	102,135.44	
CARNIVAL CORP	3,704	47.52	176,014.08	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	231	869.71	200,903.01	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	117.09	129,150.27	
DOMINO'S PIZZA INC	290	285.10	82,679.00	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,797	108.49	303,446.53	
LAS VEGAS SANDS CORP	2,934	67.85	199,071.90	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	2,835	141.02	399,791.70	
MCDONALD'S CORP	7,287	211.24	1,539,305.88	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	21.24	23,364.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	31.57	144,843.16	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	1,591	55.84	88,841.44	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	126.51	198,367.68	

STARBUCKS CORP	11,629	92.03	1,070,216.87	
VAIL RESORTS INC	293	243.88	71,456.84	
WYNN RESORTS LTD	1,017	134.75	137,040.75	
YUM! BRANDS INC	3,160	104.98	331,736.80	
ACTIVISION BLIZZARD INC	7,611	59.40	452,093.40	
ALPHABET INC-CL A	2,894	1,466.17	4,243,095.98	
ALPHABET INC-CL C	3,019	1,466.71	4,427,997.49	
ALTICE USA INC- A	872	28.03	24,442.16	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,532	504.67	773,154.44	
COMCAST CORP-CLASS A	43,060	44.59	1,920,045.40	
DISCOVERY INC - A	1,722	30.32	52,211.04	
DISCOVERY INC-C	3,336	28.64	95,559.72	
DISH NETWORK CORP-A	2,183	36.74	80,203.42	
ELECTRONIC ARTS INC	3,020	112.33	339,236.60	
FACEBOOK INC-A	23,195	217.94	5,055,118.30	
FOX CORP - CLASS A	3,760	36.61	137,653.60	
FOX CORP- CLASS B	1,836	36.04	66,169.44	
IAC/INTERACTIVECORP	827	263.36	217,798.72	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	23.41	86,359.49	
LIBERTY BROADBAND-C	1,134	130.17	147,612.78	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	20.51	26,786.06	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	19.41	67,993.23	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	47.23	101,686.19	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	49.49	86,962.71	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	48.89	46,249.94	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	72.02	112,639.28	
MATCH GROUP INC	610	85.57	52,197.70	
NETFLIX INC	4,182	353.16	1,476,915.12	
NEWS CORP - CLASS A	2,810	13.94	39,171.40	
OMNICOM GROUP	1,964	77.70	152,602.80	
PINTEREST INC- CLASS A	1,570	22.44	35,230.80	
ROKU INC	751	130.09	97,697.59	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	15,406	7.11	109,536.66	
SNAP INC - A	6,244	19.05	118,948.20	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,194	125.28	149,584.32	

TRIPADVISOR INC	467	29.74	13,888.58	
TWITTER INC	7,784	33.19	258,350.96	
VIACOMCBS INC - CLASS B	4,599	35.79	164,598.21	
WALT DISNEY CO/THE	17,399	140.08	2,437,251.92	
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	48.44	68,203.52	
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	141.68	83,166.16	
AMAZON.COM INC	4,041	1,861.64	7,522,887.24	
AUTOZONE INC	214	1,140.23	244,009.22	
BEST BUY CO INC	2,167	89.44	193,816.48	
BOOKING HOLDINGS INC	415	1,962.96	814,628.40	
BURLINGTON STORES INC	580	220.74	128,029.20	
CARMAX INC	1,734	96.73	167,729.82	
DOLLAR GENERAL CORP	2,530	154.34	390,480.20	
DOLLAR TREE INC	2,390	87.71	209,626.90	
EBAY INC	8,264	35.36	292,215.04	
EXPEDIA GROUP INC	1,470	112.14	164,845.80	
GAP INC/THE	2,396	17.66	42,313.36	
GENUINE PARTS CO	1,255	98.07	123,077.85	
GRUBHUB INC	988	58.57	57,867.16	
HOME DEPOT INC	10,388	232.00	2,410,016.00	
KOHLS CORP	1,564	45.49	71,146.36	
LKQ CORP	2,845	33.61	95,620.45	
LOWE'S COS INC	7,598	120.23	913,507.54	
MERCADOLIBRE INC	468	660.58	309,151.44	
NORDSTROM INC	1,281	38.67	49,536.27	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	774	430.77	333,415.98	
ROSS STORES INC	3,602	115.76	416,967.52	
TARGET CORP	4,939	114.32	564,626.48	
TIFFANY & CO	1,146	134.29	153,896.34	
TJX COMPANIES INC	11,659	61.19	713,414.21	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,093	93.57	102,272.01	
ULTA BEAUTY INC	498	272.98	135,944.04	
WAYFAIR INC- CLASS A	341	106.74	36,398.34	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,204	310.51	1,305,384.04	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	5.40	540.00	

KROGER CO	7,202	28.19	203,024.38	
SYSCO CORP	4,854	82.63	401,086.02	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	7,653	52.04	398,262.12	
WALMART INC	13,652	114.37	1,561,379.24	
ALTRIA GROUP INC	17,753	50.25	892,088.25	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	4,846	44.30	214,677.80	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,048	71.79	218,815.92	
BUNGE LTD	1,423	54.32	77,297.36	
CAMPBELL SOUP CO	1,739	48.79	84,845.81	
COCA-COLA CO/THE	39,225	57.68	2,262,498.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,132	53.12	113,251.84	
CONAGRA BRANDS INC	3,745	32.28	120,888.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,697	191.56	325,077.32	
GENERAL MILLS INC	6,121	53.71	328,758.91	
HERSHEY CO/THE	1,287	154.68	199,073.16	
HORMEL FOODS CORP	2,963	47.23	139,942.49	
INGREDION INC	744	92.26	68,641.44	
JM SMUCKER CO/THE	1,011	107.67	108,854.37	
KELLOGG CO	2,259	69.34	156,639.06	
KRAFT HEINZ CO/THE	6,634	30.41	201,739.94	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	90.69	117,897.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,212	172.67	209,276.04	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	56.12	82,103.56	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	13,703	55.09	754,898.27	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,007	67.10	268,869.70	
PEPSICO INC	13,215	142.91	1,888,621.72	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	14,706	86.15	1,266,921.90	
TYSON FOODS INC-CL A	2,541	85.93	218,348.13	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,420	71.31	172,570.20	
CLOROX COMPANY	1,326	158.28	209,879.28	
COLGATE-PALMOLIVE CO	7,768	70.30	546,090.40	
COTY INC-CL A	2,506	10.54	26,413.24	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,098	205.34	430,803.32	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,284	143.42	470,991.28	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	24,161	125.14	3,023,507.54	

ABBOTT LABORATORIES	16,786	90.40	1,517,454.40	
ABIOMED INC	526	182.98	96,247.48	
ALIGN TECHNOLOGY INC	758	269.98	204,644.84	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,599	88.92	142,183.08	
ANTHEM INC	2,451	297.28	728,633.28	
BAXTER INTERNATIONAL INC	4,690	90.78	425,758.20	
BECTON DICKINSON AND CO	2,577	278.25	717,050.25	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	13,316	43.21	575,384.36	
CARDINAL HEALTH INC	3,013	53.82	162,159.66	
CENTENE CORP	5,889	66.61	392,266.29	
CERNER CORP	2,794	74.46	208,041.24	
CIGNA CORP	3,616	206.01	744,932.16	
COOPER COS INC/THE	433	352.36	152,571.88	
CVS HEALTH CORP	12,334	71.43	881,017.62	
DANAHER CORP	6,122	162.25	993,294.50	
DAVITA INC	908	83.19	75,536.52	
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	59.66	122,183.68	
DEXCOM INC	908	233.94	212,417.52	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,003	230.45	461,591.35	
HCA HEALTHCARE INC	2,653	143.45	380,572.85	
HENRY SCHEIN INC	1,305	71.20	92,916.00	
HOLOGIC INC	2,830	53.72	152,027.60	
HUMANA INC	1,301	356.90	464,326.90	
IDEXX LABORATORIES INC	917	280.77	257,466.09	
INSULET CORP	650	192.56	125,164.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,103	589.20	649,887.60	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	994	177.18	176,116.92	
MCKESSON CORP	1,937	152.62	295,624.94	
MEDTRONIC PLC	13,090	119.26	1,561,113.40	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,176	107.79	126,761.04	
RESMED INC	1,425	162.39	231,405.75	
STERIS PLC	740	151.29	111,954.60	
STRYKER CORP	3,212	214.23	688,106.76	
TELEFLEX INC	404	380.02	153,528.08	
UNITEDHEALTH GROUP INC	9,178	292.81	2,687,410.18	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	147.26	96,160.78	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	716	148.29	106,175.64	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,277	145.19	185,407.63	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	780	155.75	121,485.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,004	147.80	296,191.20	
ABBVIE INC	14,069	83.54	1,175,324.26	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,714	88.26	239,537.64	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,213	105.27	232,962.51	
ALLERGAN PLC	3,137	188.19	590,352.03	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,123	120.00	134,760.00	
AMGEN INC	5,768	225.59	1,301,203.12	
BEIGENE LTD-ADR	500	163.56	81,780.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	230	369.97	85,093.10	
BIOGEN INC	1,859	278.14	517,062.26	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,903	86.15	163,943.45	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22,201	64.16	1,424,416.16	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	2,430	31.57	76,715.10	
ELI LILLY & CO	8,292	139.07	1,153,168.44	
EXACT SCIENCES CORP	1,138	89.57	101,930.66	
GILEAD SCIENCES INC	12,101	63.15	764,178.15	
ILLUMINA INC	1,416	319.58	452,525.28	
INCYTE CORP	1,948	76.74	149,489.52	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,483	59.42	88,119.86	
IQVIA HOLDINGS INC	1,437	158.10	227,189.70	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	575	145.74	83,800.50	
JOHNSON & JOHNSON	25,444	148.32	3,773,854.08	
MERCK & CO. INC.	24,814	85.98	2,133,507.72	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	249	819.95	204,167.55	
MYLAN NV	4,542	21.85	99,242.70	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	930	99.17	92,228.10	
PERKINELMER INC	1,125	99.78	112,252.50	
PERRIGO CO PLC	998	58.76	58,642.48	
PFIZER INC	53,643	39.82	2,136,064.26	
REGENERON PHARMACEUTICALS	855	345.28	295,214.40	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	791	112.39	88,900.49	

SEATTLE GENETICS INC	1,145	113.57	130,037.65	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,561	10.10	96,566.10	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	3,787	333.68	1,263,646.16	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,456	229.06	562,571.36	
WATERS CORP	535	237.53	127,078.55	
ZOETIS INC	4,586	136.31	625,117.66	
BANK OF AMERICA CORP	84,974	33.54	2,850,027.96	
CITIGROUP INC	21,819	78.42	1,711,045.98	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	39.13	141,650.60	
COMERICA INC	1,325	64.73	85,767.25	
EAST WEST BANCORP INC	1,540	49.23	75,814.20	
FIFTH THIRD BANCORP	7,261	28.84	209,407.24	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,674	113.75	190,417.50	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	13.72	123,370.24	
JPMORGAN CHASE & CO	30,480	133.15	4,058,412.00	
KEYCORP	8,597	19.29	165,836.13	
M & T BANK CORP	1,286	171.49	220,536.14	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	15.85	54,254.55	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,304	150.38	647,235.52	
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	15.72	136,371.00	
SIGNATURE BANK	590	145.80	86,022.00	
SVB FINANCIAL GROUP	416	252.66	105,106.56	
TRUIST FINANCIAL CORP	12,977	55.48	719,963.96	
US BANCORP	14,362	53.84	773,250.08	
WELLS FARGO & CO	40,213	47.57	1,912,932.41	
ZIONS BANCORPORATION	1,842	46.63	85,892.46	
ALLY FINANCIAL INC	3,571	32.14	114,771.94	
AMERICAN EXPRESS CO	6,840	135.11	924,152.40	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,113	167.57	186,505.41	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,531	45.95	391,999.45	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	12,710	226.86	2,883,390.60	
BLACKROCK INC	1,139	536.84	611,460.76	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	6,800	62.21	423,028.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,632	104.30	483,117.60	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,220	119.81	146,168.20	

CME GROUP INC	3,467	209.24	725,435.08	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	76.29	213,612.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	45.63	88,659.09	
EATON VANCE CORP	1,192	46.71	55,678.32	
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,443	24.98	110,986.14	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	276.56	95,136.64	
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	25.26	69,161.88	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,198	241.92	773,660.16	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,520	97.11	536,047.20	
INVESCO LTD	2,612	18.17	47,460.04	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,716	21.89	59,453.24	
KKR & CO INC -A	4,300	30.69	131,967.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	339	359.27	121,792.53	
MOODY'S CORP	1,709	255.62	436,854.58	
MORGAN STANLEY	12,326	54.55	672,383.30	
MSCI INC	709	276.11	195,761.99	
NASDAQ INC	1,056	110.21	116,381.76	
NORTHERN TRUST CORP	2,155	101.62	218,991.10	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	90.42	95,212.26	
S&P GLOBAL INC	2,399	294.83	707,297.17	
SCHWAB (CHARLES) CORP	11,839	47.15	558,208.85	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,314	63.71	83,714.94	
STATE STREET CORP	3,261	78.34	255,466.74	
SYNCHRONY FINANCIAL	5,445	32.63	177,670.35	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,440	131.18	320,079.20	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,487	49.32	122,658.84	
VOYA FINANCIAL INC	845	61.47	51,942.15	
AFLAC INC	7,299	52.39	382,394.61	
ALLEGHANY CORP	153	804.85	123,142.05	
ALLSTATE CORP	3,237	118.28	382,872.36	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	110.49	85,740.24	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	8,391	51.06	428,444.46	
AON PLC	2,353	213.42	502,177.26	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,543	44.99	159,399.57	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,873	96.86	181,418.78	

ASSURANT INC	506	129.18	65,365.08	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	44.63	56,680.10	
BROWN & BROWN INC	2,556	41.83	106,917.48	
CHUBB LTD	4,418	152.01	671,580.18	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,571	106.01	166,549.56	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	167.32	24,428.72	
EVEREST RE GROUP LTD	313	277.35	86,810.55	
FNF GROUP	2,799	48.30	135,191.70	
GLOBE LIFE INC	921	104.79	96,511.59	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,122	58.98	184,135.56	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	56.55	116,493.00	
LOEWS CORP	2,419	51.35	124,215.65	
MARKEL CORP	141	1,188.38	167,561.58	
MARSH & MCLENNAN COS	4,991	113.87	568,325.17	
METLIFE INC	7,927	51.27	406,417.29	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	54.36	133,127.64	
PROGRESSIVE CORP	5,771	76.75	442,924.25	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	3,987	93.52	372,864.24	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	155.21	72,948.70	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	357	190.09	67,862.13	
TRAVELERS COS INC/THE	2,614	134.78	352,314.92	
UNUM GROUP	1,141	28.10	32,062.10	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,307	209.01	273,176.07	
WR BERKLEY CORP	1,291	72.07	93,042.37	
CBRE GROUP INC - A	2,702	60.77	164,200.54	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,000	5.57	72,410.00	
JONES LANG LASALLE INC	468	169.46	79,307.28	
ACCENTURE PLC-CL A	6,093	208.57	1,270,817.01	
ADOBE INC	4,638	351.37	1,629,654.06	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,691	95.52	161,524.32	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	259	107.40	27,816.60	
ANSYS INC	731	277.34	202,735.54	
AUTODESK INC	2,179	199.19	434,035.01	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,210	177.21	746,054.10	
BLACK KNIGHT INC	1,600	65.91	105,456.00	

BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,500	77.96	116,940.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,021	131.03	133,781.63	
CADENCE DESIGN SYS INC	2,442	74.58	182,124.36	
CDK GLOBAL INC	1,236	54.51	67,374.36	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,040	115.48	120,099.20	
CITRIX SYSTEMS INC	1,337	128.26	171,483.62	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,640	62.42	352,048.80	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	547	140.41	76,804.27	
DOCUSIGN INC	1,080	74.18	80,114.40	
DROPBOX INC-CLASS A	1,047	17.34	18,154.98	
DXC TECHNOLOGY CO	2,725	34.48	93,958.00	
EPAM SYSTEMS INC	480	227.57	109,233.60	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	5,905	147.92	873,467.60	
FISERV INC	5,506	120.84	665,345.04	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	917	320.63	294,017.71	
FORTINET INC	1,474	117.99	173,917.26	
GARTNER INC	792	160.57	127,171.44	
GLOBAL PAYMENTS INC	2,910	198.77	578,420.70	
GODADDY INC - CLASS A	1,543	71.29	110,000.47	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	880	111.81	98,392.80	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	8,443	140.56	1,186,748.08	
INTUIT INC	2,474	288.08	712,709.92	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	784	151.25	118,580.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,229	101.62	124,890.98	
MASTERCARD INC-CLASS A	8,739	323.67	2,828,552.13	
MICROSOFT CORP	69,685	165.04	11,500,812.40	
MONGODB INC	444	152.11	67,536.84	
NORTONLIFELOCK INC	6,279	28.07	176,251.53	
OKTA INC	956	129.66	123,954.96	
ORACLE CORP	22,635	54.07	1,223,874.45	
PALO ALTO NETWORKS INC	829	242.90	201,364.10	
PAYCHEX INC	3,176	88.91	282,378.16	
PAYCOM SOFTWARE INC	437	314.81	137,571.97	
PAYPAL HOLDINGS INC	10,577	116.98	1,237,297.46	
PTC INC	1,110	86.05	95,515.50	

RINGCENTRAL INC-CLASS A	770	197.34	151,951.80	
SABRE CORP	2,780	22.67	63,036.50	
SALESFORCE.COM INC	7,866	182.11	1,432,477.26	
SERVICENOW INC	1,774	309.39	548,857.86	
SPLUNK INC	1,310	157.00	205,670.00	
SQUARE INC - A	3,596	71.14	255,819.44	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	65.45	130,965.45	
SYNOPSYS INC	1,297	154.05	199,802.85	
TWILIO INC - A	1,132	121.38	137,402.16	
TYLER TECHNOLOGIES INC	410	309.90	127,059.00	
VERISIGN INC	927	212.75	197,219.25	
VISA INC-CLASS A SHARES	16,661	205.00	3,415,505.00	
VMWARE INC-CLASS A	730	150.63	109,959.90	
WESTERN UNION CO	3,785	27.10	102,573.50	
WIX.COM LTD	437	141.03	61,630.11	
WORKDAY INC-CLASS A	1,681	186.07	312,783.67	
AMPHENOL CORP-CL A	2,939	105.36	309,653.04	
APPLE INC	43,411	318.31	13,818,155.41	
ARISTA NETWORKS INC	478	238.05	113,787.90	
ARROW ELECTRONICS INC	902	81.52	73,531.04	
CDW CORP/DE	1,294	137.92	178,468.48	
CISCO SYSTEMS INC	40,568	48.85	1,981,746.80	
COGNEX CORP	1,763	57.73	101,777.99	
CORNING INC	6,803	29.36	199,736.08	
DELL TECHNOLOGIES -C	1,389	49.98	69,422.22	
F5 NETWORKS INC	613	135.82	83,257.66	
FLEX LTD	4,584	13.46	61,723.56	
FLIR SYSTEMS INC	1,041	54.29	56,515.89	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	11,709	14.76	172,824.84	
HP INC	14,962	21.98	328,864.76	
IPG PHOTONICS CORP	405	144.33	58,453.65	
JUNIPER NETWORKS INC	3,271	24.58	80,401.18	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,002	102.98	206,165.96	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,630	179.66	292,845.80	
NETAPP INC	2,203	59.81	131,761.43	

SEAGATE TECHNOLOGY	2,560	63.23	161,868.80	
TE CONNECTIVITY LTD	3,312	98.40	325,900.80	
TRIMBLE INC	2,244	44.08	98,915.52	
WESTERN DIGITAL CORP	3,193	69.52	221,977.36	
XEROX HOLDINGS CORP	2,113	35.52	75,053.76	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	481	252.70	121,548.70	
AT&T INC	70,632	38.50	2,719,332.00	
CENTURYLINK INC	10,298	14.71	151,483.58	
SPRINT CORP	4,378	4.83	21,145.74	
T-MOBILE US INC	3,430	81.58	279,819.40	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	40,015	60.28	2,412,104.20	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,826	34.78	63,508.28	
AES CORP	4,924	20.38	100,351.12	
ALLIANT ENERGY CORP	2,420	58.93	142,610.60	
AMEREN CORPORATION	2,557	80.39	205,557.23	
AMERICAN ELECTRIC POWER	4,773	102.16	487,609.68	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,575	135.78	213,853.50	
AQUA AMERICA INC	2,300	51.86	119,278.00	
ATMOS ENERGY CORP	921	117.38	108,106.98	
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	26.46	104,569.92	
CMS ENERGY CORP	2,881	67.49	194,438.69	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,461	93.61	323,984.21	
DOMINION ENERGY INC	7,683	84.00	645,372.00	
DTE ENERGY COMPANY	1,855	132.76	246,269.80	
DUKE ENERGY CORP	6,979	96.28	671,938.12	
EDISON INTERNATIONAL	3,602	76.92	277,065.84	
ENTERGY CORP	2,089	130.73	273,094.97	
EVERGY INC	2,180	71.37	155,586.60	
EVERSOURCE ENERGY	3,272	91.81	300,402.32	
EXELON CORP	9,399	47.73	448,614.27	
FIRSTENERGY CORP	5,462	50.47	275,667.14	
NEXTERA ENERGY INC	4,545	263.72	1,198,607.40	
NISOURCE INC	2,749	29.08	79,940.92	
NRG ENERGY INC	2,735	37.96	103,820.60	
OGE ENERGY CORP	2,132	45.52	97,048.64	

	PINNACLE WEST CAPITAL	828	97.12	80,415.36	
	PPL CORP	7,350	36.53	268,495.50	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,130	61.66	316,315.80	
	SEMPRA ENERGY	2,664	159.76	425,600.64	
	SOUTHERN CO/THE	9,965	69.44	691,969.60	
	UGI CORP	1,566	43.58	68,246.28	
	VISTRA ENERGY CORP	2,849	22.17	63,162.33	
	WEC ENERGY GROUP INC	3,247	98.96	321,323.12	
	XCEL ENERGY INC	5,255	67.17	352,978.35	
	ADVANCED MICRO DEVICES	10,120	50.35	509,542.00	
	ANALOG DEVICES INC	3,550	117.57	417,373.50	
	APPLIED MATERIALS INC	8,927	62.00	553,474.00	
	BROADCOM INC	3,889	324.00	1,260,036.00	
	INTEL CORP	42,106	68.47	2,882,997.82	
	KLA CORP	1,635	179.40	293,319.00	
	LAM RESEARCH CORP	1,439	306.54	441,111.06	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	5,363	27.31	146,463.53	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,332	62.56	145,889.92	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,513	107.22	269,443.86	
	MICRON TECHNOLOGY INC	10,573	57.76	610,696.48	
	NVIDIA CORP	5,465	250.48	1,368,873.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,801	135.28	378,919.28	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	24.99	79,943.01	
	QORVO INC	1,187	113.39	134,593.93	
	QUALCOMM INC	11,499	89.65	1,030,885.35	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,715	122.31	209,761.65	
	TERADYNE INC	1,820	72.10	131,222.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	8,870	130.52	1,157,712.40	
	XILINX INC	2,482	100.80	250,185.60	
米ドル 小計		2,856,817		269,479,498.86 (29,389,434,145)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	11.05	27,227.20	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	12,036	39.78	478,792.08	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	11.53	119,185.61	
	ENBRIDGE INC	19,566	53.96	1,055,781.36	

ENCANA CORP	8,507	4.96	42,194.72	
HUSKY ENERGY INC	1,391	9.15	12,727.65	
IMPERIAL OIL LTD	2,877	33.58	96,609.66	
INTER PIPELINE LTD	3,471	22.30	77,403.30	
KEYERA CORP	2,259	35.00	79,065.00	
PARKLAND FUEL CORP	1,790	46.32	82,912.80	
PEMBINA PIPELINE CORP	4,689	50.84	238,388.76	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	14.88	7,692.96	
SUNCOR ENERGY INC	15,448	42.48	656,231.04	
TC ENERGY CORP	9,133	72.32	660,498.56	
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,566	81.45	209,000.70	
BARRICK GOLD CORP	17,954	24.60	441,668.40	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	57.14	95,595.22	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	12.04	51,615.48	
FRANCO-NEVADA CORP	1,646	145.01	238,686.46	
KINROSS GOLD CORP	10,281	6.46	66,415.26	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,324	56.64	131,631.36	
LUNDIN MINING CORP	7,300	7.32	53,436.00	
METHANEX CORP	131	49.63	6,501.53	
NUTRIEN LTD	5,955	58.17	346,402.35	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,095	19.00	115,805.00	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	57.67	19,319.45	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,359	39.06	170,262.54	
BOMBARDIER INC-B	8,071	1.22	9,846.62	
CAE INC	3,196	39.03	124,739.88	
WSP GLOBAL INC	1,265	94.11	119,049.15	
THOMSON REUTERS CORP	1,932	104.06	201,043.92	
AIR CANADA	840	47.18	39,631.20	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	6,986	124.31	868,429.66	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,397	343.48	479,841.56	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,323	69.53	231,048.19	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	39.24	70,632.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	2,857	84.41	241,159.37	
STARS GROUP INC/THE	2,811	32.34	90,907.74	
QUEBECOR INC -CL B	1,274	33.31	42,436.94	

SHAW COMMUNICATIONS INC-B	3,836	26.06	99,966.16	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	144.92	72,460.00	
DOLLARAMA INC	3,427	46.57	159,595.39	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,787	44.00	386,628.00	
EMPIRE CO LTD 'A'	864	31.13	26,896.32	
LOBLAW COMPANIES LTD	1,439	68.93	99,190.27	
METRO INC	2,618	54.45	142,550.10	
WESTON (GEORGE) LTD	817	107.08	87,484.36	
SAPUTO INC	2,462	40.04	98,578.48	
AURORA CANNABIS INC	4,385	2.60	11,401.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	37.30	122,232.10	
CANOPY GROWTH CORP	1,137	29.76	33,837.12	
CRONOS GROUP INC	1,000	9.99	9,990.00	
BANK OF MONTREAL	6,195	104.02	644,403.90	
BANK OF NOVA SCOTIA	11,730	73.34	860,278.20	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,352	108.95	474,150.40	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,581	73.79	264,241.99	
ROYAL BANK OF CANADA	13,639	105.77	1,442,597.03	
TORONTO-DOMINION BANK	17,409	74.20	1,291,747.80	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	8,688	81.98	712,242.24	
CI FINANCIAL CORP	775	23.17	17,956.75	
IGM FINANCIAL INC	81	39.12	3,168.72	
ONEX CORPORATION	908	86.92	78,923.36	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	253	598.47	151,412.91	
GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	34.40	63,502.40	
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	73.25	91,855.50	
INTACT FINANCIAL CORP	1,310	142.29	186,399.90	
MANULIFE FINANCIAL CORP	19,343	27.14	524,969.02	
POWER CORP OF CANADA	3,492	34.09	119,042.28	
POWER FINANCIAL CORP	2,751	35.36	97,275.36	
SUN LIFE FINANCIAL INC	5,940	63.50	377,190.00	
BLACKBERRY LTD	1,407	8.68	12,212.76	
CGI INC	2,082	113.29	235,869.78	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	182	1,394.90	253,871.80	
OPEN TEXT CORP	2,603	60.96	158,678.88	

	SHOPIFY INC - CLASS A	985	611.84	602,662.40	
	BCE INC	1,698	62.44	106,023.12	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	3,406	66.12	225,204.72	
	TELUS CORP	320	52.32	16,742.40	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	6,200	19.84	123,008.00	
	ALTAGAS LTD	2,930	20.37	59,684.10	
	ATCO LTD -CLASS I	863	51.86	44,755.18	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	40.25	39,726.75	
	EMERA INC	2,389	60.44	144,391.16	
	FORTIS INC	3,685	58.19	214,430.15	
	HYDRO ONE LTD	3,481	26.55	92,420.55	
カナダドル 小計		366,457		19,181,665.49 (1,590,927,335)	
ユーロ	ENI SPA	25,126	13.47	338,447.22	
	GALP ENERGIA SGPS SA	4,618	14.11	65,183.07	
	NESTE OYJ	3,878	34.27	132,899.06	
	OMV AG	1,475	47.17	69,575.75	
	REPSOL SA	12,998	13.10	170,273.80	
	TENARIS SA	5,062	10.23	51,809.57	
	TOTAL SA	22,816	47.38	1,081,136.16	
	VOPAK	762	48.66	37,078.92	
	AIR LIQUIDE SA	4,619	130.60	603,241.40	
	AKZO NOBEL	2,036	88.04	179,249.44	
	ARCELORMITTAL	7,467	14.10	105,284.70	
	ARKEMA	810	85.96	69,627.60	
	BASF SE	8,946	63.70	569,860.20	
	COVESTRO AG	1,966	39.71	78,069.86	
	CRH PLC	7,290	34.99	255,077.10	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	26.00	46,618.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	41.90	2,346.40	
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	65.08	89,940.56	
	KONINKLIJKE DSM NV	1,614	112.90	182,220.60	
	LANXESS AG	745	55.26	41,168.70	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	32.60	74,523.60	
	SOLVAY SA	860	95.00	81,700.00	

STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	11.95	67,087.30	
SYMRISE AG	1,247	92.92	115,871.24	
THYSSENKRUPP AG	2,040	11.25	22,960.20	
UMICORE	2,263	42.90	97,082.70	
UPM-KYMMENE OYJ	4,811	29.22	140,577.42	
VOESTALPINE AG	712	23.36	16,632.32	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	31.93	91,798.75	
AIRBUS SE	5,630	139.00	782,570.00	
ALSTOM	1,911	47.12	90,046.32	
ANDRITZ AG	352	37.58	13,228.16	
BOUYGUES SA	1,779	38.08	67,744.32	
BRENNTAG AG	1,535	47.85	73,449.75	
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	9.60	92,064.00	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,270	35.21	185,556.70	
DASSAULT AVIATION SA	11	1,117.00	12,287.00	
EIFFAGE	782	104.85	81,992.70	
FERROVIAL SA	5,159	29.60	152,706.40	
GEA GROUP AG	1,676	28.39	47,581.64	
HOCHTIEF AG	17	109.70	1,864.90	
KINGSPAN GROUP PLC	1,730	57.50	99,475.00	
KION GROUP AG	740	58.30	43,142.00	
KNORR-BREMSE AG	297	99.36	29,509.92	
KONE OYJ-B	3,591	59.50	213,664.50	
LEGRAND SA	2,388	73.40	175,279.20	
LEONARDO SPA	3,148	11.17	35,178.90	
METSO OYJ	751	34.97	26,262.47	
MTU AERO ENGINES AG	522	286.00	149,292.00	
PRYSMIAN SPA	1,283	21.20	27,199.60	
SAFRAN SA	3,201	147.00	470,547.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,378	94.22	506,715.16	
SIEMENS AG-REG	7,372	117.64	867,242.08	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	400	15.61	6,246.00	
THALES SA	1,208	98.70	119,229.60	
VINCI SA	4,974	102.40	509,337.60	
WARTSILA OYJ ABP	2,705	11.03	29,849.67	

BUREAU VERITAS SA	3,496	25.52	89,217.92	
EDENRED	2,300	48.48	111,504.00	
RANDSTAD NV	1,305	54.26	70,809.30	
TELEPERFORMANCE	644	232.00	149,408.00	
WOLTERS KLUWER	2,888	69.58	200,947.04	
ADP	314	171.10	53,725.40	
AENA SME SA	718	168.50	120,983.00	
ATLANTIA SPA	5,155	21.36	110,110.80	
BOLLORE	3,240	3.71	12,026.88	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	14.53	20,443.71	
DEUTSCHE POST AG-REG	9,978	33.19	331,219.71	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	69.70	26,834.50	
GETLINK	4,655	15.82	73,642.10	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,974	68.96	205,087.04	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	53.75	33,271.25	
CONTINENTAL AG	1,037	103.20	107,018.40	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	8,964	43.87	393,295.50	
FAURECIA	800	43.18	34,544.00	
FERRARI NV	1,274	157.00	200,018.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	9,665	12.14	117,352.43	
MICHELIN (CGDE)	1,535	106.70	163,784.50	
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	23.24	9,830.52	
PEUGEOT SA	5,130	19.27	98,855.10	
PIRELLI & C SPA	1,734	4.78	8,304.12	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,723	66.48	114,545.04	
RENAULT SA	1,817	36.27	65,902.59	
VALEO SA	2,418	28.56	69,058.08	
VOLKSWAGEN AG	194	174.95	33,940.30	
VOLKSWAGEN AG-PREF	1,863	176.60	329,005.80	
ADIDAS AG	1,783	313.05	558,168.15	
ESSILORLUXOTTICA	2,808	139.00	390,312.00	
HERMES INTERNATIONAL	325	711.00	231,075.00	
KERING	743	573.30	425,961.90	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,648	416.30	1,102,362.40	
MONCLER SPA	2,163	40.55	87,709.65	

PUMA SE	750	78.20	58,650.00	
SEB SA	151	129.00	19,479.00	
ACCOR SA	1,867	38.18	71,282.06	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	901	105.30	94,875.30	
SODEXO	1,030	98.30	101,249.00	
ALTICE EUROPE NV	7,300	6.14	44,880.40	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	14.45	5,910.05	
JC DECAUX SA	60	25.32	1,519.20	
PUBLICIS GROUPE	1,962	41.30	81,030.60	
SES	2,232	12.75	28,458.00	
TELENET GROUP HOLDING NV	192	40.94	7,860.48	
UBISOFT ENTERTAINMENT	860	66.00	56,760.00	
VIVENDI	8,098	24.83	201,073.34	
DELIVERY HERO SE	1,124	68.84	77,376.16	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	10,800	31.14	336,312.00	
PROSUS NV	4,810	68.04	327,272.40	
ZALANDO SE	800	45.94	36,752.00	
CARREFOUR SA	6,545	15.29	100,073.05	
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	36.54	22,837.50	
COLRUYT SA	290	45.28	13,131.20	
JERONIMO MARTINS	2,258	15.81	35,710.27	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	11,576	22.44	259,823.32	
METRO AG	1,970	12.85	25,314.50	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	7,452	70.71	526,930.92	
DANONE	6,048	74.10	448,156.80	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,500	8.72	30,520.00	
HEINEKEN HOLDING NV	1,177	91.40	107,577.80	
HEINEKEN NV	2,526	100.50	253,863.00	
KERRY GROUP PLC-A	1,336	117.80	157,380.80	
PERNOD RICARD SA	2,112	164.20	346,790.40	
REMY COINTREAU	18	98.95	1,781.10	
BEIERSDORF AG	1,070	106.55	114,008.50	
HENKEL AG & CO KGAA	966	87.50	84,525.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,842	95.84	176,537.28	
L'OREAL	2,449	270.50	662,454.50	

UNILEVER NV	13,786	51.86	714,941.96	
BIOMERIEUX	110	89.00	9,790.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	120.20	29,449.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	1,986	72.08	143,150.88	
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,728	49.15	183,231.20	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,927	45.61	407,160.47	
SARTORIUS AG-VORZUG	339	219.00	74,241.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	44.94	70,249.03	
BAYER AG-REG	9,071	75.35	683,499.85	
EUROFINS SCIENTIFIC	127	479.40	60,883.80	
GALAPAGOS NV	510	213.00	108,630.00	
GRIFOLS SA	2,882	31.16	89,803.12	
IPSEN	158	64.05	10,119.90	
MERCK KGAA	1,207	120.00	144,840.00	
ORION OYJ-CLASS B	1,261	43.38	54,702.18	
QIAGEN N.V.	2,180	31.40	68,452.00	
RECORDATI SPA	830	40.29	33,440.70	
SANOFI	10,784	89.11	960,962.24	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	163.10	48,603.80	
UCB SA	1,046	82.20	85,981.20	
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	15.79	60,096.74	
AIB GROUP PLC	2,000	2.69	5,380.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	66,716	4.60	307,360.61	
BANCO DE SABADELL SA	55,157	0.96	53,171.34	
BANCO SANTANDER SA	163,676	3.54	579,413.04	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,400	4.56	47,444.80	
BANKIA SA	1,600	1.68	2,701.60	
BANKINTER SA	2,829	5.94	16,815.57	
BNP PARIBAS	10,925	49.91	545,266.75	
CAIXABANK S.A	35,123	2.65	93,181.31	
COMMERZBANK AG	5,632	5.13	28,920.32	
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	12.57	127,711.70	
ERSTE GROUP BANK AG	3,374	33.80	114,041.20	
FINECOBANK SPA	6,723	10.98	73,852.15	
ING GROEP NV-CVA	37,414	10.22	382,371.08	

INTESA SANPAOLO	144,520	2.27	329,216.56	
KBC GROEP NV	2,188	68.32	149,484.16	
MEDIOBANCA SPA	6,857	9.56	65,566.63	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	21.10	25,657.60	
SOCIETE GENERALE SA	8,630	30.19	260,539.70	
UNICREDIT SPA	20,509	12.44	255,213.99	
AMUNDI SA	618	74.00	45,732.00	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	20,858	7.75	161,691.21	
DEUTSCHE BOERSE AG	1,937	150.10	290,743.70	
EURAZEO	403	62.45	25,167.35	
EXOR NV	1,164	73.50	85,554.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	824	95.46	78,659.04	
NATIXIS	3,105	3.92	12,187.12	
WENDEL	294	123.10	36,191.40	
AEGON NV	16,557	3.85	63,744.45	
AGEAS	1,697	51.50	87,395.50	
ALLIANZ SE-REG	4,075	220.55	898,741.25	
ASSICURAZIONI GENERALI	9,850	18.14	178,679.00	
AXA SA	18,933	24.31	460,261.23	
CNP ASSURANCES	1,015	17.05	17,305.75	
HANNOVER RUECK SE	485	179.00	86,815.00	
MAPFRE SA	942	2.39	2,251.38	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,436	272.50	391,310.00	
NN GROUP NV	2,804	32.43	90,933.72	
POSTE ITALIANE SPA	5,374	10.58	56,883.79	
SAMPO OYJ-A SHS	4,689	40.98	192,155.22	
SCOR SE	1,565	38.40	60,096.00	
AROUNDTOWN SA	10,475	8.25	86,418.75	
DEUTSCHE WOHNEN SE	3,506	38.02	133,298.12	
VONOVIA SE	5,210	51.10	266,231.00	
ADYEN NV	107	835.20	89,366.40	
AMADEUS IT GROUP SA	3,957	77.70	307,458.90	
ATOS SE	1,004	78.18	78,492.72	
CAPGEMINI SA	1,651	119.05	196,551.55	
DASSAULT SYSTEMES SA	1,357	163.95	222,480.15	

SAP SE	9,394	126.64	1,189,656.16	
WIRECARD AG	1,119	139.65	156,268.35	
WORLDLINE SA	566	67.60	38,261.60	
INGENICO GROUP	414	100.85	41,751.90	
NOKIA OYJ	59,734	3.67	219,552.31	
CELLNEX TELECOM SA	2,767	43.85	121,332.95	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	32,678	14.80	483,699.75	
ELISA OYJ	1,241	53.22	66,046.02	
ILIAD SA	98	115.10	11,279.80	
KONINKLIJKE KPN NV	37,869	2.73	103,571.71	
ORANGE	19,967	13.09	261,368.03	
PROXIMUS	918	25.72	23,610.96	
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.50	36,321.70	
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.49	35,257.87	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	2.78	1,726.08	
TELEFONICA SA	47,198	6.11	288,757.36	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,460	30.18	44,062.80	
E.ON SE	23,556	10.40	244,982.40	
EDF	6,102	11.47	70,020.45	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	18,329	4.30	78,869.68	
ENAGAS SA	1,292	24.13	31,175.96	
ENDESA SA	3,177	24.65	78,313.05	
ENEL SPA	78,269	7.81	611,985.31	
ENGIE	18,405	15.71	289,142.55	
FORTUM OYJ	3,981	22.68	90,289.08	
IBERDROLA SA	58,441	9.88	577,747.72	
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,416	23.47	80,173.52	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,384	18.36	80,512.16	
RWE AG	5,848	31.71	185,440.08	
SNAM SPA	20,377	4.87	99,399.00	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	14.92	33,506.62	
TERNA SPA	14,453	6.32	91,371.86	
UNIPER SE	2,177	29.69	64,635.13	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	5,023	26.99	135,570.77	
VERBUND AG	797	47.00	37,459.00	

	ASML HOLDING NV	4,019	270.65	1,087,742.35	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	12,870	21.91	281,981.70	
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	27.74	168,215.36	
ユーロ 小計		1,836,930		40,604,428.27 (4,884,712,720)	
英ポンド	BP PLC	193,712	4.86	941,634.03	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	41,461	21.87	906,752.07	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	35,775	22.00	787,050.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	10,602	21.32	226,034.64	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	8.75	37,825.92	
	BHP GROUP PLC	20,668	17.79	367,683.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,282	52.10	66,792.20	
	EVRAZ PLC	3,072	3.79	11,649.02	
	GLENCORE PLC	109,009	2.30	251,320.24	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	27.92	50,339.76	
	MONDI PLC	5,338	16.27	86,849.26	
	RIO TINTO PLC	10,996	44.38	488,057.46	
	ASHTEAD GROUP PLC	4,977	25.58	127,311.66	
	BAE SYSTEMS PLC	33,568	6.43	216,110.78	
	BUNZL PLC	3,344	20.39	68,184.16	
	DCC PLC	823	63.60	52,342.80	
	FERGUSON PLC	2,384	70.50	168,072.00	
	MEGGITT PLC	7,023	6.93	48,697.48	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	2.46	109,622.52	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	18,000	6.58	118,440.00	
	SMITHS GROUP PLC	3,824	17.42	66,633.20	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	802	91.55	73,423.10	
	WEIR GROUP PLC/THE	2,572	13.87	35,673.64	
	EXPERIAN PLC	9,330	26.93	251,256.90	
	G4S PLC	17,548	2.06	36,289.26	
	INTERTEK GROUP PLC	1,723	61.70	106,309.10	
	RELX PLC	18,927	20.50	388,003.50	
	RENTOKIL INITIAL PLC	17,290	4.81	83,234.06	
	EASYJET PLC	130	14.82	1,927.25	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,392	8.09	84,133.63	

BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,360	54.06	73,521.60	
BURBERRY GROUP PLC	3,298	20.99	69,225.02	
PERSIMMON PLC	3,047	30.49	92,903.03	
TAYLOR WIMPEY PLC	36,389	2.23	81,147.47	
CARNIVAL PLC	1,722	34.28	59,030.16	
COMPASS GROUP PLC	15,613	19.27	300,862.51	
GVC HOLDINGS PLC	6,950	8.87	61,646.50	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	48.06	80,260.20	
TUI AG-DI	4,120	8.38	34,525.60	
WHITBREAD PLC	983	43.02	42,288.66	
AUTO TRADER GROUP PLC	10,377	5.95	61,805.41	
INFORMA PLC	11,550	8.20	94,710.00	
ITV PLC	42,960	1.41	60,573.60	
PEARSON PLC	7,332	5.83	42,804.21	
WPP PLC	11,423	10.03	114,572.69	
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.49	42,120.32	
KINGFISHER PLC	12,732	2.06	26,342.50	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,143	1.84	16,873.40	
NEXT PLC	1,278	71.94	91,939.32	
OCADO GROUP PLC	2,823	13.18	37,207.14	
SAINSBURY (J) PLC	9,573	2.09	20,074.58	
TESCO PLC	96,904	2.48	241,194.05	
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.87	43,174.51	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	26.70	87,602.70	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	21,830	34.12	744,948.75	
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	27.88	51,187.68	
DIAGEO PLC	22,570	32.40	731,268.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	8,282	19.59	162,244.38	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	6,767	61.50	416,170.50	
UNILEVER PLC	10,572	44.74	472,991.28	
NMC HEALTH PLC	438	13.47	5,902.05	
SMITH & NEPHEW PLC	8,847	19.30	170,747.10	
ASTRAZENECA PLC	12,437	76.59	952,549.83	
GLAXOSMITHKLINE PLC	47,362	18.22	863,314.53	
BARCLAYS PLC	167,483	1.73	290,482.51	

	HSBC HOLDINGS PLC	191,346	5.79	1,108,658.72	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	681,695	0.58	395,996.62	
	ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	42,392	2.23	94,703.72	
	STANDARD CHARTERED PLC	28,731	6.88	197,899.12	
	3I GROUP PLC	8,862	11.17	98,988.54	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,573	18.31	28,809.49	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,252	79.50	258,534.00	
	M&G PLC	21,579	2.45	52,954.86	
	SCHRODERS PLC	1,161	32.65	37,906.65	
	ST JAMES'S PLACE PLC	5,722	11.28	64,572.77	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	3.13	58,812.30	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,104	23.02	25,414.08	
	AVIVA PLC	34,259	4.11	141,010.04	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	3.39	25,333.49	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	62,981	3.11	196,374.75	
	PRUDENTIAL PLC	24,850	14.17	352,248.75	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	5.52	51,903.50	
	AVEVA GROUP PLC	700	51.25	35,875.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1,601	11.15	17,857.55	
	SAGE GROUP PLC/THE	12,303	7.66	94,240.98	
	HALMA PLC	4,070	21.62	87,993.40	
	BT GROUP PLC	76,563	1.71	130,922.73	
	VODAFONE GROUP PLC	260,244	1.56	407,281.86	
	CENTRICA PLC	60,998	0.91	55,666.77	
	NATIONAL GRID PLC	33,301	10.14	337,805.34	
	SEVERN TRENT PLC	2,533	26.18	66,313.94	
	SSE PLC	9,313	15.29	142,442.33	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,711	10.10	47,581.10	
英ポンド 小計		2,877,615		17,609,967.55 (2,509,596,475)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	22.22	12,887.60	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	654.00	51,012.00	
	GIVAUDAN-REG	81	3,154.00	255,474.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	4,295	51.94	223,082.30	
	SIKA AG-REG	1,079	181.65	196,000.35	

	ABB LTD-REG	18,072	23.41	423,065.52	
	GEBERIT AG-REG	335	523.20	175,272.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	245.80	52,847.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	386	255.70	98,700.20	
	ADECCO SA-REG	1,516	60.32	91,445.12	
	SGS SA-REG	55	2,766.00	152,130.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	530	163.70	86,761.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5,126	75.72	388,140.72	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	304	260.00	79,040.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	49.90	12,524.90	
	DUFRY AG-REG	465	89.50	41,617.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	33	2,184.00	72,072.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	11	8,205.00	90,255.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	92,100.00	92,100.00	
	NESTLE SA-REG	28,885	108.90	3,145,576.50	
	ALCON INC	4,228	59.99	253,637.72	
	SONOVA HOLDING AG-REG	419	242.40	101,565.60	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	107	1,007.00	107,749.00	
	LONZA GROUP AG-REG	751	395.10	296,720.10	
	NOVARTIS AG-REG	20,760	91.55	1,900,578.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	6,646	323.50	2,149,981.00	
	VIFOR PHARMA AG	491	181.50	89,116.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	25,328	13.20	334,329.60	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,813	50.16	90,940.08	
	PARGESA HOLDING SA-BR	29	81.40	2,360.60	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	174	900.40	156,669.60	
	UBS GROUP AG-REG	37,635	12.39	466,485.82	
	BALOISE HOLDING AG - REG	517	177.70	91,870.90	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	344	499.70	171,896.80	
	SWISS RE AG	3,067	111.05	340,590.35	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,477	413.00	610,001.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	823	118.80	97,772.40	
	TEMENOS GROUP AG-REG	622	157.55	97,996.10	
	SWISSCOM AG-REG	251	534.40	134,134.40	
		167,780		13,234,399.28	

スイスフラン 小計				(1,487,414,135)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,099	319.00	350,581.00	
	BOLIDEN AB	3,164	243.00	768,852.00	
	ALFA LAVAL AB	3,608	248.70	897,309.60	
	ASSA ABLOY AB-B	8,918	240.20	2,142,103.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,182	386.50	2,775,843.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,770	340.60	1,284,062.00	
	EPIROC AB-A	5,706	122.70	700,126.20	
	EPIROC AB-B	1,290	120.25	155,122.50	
	SANDVIK AB	11,964	187.60	2,244,446.40	
	SKANSKA AB-B SHS	3,780	226.70	856,926.00	
	SKF AB-B SHARES	2,513	184.60	463,899.80	
	VOLVO AB-B SHS	15,715	156.60	2,460,969.00	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	157.25	602,739.25	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	238.50	365,382.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	75.94	215,441.78	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	7,503	188.94	1,417,616.82	
	ICA GRUPPEN AB	510	426.30	217,413.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,870	545.00	1,019,150.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	5,328	313.00	1,667,664.00	
	NORDEA BANK ABP	33,101	76.51	2,532,557.51	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	14,454	92.48	1,336,705.92	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	16,392	94.46	1,548,388.32	
	SWEDBANK AB - A SHARES	9,995	134.75	1,346,826.25	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	232.00	146,856.00	
	INVESTOR AB-B SHS	4,717	539.60	2,545,293.20	
	KINNEVIK AB - B	2,331	234.60	546,852.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	90	433.80	39,042.00	
	ERICSSON LM-B SHS	31,297	79.70	2,494,370.90	
	HEXAGON AB-B SHS	2,433	560.40	1,363,453.20	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	144	451.40	65,001.60	
	TELE2 AB-B SHS	5,409	148.50	803,236.50	
	TELIA CO AB	26,824	41.29	1,107,562.96	
スウェーデンクローナ 小計		239,942		36,481,794.91 (415,892,461)	

ノルウェークローネ	AKER BP ASA	242	280.00	67,760.00	
	EQUINOR ASA	9,420	179.80	1,693,716.00	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	30.46	246,908.76	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	338.70	578,160.90	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	269.80	148,929.60	
	MOWI ASA	5,068	224.30	1,136,752.40	
	ORKLA ASA	9,407	88.74	834,777.18	
	DNB ASA	8,949	161.30	1,443,473.70	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	200.20	132,532.40	
	TELENOR ASA	8,534	167.00	1,425,178.00	
ノルウェークローネ 小計		52,647		7,708,188.94 (92,883,676)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,198	508.60	609,302.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,039	354.90	723,641.10	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,653	670.00	1,107,510.00	
	ISS A/S	982	171.00	167,922.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	8,150.00	317,850.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	67	8,622.00	577,674.00	
	DSV PANALPINA A S	2,034	758.40	1,542,585.60	
	PANDORA A/S	1,082	375.40	406,182.80	
	CARLSBERG AS-B	1,119	1,038.50	1,162,081.50	
	COLOPLAST-B	1,265	857.40	1,084,611.00	
	DEMANT A/S	550	224.00	123,200.00	
	GENMAB A/S	622	1,534.50	954,459.00	
	H LUNDBECK A/S	120	277.10	33,252.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	17,094	418.85	7,159,821.90	
	DANSKE BANK A/S	6,042	109.60	662,203.20	
	TRYG A/S	694	209.40	145,323.60	
	ORSTED A/S	2,053	749.60	1,538,928.80	
デンマーククローネ 小計		38,653		18,316,549.30 (294,896,443)	
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	3,012	35.12	105,781.44	
	OIL SEARCH LTD	14,702	7.71	113,352.42	
	ORIGIN ENERGY LTD	14,373	8.55	122,889.15	
	SANTOS LTD	14,669	8.84	129,673.96	

WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	21.92	7,825.44	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	8,447	35.39	298,939.33	
WORLEY LTD	1,064	15.92	16,938.88	
ALUMINA LTD	25,748	2.25	57,933.00	
BHP GROUP LTD	28,547	40.45	1,154,726.15	
BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	15.29	95,654.24	
BORAL LTD	12,991	5.08	65,994.28	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	16,229	12.48	202,537.92	
INCITEC PIVOT LTD	5,342	3.40	18,162.80	
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	31.57	123,154.57	
NEWCREST MINING LTD	7,037	31.98	225,043.26	
ORICA LTD	2,316	23.00	53,268.00	
RIO TINTO LTD	3,895	103.18	401,886.10	
SOUTH32 LTD	58,587	2.73	159,942.51	
CIMIC GROUP LTD	682	28.88	19,696.16	
BRAMBLES LTD	15,390	12.32	189,604.80	
SEEK LTD	3,309	24.01	79,449.09	
AURIZON HOLDINGS LTD	21,433	5.47	117,238.51	
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	6.71	58,377.00	
SYDNEY AIRPORT	12,027	8.43	101,387.61	
TRANSURBAN GROUP	27,401	15.89	435,401.89	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,291	36.64	230,502.24	
CROWN RESORTS LTD	773	12.04	9,306.92	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	41.47	1,824.68	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	4.75	100,856.75	
REA GROUP LTD	563	113.30	63,787.90	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	4.32	1,909.44	
WESFARMERS LTD	11,400	44.91	511,974.00	
COLES GROUP LTD	11,355	16.30	185,086.50	
WOOLWORTHS GROUP LTD	12,572	40.84	513,440.48	
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	11.94	61,717.86	
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	17.70	124,785.00	
COCHLEAR LTD	589	236.05	139,033.45	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	79.36	112,770.56	
SONIC HEALTHCARE LTD	4,402	31.22	137,430.44	

	CSL LTD	4,365	310.70	1,356,205.50	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	27,973	25.90	724,500.70	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,272	10.29	33,668.88	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	17,042	84.94	1,447,547.48	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	27,562	25.80	711,099.60	
	WESTPAC BANKING CORP	33,478	25.21	843,980.38	
	AMP LTD	36,656	1.86	68,180.16	
	ASX LTD	1,467	85.45	125,355.15	
	CHALLENGER LTD	1,796	8.72	15,661.12	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,348	145.86	488,339.28	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	800	66.52	53,216.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	25,707	7.30	187,661.10	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	16,184	3.16	51,141.44	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	13,868	13.77	190,962.36	
	SUNCORP GROUP LTD	11,553	12.99	150,073.47	
	LENDLEASE GROUP	6,799	18.69	127,073.31	
	COMPUTERSHARE LTD	2,732	17.89	48,875.48	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	24.74	39,584.00	
	TELSTRA CORP LTD	32,785	3.88	127,205.80	
	TPG TELECOM LTD	287	7.08	2,031.96	
	AGL ENERGY LTD	6,692	19.96	133,572.32	
	APA GROUP	11,910	11.37	135,416.70	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.76	2,529.12	
オーストラリアドル 小計		689,032		13,613,166.04 (1,011,458,236)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	10,115	5.64	57,048.60	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	8.88	72,075.12	
	A2 MILK CO LTD	7,579	16.01	121,339.79	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,361	22.77	144,839.97	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	16.62	26,542.14	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	21,747	4.58	99,601.26	
	MERCURY NZ LTD	7,200	5.20	37,440.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	5.22	49,078.44	
ニュージーランドドル 小計		72,113		607,965.32 (43,664,069)	

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	28,500	74.35	2,118,975.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	10.90	109,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	12,500	66.80	835,000.00	
	MTR CORP	19,500	46.15	899,925.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	23.30	11,650.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	21,000	56.05	1,177,050.00	
	SANDS CHINA LTD	22,600	41.30	933,380.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	9.18	18,360.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	18.00	93,600.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	10,000	24.70	247,000.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	6,000	28.50	171,000.00	
	WH GROUP LTD	120,500	7.96	959,180.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	17.66	63,576.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	34,500	27.35	943,575.00	
	HANG SENG BANK LTD	7,000	165.50	1,158,500.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	12,100	271.40	3,283,940.00	
	AIA GROUP LTD	115,800	83.00	9,611,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	24,500	53.40	1,308,300.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	17.98	233,740.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	19,916	37.05	737,887.80	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	23.25	11,625.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	80,000	10.56	844,800.00	
	SINO LAND CO	18,000	11.22	201,960.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	17,200	115.70	1,990,040.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	73.00	306,600.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	26.40	132,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	14,000	44.65	625,100.00	
	WHEELOCK & CO LTD	9,400	50.35	473,290.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	11.74	387,420.00	
	PCCW LTD	4,000	4.72	18,880.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	56.00	246,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	18,000	82.60	1,486,800.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	500	7.91	3,955.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	93,880	15.50	1,455,140.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	57.55	834,475.00	

	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	115.50	184,800.00	
香港ドル 小計		806,896		34,118,323.80 (478,680,082)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	15,900	6.75	107,325.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	800	2.19	1,752.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	4.12	49,440.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,500	1.04	1,560.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	19,100	2.22	42,402.00	
	SATS LTD	1,200	4.83	5,796.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	7,400	8.82	65,268.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.91	73,528.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,200	2.09	27,588.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	30.14	3,014.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	23,900	4.10	97,990.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	17,800	26.20	466,360.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	34,200	11.10	379,620.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	11,000	26.35	289,850.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	10,900	8.81	96,029.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	3.89	82,468.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	6,700	10.92	73,164.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	8.36	17,556.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	16.46	21,398.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	86,800	3.39	294,252.00	
シンガポールドル 小計		367,900		2,196,360.00 (177,026,616)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,122	14.38	59,274.36	
	ELBIT SYSTEMS LTD	263	527.50	138,732.50	
	BANK HAPOALIM BM	9,996	29.40	293,882.40	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	16,884	24.94	421,086.96	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	15.80	118,800.20	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	93.30	131,926.20	
	AZRIELI GROUP	234	259.50	60,723.00	
	NICE SYSTEMS LTD	745	613.00	456,685.00	
イスラエルシュケル 小計		41,177		1,681,110.62 (53,022,228)	
		10,413,959		42,429,608,621	

合　計			(42,429,608,621)	

(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	88,502.05	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	961	158,238.26	
		AMERICAN TOWER CORP	4,224	1,003,284.48	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	15,662	151,294.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,390	304,868.70	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,367	194,127.67	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	701	77,839.04	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,027	603,647.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,101	269,474.26	
		DUKE REALTY CORP	3,781	136,494.10	
		EQUINIX INC	820	485,407.20	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	111,579.84	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,681	304,639.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	580	179,492.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,155	128,124.15	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	80,092.77	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	4,041	149,517.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	111,156.64	
		INVITATION HOMES INC	5,744	180,016.96	
		IRON MOUNTAIN INC	2,044	64,488.20	
		KIMCO REALTY CORP	3,824	77,818.40	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	1,416	91,841.76	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,450	122,080.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,033	141,479.68	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	83,295.74	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	100,865.70	
		PROLOGIS INC	6,108	587,284.20	
		PUBLIC STORAGE	1,557	349,499.79	

	REALTY INCOME CORP	2,774	213,958.62	
	REGENCY CENTERS CORP	1,514	96,570.49	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,173	296,944.95	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,017	436,921.94	
	SL GREEN REALTY CORP	468	43,692.48	
	SUN COMMUNITIES INC	788	124,551.28	
	UDR INC	2,553	123,003.54	
	VENTAS INC	3,668	215,788.44	
	VEREIT INC	11,100	107,670.00	
	VICI PROPERTIES INC	4,920	131,118.00	
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	84,743.29	
	WELLTOWER INC	4,008	348,495.60	
	WEYERHAEUSER CO	7,592	231,783.76	
	WP CAREY INC	1,458	122,967.72	
米ドル 小計		135,259	8,914,661.08 (972,232,937)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	54,036.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	41,441.80	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	2,490.90	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	41,998.50	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,705.01	
カナダドル 小計		4,548	141,672.21 (11,750,293)	
ユーロ	COVIVIO	522	56,376.00	
	GECINA SA	474	80,248.20	
	ICADE	30	2,983.50	
	KLEPIERRE	2,365	77,169.95	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	157,872.00	
ユーロ 小計		4,587	374,649.65 (45,070,352)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	9,933	58,624.56	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	64,485.60	
	SEGRO PLC	12,304	112,680.03	
英ポンド 小計		28,885	235,790.19 (33,602,459)	
オーストラリアドル	DEXUS	10,906	138,179.02	

		GOODMAN GROUP	15,409	231,443.18	
		GPT GROUP	15,542	92,474.90	
		MIRVAC GROUP	32,387	112,706.76	
		SCENTRE GROUP	50,466	197,826.72	
		STOCKLAND	28,650	144,109.50	
		VICINITY CENTRES	42,168	107,950.08	
	オーストラリアドル 小計		195,528	1,024,690.16 (76,134,478)	
	香港ドル	LINK REIT	23,000	1,876,800.00	
	香港ドル 小計		23,000	1,876,800.00 (26,331,504)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	38,800	122,220.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	54,570.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	22,000	57,640.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	55,890.00	
		SUNTEC REIT	8,500	15,810.00	
	シンガポールドル 小計		117,800	306,130.00 (24,674,078)	
合計				1,189,796,101 (1,189,796,101)	

(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	608銘柄	96.8%	—	67.3%
	投資証券	42銘柄	—	3.2%	2.2%
カナダドル	株式	85銘柄	99.3%	—	3.6%
	投資証券	5銘柄	—	0.7%	0.0%
ユーロ	株式	235銘柄	99.1%	—	11.2%
	投資証券	5銘柄	—	0.9%	0.1%
英ポンド	株式	93銘柄	98.7%	—	5.8%
	投資証券	3銘柄	—	1.3%	0.1%

スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	―	3.4%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	100.0%	―	1.0%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%	―	0.2%
デンマーククローネ	株式	17銘柄	100.0%	―	0.7%
オーストラリアドル	株式	62銘柄	93.0%	―	2.3%
	投資証券	7銘柄	―	7.0%	0.2%
ニュージーランドドル	株式	8銘柄	100.0%	―	0.1%
香港ドル	株式	36銘柄	94.8%	―	1.1%
	投資証券	1銘柄	―	5.2%	0.1%
シンガポールドル	株式	20銘柄	87.8%	―	0.4%
	投資証券	5銘柄	―	12.2%	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 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,258,757,580
コール・ローン	39,401,746
株式	7,576,678,079
投資証券	17,185,215
派生商品評価勘定	37,525,782
未収入金	193,456,500
未収配当金	3,292,912
差入委託証拠金	519,156,464
流動資産合計	10,645,454,278

	2020年 1月27日現在
資産合計	10,645,454,278
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,050,530
未払解約金	91,000
未払利息	106
流動負債合計	3,141,636
負債合計	3,141,636
純資産の部	
元本等	
元本	7,682,410,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,959,902,287
元本等合計	10,642,312,642
純資産合計	10,642,312,642
負債純資産合計	10,645,454,278

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 1月27日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	4,259,682,907円
期中追加設定元本額	7,250,403,925円
期中一部解約元本額	3,827,676,477円
期末元本額	7,682,410,355円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	415,870,035円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	617,085,627円
りそなラップ型ファンド（成長型）	855,977,079円
ＤＣりそな　グローバルバランス	7,988,561円
つみたてバランスファンド	194,455,309円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	157,705,015円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	76,149,551円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	43,707,129円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	3,214,685円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,077,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	613,829円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	592,189円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	9,820,193円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	1,996,589,744円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	589,300,965円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	16,566,042円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	50,858,472円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	58,991,402円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	171,271,732円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	522,364,713円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	951,409,111円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	542,362,143円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	396,694,194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）	744,723円
２．　計算日における受益権の総数	
	7,682,410,355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	1.3853円
(10,000口当たり純資産額)	(13,853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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	692,273,067
投資証券	△606,770
合計	691,666,297

(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 1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	3,052,406,725	－	3,088,106,970	35,700,245
合計		3,052,406,725	－	3,088,106,970	35,700,245

（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 1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	為替予約取引				

の取引	買建	267,562,123	—	266,336,868	△1,225,255
	米ドル	195,637,197	—	194,779,658	△857,539
	メキシコペソ	7,349,140	—	7,282,800	△66,340
	ユーロ	605,542	—	601,500	△4,042
	トルコリラ	1,108,566	—	1,099,800	△8,766
	ハンガリーフォリント	1,746,943	—	1,734,360	△12,583
	ポーランドズロチ	2,278,220	—	2,260,800	△17,420
	香港ドル	45,888,092	—	45,705,200	△182,892
	南アフリカランド	12,948,423	—	12,872,750	△75,673
	売建	34,527	—	34,265	262
	ブラジルレアル	34,527	—	34,265	262
合計		267,596,650	—	266,371,133	△1,224,993

（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	60,112	7.61	457,452.32	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	13,200	0.79	10,441.20	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,416	106.80	471,628.80	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,057	193.00	204,001.00	

ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	14,717	7.65	112,585.05	
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,010	7.67	107,456.70	
TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,078	77.34	238,052.52	
YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	9.66	18,354.00	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,690	13.23	35,588.70	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	9.59	30,208.50	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	7,524	34.14	256,869.36	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,951	23.42	45,692.42	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,651	12.85	21,215.35	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	603	59.95	36,149.85	
SEVERSTAL - GDR REG S	3,201	15.33	49,071.33	
SOUTHERN COPPER CORP	885	39.85	35,267.25	
51JOB INC-ADR	300	80.83	24,249.00	
BEST INC - ADR	1,500	6.08	9,120.00	
DP WORLD PLC	1,903	14.27	27,155.81	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,700	22.61	83,657.00	
NIO INC - ADR	7,400	4.66	34,484.00	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,500	32.31	48,465.00	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,550	124.61	193,145.50	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	4,400	46.68	205,392.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	4,050	44.25	179,212.50	
58.COM INC-ADR	1,060	62.59	66,345.40	
AUTOHOME INC-ADR	720	81.44	58,636.80	
BAIDU INC - SPON ADR	3,050	130.00	396,500.00	
HUYA INC-ADR	900	18.15	16,335.00	
IQIYI INC-ADR	1,300	21.89	28,457.00	
JOYY INC	620	59.29	36,759.80	
MOMO INC-SPON ADR	1,750	30.05	52,587.50	
NETEASE INC-ADR	782	328.15	256,613.30	
SINA CORP	630	39.80	25,074.00	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,000	12.82	12,820.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	530	43.56	23,086.80	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	18,830	213.75	4,024,912.50	
BAOZUN INC-SPN ADR	500	32.40	16,200.00	
JD.COM INC-ADR	8,320	39.55	329,056.00	

	PINDUODUO INC-ADR	2,200	37.34	82,148.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	5,350	31.90	170,665.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	5,000	13.58	67,900.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,788	13.97	66,912.30	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,645	35.50	58,397.50	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	23.48	14,088.00	
	BANCO MACRO SA-ADR	450	30.29	13,630.50	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	17,261	5.33	92,001.13	
	CREDICORP LTD	744	217.47	161,797.68	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	1,210	13.99	16,927.90	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	30,206	17.18	519,090.11	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.53	33,904.46	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	400	36.06	14,424.00	
	QUDIAN INC-SPON ADR	3,000	3.21	9,630.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.94	9,535.68	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	700	52.33	36,631.00	
	GLOBANT SA	440	124.18	54,639.20	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,700	10.77	61,389.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	11.38	9,900.60	
米ドル 小計		313,186		9,771,911.32 (1,065,724,648)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	173,900	7.85	1,365,115.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	39,800	52.71	2,097,858.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	199.78	274,697.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	10,000	47.01	470,100.00	
	ALFA S.A.B.-A	28,900	15.19	438,991.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	5,600	71.76	401,856.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	4,200	239.83	1,007,286.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,415	376.85	910,092.75	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	207.00	569,250.00	
	ALSEA SAB DE CV	6,000	45.53	273,180.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	27,300	45.34	1,237,782.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	3,600	74.00	266,400.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	2,100	101.37	212,877.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	58,400	56.84	3,319,456.00	

	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,300	105.85	455,155.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	6,100	118.16	720,776.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	21,900	175.86	3,851,334.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,455	207.01	508,209.55	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,600	33.52	522,912.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	18,100	39.38	712,778.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	28,900	114.44	3,307,316.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	27,300	24.23	661,479.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	378,800	15.67	5,935,796.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	5,300	88.45	468,785.00	
メキシコペソ 小計		875,095		29,989,481.80 (173,639,099)	
ブラジルレアル	COSAN SA	1,400	80.57	112,798.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	82,400	29.30	2,414,320.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,100	27.53	195,463.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	37.63	86,549.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	14.91	108,843.00	
	GERDAU SA-PREF	12,600	21.67	273,042.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,900	21.76	171,904.00	
	SUZANO SA	6,207	43.87	272,301.09	
	VALE SA	35,700	53.80	1,920,660.00	
	EMBRAER SA	8,100	18.55	150,255.00	
	WEG SA	9,450	41.43	391,513.50	
	CCR SA	13,900	19.82	275,498.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	6,510	51.41	334,679.10	
	RUMO SA	12,500	24.33	304,125.00	
	COGNA EDUCACAO	16,900	11.67	197,223.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,300	74.25	170,775.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	8,600	28.95	248,970.00	
	LOJAS RENNER S.A.	8,700	60.17	523,479.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,900	56.15	443,585.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	8,100	29.59	239,679.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	4,700	23.66	111,202.00	
	CIA BRASILEIRA DE DIS-PREF	1,800	88.70	159,660.00	
	RAIA DROGASIL SA	2,600	124.00	322,400.00	

	AMBEV SA	52,900	18.99	1,004,571.00	
	BRF SA	6,500	33.83	219,895.00	
	JBS SA	12,400	29.30	363,320.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,200	49.18	354,096.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,000	64.50	129,000.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	5,600	70.65	395,640.00	
	HYPERA SA	4,300	35.03	150,629.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	57,500	34.35	1,975,125.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	9,400	50.80	477,520.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	43.88	193,072.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	53,600	34.24	1,835,264.00	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	48,700	13.35	650,145.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	23,000	48.99	1,126,770.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	78.35	203,710.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,900	35.90	283,610.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	7,900	42.82	338,278.00	
	PORTO SEGURO SA	1,200	65.01	78,012.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	2,700	66.78	180,306.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	9,300	18.74	174,282.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,500	35.13	122,955.00	
	CIELO SA	11,700	7.00	81,900.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,800	59.94	287,712.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,600	16.39	157,344.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	5,500	42.38	233,090.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,600	15.44	163,664.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,900	62.47	243,633.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,100	56.32	118,272.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,375	53.87	127,941.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	9,500	24.43	232,085.00	
ブラジルレアル 小計		657,642		21,330,764.94 (556,093,041)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,614	7,300.00	33,682,200.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,459	1,930.00	27,905,870.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,121	22,552.00	25,280,792.00	
	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	6,710.00	19,868,310.00	

	S.A.C.I. FALABELLA	9,554	3,190.10	30,478,215.40	
	CENCOSUD SA	13,424	1,029.30	13,817,323.20	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,479	7,031.20	10,399,144.80	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	2,125.00	6,056,250.00	
	BANCO DE CHILE	490,670	78.63	38,581,382.10	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	575	33,900.00	19,492,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	752,457	41.58	31,287,162.06	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	3.95	7,426,000.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	5,380.00	5,385,380.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	40,006	307.00	12,281,842.00	
	COLBUN SA	83,944	120.20	10,090,068.80	
	ENEL AMERICAS SA	453,880	157.79	71,617,725.20	
	ENEL CHILE SA	352,178	76.60	26,976,834.80	
チリペソ 小計		4,105,173		390,627,000.36 (54,765,905)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	51,116	3,290.00	168,171,640.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	17,960.00	52,084,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	3,691	43,900.00	162,034,900.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,129	45,800.00	189,108,200.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	43,000	1,440.00	61,920,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	32,860.00	85,041,680.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	5,790	19,380.00	112,210,200.00	
コロンビアペソ 小計		113,214		830,570,620.00 (26,910,488)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	20.30	15,915.20	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	370	19.30	7,141.00	
	OPAP SA	2,215	11.72	25,959.80	
	JUMBO SA	1,191	19.46	23,176.86	
	ALPHA BANK AE	14,218	1.85	26,374.39	
	EUROBANK ERGASIAS SA	30,708	0.90	27,882.86	
	NATIONAL BANK OF GREECE	6,654	3.04	20,261.43	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,734	13.77	37,647.18	
ユーロ 小計		58,874		184,358.72 (22,178,354)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,417	119.60	169,473.20	

	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	13,819	9.62	132,938.78	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,600	22.94	82,584.00	
	KOC HOLDING AS	9,413	20.86	196,355.18	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	28.60	42,900.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	14.54	79,970.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	450	74.10	33,345.00	
	ARCELIK AS	1,000	21.94	21,940.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,831	50.30	242,999.30	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	26.00	49,920.00	
	AKBANK T.A.S.	34,653	8.76	303,560.28	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	27,862	11.97	333,508.14	
	TURKIYE IS BANKASI-C	17,700	7.33	129,741.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,597	10.27	129,371.19	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	13,358	14.41	192,488.78	
トルコリラ 小計		149,620		2,141,094.85 (39,267,679)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	804.00	602,196.00	
	MONETA MONEY BANK AS	6,489	85.40	554,160.60	
	CEZ AS	1,907	518.00	987,826.00	
チェココルナ 小計		9,145		2,144,182.60 (10,249,192)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	4,529	2,710.00	12,273,590.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,582	6,580.00	10,409,560.00	
	OTP BANK PLC	2,519	14,740.00	37,130,060.00	
ハンガリーフォリント 小計		8,630		59,813,210.00 (21,389,203)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	1,113	85.86	95,562.18	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	3,275	85.52	280,078.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	20,397	4.06	82,811.82	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,613	97.36	157,041.68	
	CCC SA	371	91.20	33,835.20	
	LPP SA	13	8,585.00	111,605.00	
	AMREST HOLDINGS SE	830	47.00	39,010.00	
	CD PROJEKT SA	760	276.00	209,760.00	
	CYFROWY POLSAT SA	2,915	27.40	79,871.00	

	DINO POLSKA SA	510	161.80	82,518.00	
	BANK MILLENNIUM SA	8,345	6.04	50,403.80	
	BANK PEKAO SA	1,972	100.50	198,186.00	
	MBANK SA	165	379.00	62,535.00	
	PKO BANK POLSKI SA	9,977	35.72	356,378.44	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	345	292.00	100,740.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	6,759	41.49	280,430.91	
	ORANGE POLSKA SA	4,200	7.31	30,702.00	
	PGE SA	9,929	7.44	73,871.76	
ポーランドズロチ 小計		73,489		2,325,340.79 (65,737,384)	
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	35,000	2.85	99,750.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	22,000	12.20	268,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	292,000	4.48	1,308,160.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	40,000	14.74	589,600.00	
	CNOOC LTD	201,000	13.04	2,621,040.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.37	33,700.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	236,000	3.73	880,280.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	28,000	6.35	177,800.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	48,000	2.40	115,200.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	14,500	54.75	793,875.00	
	BBMG CORP-H	25,000	2.26	56,500.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	4.30	55,900.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	45,000	3.25	146,250.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	46,000	8.54	392,840.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	30,000	9.72	291,600.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	2.87	49,364.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.87	148,050.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	19,000	6.10	115,900.00	
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	24,000	2.99	71,760.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	17,000	8.29	140,930.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	2.17	73,780.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	12,000	8.90	106,800.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	58,000	3.78	219,240.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	3.45	89,700.00	

BOC AVIATION LTD	2,200	72.55	159,610.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	54,000	5.87	316,980.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	26,000	5.91	153,660.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	19,000	36.80	699,200.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	15,000	10.94	164,100.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	19,500	8.15	158,925.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	48,000	4.68	224,640.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	26,000	7.04	183,040.00	
CITIC LTD	68,000	9.66	656,880.00	
CRRC CORP LTD - H	54,000	5.51	297,540.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	31,000	11.52	357,120.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	18.52	148,160.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	1.67	53,440.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	38,000	2.51	95,380.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	7,000	14.58	102,060.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	4.61	80,675.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	9,500	15.70	149,150.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	20,000	14.76	295,200.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	8.82	52,920.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	5,300	27.40	145,220.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,400	6.24	121,056.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	5,250	29.20	153,300.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	44,000	5.88	258,720.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	14,000	27.65	387,100.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	9.00	90,000.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	6.72	120,960.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	18,000	6.41	115,380.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	26,000	3.79	98,540.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	14,000	13.28	185,920.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	22,000	4.66	102,520.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	34,500	3.07	105,915.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	6.09	109,620.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	10.40	124,800.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	10,000	10.50	105,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	9,500	17.22	163,590.00	

SINOTRANS LIMITED-H	15,000	2.69	40,350.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.91	124,380.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	23,500	4.31	101,285.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	38,000	7.05	267,900.00	
BYD CO LTD-H	8,000	46.20	369,600.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LT	26,000	0.25	6,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	34,000	6.40	217,600.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	24.65	128,180.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	58,000	13.44	779,520.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	36,000	5.67	204,120.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	36,000	8.67	312,120.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	6.24	68,640.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	12,000	73.05	876,600.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	42,000	2.81	118,020.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	15,000	24.70	370,500.00	
LI NING CO LTD	23,000	25.75	592,250.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	8,700	111.60	970,920.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	15.86	95,160.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	8,000	10.78	86,240.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	4,000	29.70	118,800.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.27	177,800.00	
CHINA LITERATURE LTD	3,400	34.20	116,280.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	63,900	385.80	24,652,620.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	118,000	0.78	92,040.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	11,300	102.30	1,155,990.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,500	29.95	194,675.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	23,500	9.46	222,310.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	24,000	4.19	100,560.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	32,000	31.55	1,009,600.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	16,000	38.25	612,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	23,000	6.00	138,000.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	24,000	14.14	339,360.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	47.25	189,000.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	17,000	8.47	143,990.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	59,000	6.89	406,510.00	

YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	45.90	275,400.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	8,500	62.10	527,850.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	42,000	10.76	451,920.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	4,300	69.85	300,355.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	24,000	9.91	237,840.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,000	14.98	164,780.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	14,400	27.65	398,160.00	
3SBIO INC	13,000	11.00	143,000.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	17,000	11.66	198,220.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	17,500	7.74	135,450.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.92	94,080.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	54,000	18.70	1,009,800.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	17.60	176,000.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	6,000	28.10	168,600.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	9,500	31.30	297,350.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	16,500	5.69	93,885.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	5,500	22.75	125,125.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	80,500	11.48	924,140.00	
SSY GROUP LTD	22,000	7.82	172,040.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	1,960	102.00	199,920.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	6,500	104.50	679,250.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	329,000	3.20	1,052,800.00	
BANK OF CHINA LTD-H	890,000	3.20	2,848,000.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	96,000	5.28	506,880.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	106,000	4.38	464,280.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,071,000	6.43	6,886,530.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	40,000	3.54	141,600.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	44,500	39.90	1,775,550.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	84,100	5.82	489,462.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	29,000	3.85	111,650.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	735,000	5.62	4,130,700.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	94,000	5.13	482,220.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	98,000	1.73	169,540.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	10,000	13.14	131,400.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	37,000	4.28	158,360.00	

CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.16	119,480.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,200	14.92	256,624.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	25,000	16.72	418,000.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	7.50	217,500.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	19,200	9.49	182,208.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	13.90	105,640.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	31,600	8.33	263,228.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	21,000	13.38	280,980.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	84,000	20.60	1,730,400.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	30,000	28.60	858,000.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	1.23	67,650.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	18,800	18.12	340,656.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	9,700	32.10	311,370.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	97,000	3.08	298,760.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	78,000	9.12	711,360.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	63,000	94.85	5,975,550.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,900	28.10	109,590.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	11.14	200,520.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	11.40	159,600.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	22,000	18.88	415,360.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	62,000	5.70	353,400.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	44,000	26.95	1,185,800.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	32,000	34.20	1,094,400.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	17,500	30.05	525,875.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	26,000	5.85	152,100.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	87,000	10.94	951,780.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	11,600	12.86	149,176.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	32,000	3.65	116,800.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,500	10.78	156,310.00	
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	16,000	13.14	210,240.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	20,500	34.65	710,325.00	
SEAZEN GROUP LTD	20,000	8.38	167,600.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	40,000	2.91	116,400.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	13,500	27.35	369,225.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.72	48,160.00	

SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	40,500	3.09	125,145.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	3.09	37,080.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	28,000	41.45	1,160,600.00	
WHARF HOLDINGS LTD	13,000	20.80	270,400.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	74,000	1.69	125,060.00	
YUZHOU PROPERTIES CO	12,000	4.00	48,000.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	21,000	5.07	106,470.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	26,000	9.14	237,640.00	
KINGSOFT CORP LTD	9,000	25.05	225,450.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	18.06	162,540.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	8,000	62.50	500,000.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	7,500	17.54	131,550.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	4.17	62,550.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	8,000	23.45	187,600.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	15,500	9.10	141,050.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	16.34	55,556.00	
LENOVO GROUP LTD	86,000	5.63	484,180.00	
SUNNY OPTICAL TECH	7,800	141.00	1,099,800.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	89,800	13.34	1,197,932.00	
ZTE CORP-H	9,000	28.00	252,000.00	
CHINA MOBILE LTD	69,000	69.70	4,809,300.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	162,000	3.16	511,920.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	482,000	1.75	843,500.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	72,000	6.80	489,600.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	5,000	36.40	182,000.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	56,000	3.88	217,280.00	
CGN POWER CO LTD-H	131,000	2.05	268,550.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	21,200	32.35	685,820.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	32,000	5.01	160,320.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.64	96,760.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	10,000	44.90	449,000.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	24,000	11.30	271,200.00	
DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	1.47	47,040.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	9,100	96.15	874,965.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	34,000	16.58	563,720.00	

	HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	2.87	57,400.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	48,000	4.11	197,280.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	58,000	3.19	185,020.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	40,000	6.73	269,200.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	5.28	58,080.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	21.25	63,750.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	36,500	16.14	589,110.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	36,000	6.07	218,520.00	
香港ドル 小計		10,296,010		115,154,302.00 (1,615,614,857)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	43,000	3.29	141,470.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	23.14	67,106.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	28,000	6.92	193,760.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	17,400	5.10	88,740.00	
	GAMUDA BHD	23,300	4.04	94,132.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	6,800	9.85	66,980.00	
	IJM CORP BHD	23,600	2.29	54,044.00	
	SIME DARBY BERHAD	36,000	2.25	81,000.00	
	AIRASIA GROUP BHD	22,600	1.56	35,256.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	13,500	6.83	92,205.00	
	MISC BHD	14,000	8.12	113,680.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.06	27,608.00	
	GENTING BHD	20,400	5.82	118,728.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	28,900	3.15	91,035.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	1,800	11.14	20,052.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,700	33.00	56,100.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	10.74	32,220.00	
	IOI CORP BHD	19,700	4.58	90,226.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,300	23.46	100,878.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	800	146.10	116,880.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,820	18.62	108,368.40	
	QL RESOURCES BHD	8,200	8.17	66,994.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	24,400	5.28	128,832.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	13,600	6.03	82,008.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	26,200	5.79	151,698.00	

	TOP GLOVE CORP BHD	14,600	5.54	80,884.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	19,000	3.83	72,770.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	53,600	5.06	271,216.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	6,500	16.14	104,910.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	3,200	16.40	52,480.00	
	MALAYAN BANKING BHD	44,500	8.53	379,585.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	35,300	19.18	677,054.00	
	RHB BANK BHD	19,700	5.85	115,245.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	32,000	4.23	135,360.00	
	DIGI.COM BHD	36,100	4.48	161,728.00	
	MAXIS BHD	22,900	5.50	125,950.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	14,100	4.00	56,400.00	
	PETRONAS GAS BHD	7,100	16.40	116,440.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	35,700	12.88	459,816.00	
	YTL CORP BHD	19,380	0.98	18,992.40	
マレーシアリンギット 小計		760,400		5,048,830.80 (135,662,083)	
タイバーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	53,000	11.00	583,000.00	
	IRPC PCL - NVDR	137,700	3.02	415,854.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,700	128.50	2,017,450.00	
	PTT PCL-NVDR	125,700	45.25	5,687,925.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	53.00	699,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	28.25	466,125.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	26,200	50.50	1,323,100.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	9,000	363.00	3,267,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	49,000	71.50	3,503,500.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	78,900	11.10	875,790.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	76,000	13.70	1,041,200.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	32,500	33.50	1,088,750.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	69,000	15.40	1,062,600.00	
	ROBINSON PCL-NVDR	3,300	68.50	226,050.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	12,000	41.25	495,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	66,900	73.50	4,917,150.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	44,900	30.50	1,369,450.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	46.50	302,250.00	

	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	34,000	14.60	496,400.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	107,900	26.00	2,805,400.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	4,300	144.50	621,350.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	148.50	608,850.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	19,800	141.00	2,791,800.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	41,400	16.50	683,100.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,800	99.75	977,550.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	1.52	326,800.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,800	66.25	516,750.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	7,000	74.00	518,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	25,700	62.75	1,612,675.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	98,500	9.75	960,375.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	13,800	223.00	3,077,400.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	60.50	1,113,200.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	9,200	47.50	437,000.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	142,100	3.98	565,558.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	7,200	65.25	469,800.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	3,400	330.00	1,122,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	19,800	44.50	881,100.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,000	93.75	656,250.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	6,200	198.50	1,230,700.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	7,000	73.50	514,500.00	
タイバーツ 小計		1,645,400		52,328,352.00 (185,765,649)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,860	52.95	1,263,387.00	
	AYALA CORPORATION	3,280	740.00	2,427,200.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,190	791.00	941,290.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	33,290	77.00	2,563,330.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,785	1,032.00	2,874,120.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	9,460	132.50	1,253,450.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	217.00	976,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	10,300	162.00	1,668,600.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	9,800	82.25	806,050.00	
	BDO UNIBANK INC	22,750	156.00	3,549,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	21,712	64.55	1,401,509.60	

	SECURITY BANK CORP	1,400	190.00	266,000.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.35	485,750.00	
	AYALA LAND INC	83,800	41.40	3,469,320.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	4.28	419,440.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	28.30	693,350.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	114,700	40.80	4,679,760.00	
	GLOBE TELECOM INC	430	2,004.00	861,720.00	
	PLDT INC	870	1,061.00	923,070.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	33.30	532,800.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	2,740	302.40	828,576.00	
フィリピンペソ 小計		630,367		32,884,222.60 (70,701,078)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,380.00	208,242,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	2,370.00	94,800,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	20,100	20,200.00	406,020,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	313,500	1,375.00	431,062,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	7,975.00	214,527,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	21,500	18,825.00	404,737,500.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	10,675.00	160,125,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	34,700	12,975.00	450,232,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	5,075.00	93,887,500.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	231,000	6,975.00	1,611,225,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,630.00	81,500,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	84,600	7,175.00	607,005,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	4,700	58,300.00	274,010,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	2,160.00	196,776,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	27,300	11,700.00	319,410,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	50,900	8,200.00	417,380,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	88,500	8,175.00	723,487,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	252,700	1,540.00	389,158,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	111,400	34,050.00	3,793,170,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	212,900	7,925.00	1,687,232,500.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	86,900	7,700.00	669,130,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	628,700	4,740.00	2,980,038,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	2,070.00	53,820,000.00	

	BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	1,185.00	78,210,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	97,000	570.00	55,290,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	558,100	3,920.00	2,187,752,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	3,190.00	89,320,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,880.00	247,220,000.00	
インドネシアルピア 小計		3,468,400		18,924,768,500.00 (153,290,624)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	48,350.00	23,691,500.00	
	S-OIL CORP	438	80,900.00	35,434,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	588	130,000.00	76,440,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,250	19,150.00	23,937,500.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	29,550.00	23,255,850.00	
	KOREA ZINC CO LTD	95	407,000.00	38,665,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	76,100.00	16,589,800.00	
	LG CHEM LTD	564	348,500.00	196,554,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	196	209,000.00	40,964,000.00	
	OCI CO LTD	198	63,000.00	12,474,000.00	
	POSCO	883	240,500.00	212,361,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	291	60,700.00	17,663,700.00	
	CJ CORP	181	90,000.00	16,290,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	362	85,100.00	30,806,200.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	3,044	4,670.00	14,215,480.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	25,900.00	13,312,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	31,550.00	18,299,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	801	30,300.00	24,270,300.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	23,550.00	6,570,450.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	990	40,650.00	40,243,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	127	303,000.00	38,481,000.00	
	KCC CORP	54	223,500.00	12,069,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	938	32,300.00	30,297,400.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	487	125,000.00	60,875,000.00	
	LG CORP	1,145	73,500.00	84,157,500.00	
	LOTTE CORP	242	38,900.00	9,413,800.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	500	17,700.00	8,850,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,002	117,000.00	117,234,000.00	

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	18,300.00	29,353,200.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,370	7,160.00	38,449,200.00	
SK HOLDINGS CO LTD	418	241,000.00	100,738,000.00	
S-1 CORPORATION	208	92,600.00	19,260,800.00	
CJ LOGISTICS	135	142,000.00	19,170,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	230	156,000.00	35,880,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	594	25,400.00	15,087,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	4,275.00	14,009,175.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	837	30,800.00	25,779,600.00	
HANON SYSTEMS	2,230	11,150.00	24,864,500.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	749	251,500.00	188,373,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,962	130,500.00	256,041,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	240	84,500.00	20,280,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,990	43,400.00	129,766,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	546	46,000.00	25,116,000.00	
HLB INC	359	102,600.00	36,833,400.00	
LG ELECTRONICS INC	1,180	69,000.00	81,420,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	577	88,500.00	51,064,500.00	
KANGWON LAND INC	1,365	28,600.00	39,039,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	820	22,550.00	18,491,000.00	
KAKAO CORP	552	165,500.00	91,356,000.00	
NAVER CORP	1,576	183,000.00	288,408,000.00	
NCSOFT CORP	190	646,000.00	122,740,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	263	96,400.00	25,353,200.00	
PEARL ABYSS CORP	70	193,300.00	13,531,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	151,000.00	17,063,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	360	97,000.00	34,920,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	183	87,500.00	16,012,500.00	
LOTTE SHOPPING CO	140	130,000.00	18,200,000.00	
SHINSEGAE INC	79	306,500.00	24,213,500.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	174,000.00	9,918,000.00	
E-MART INC	200	118,000.00	23,600,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	471	40,800.00	19,216,800.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	85	249,500.00	21,207,500.00	
KT&G CORP	1,282	93,500.00	119,867,000.00	

ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	275	108,500.00	29,837,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	535,000.00	6,955,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	386	212,500.00	82,025,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	381	83,200.00	31,699,200.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	120	1,349,000.00	161,880,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	559	55,200.00	30,856,800.00	
CELLTRION INC	1,056	175,500.00	185,328,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	67	294,500.00	19,731,500.00	
HELIXMITH CO LTD	222	80,300.00	17,826,600.00	
MEDY-TOX INC	47	331,800.00	15,594,600.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	184	483,000.00	88,872,000.00	
YUHAN CORP	103	227,000.00	23,381,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	7,240.00	18,425,800.00	
HANA FINANCIAL GROUP	3,166	35,100.00	111,126,600.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	11,100.00	28,760,100.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,298	46,700.00	200,716,600.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,004	41,200.00	206,164,800.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,913	10,800.00	53,060,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	484	74,200.00	35,912,800.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	4,174	3,530.00	14,734,220.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,701	7,560.00	35,539,560.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	11,950.00	18,403,000.00	
SAMSUNG CARD CO	380	38,350.00	14,573,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	698	38,100.00	26,593,800.00	
DB INSURANCE CO LTD	482	44,500.00	21,449,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	2,215.00	9,132,445.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	720	23,100.00	16,632,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	347	225,000.00	78,075,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	818	73,300.00	59,959,400.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	401	205,000.00	82,205,000.00	
KMW CO LTD	170	60,100.00	10,217,000.00	
LG DISPLAY CO LTD	2,274	14,850.00	33,768,900.00	
LG INNOTEK CO LTD	110	152,500.00	16,775,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	574	134,500.00	77,203,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	56,470	60,800.00	3,433,376,000.00	

	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	5,200	50,300.00	261,560,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	590	283,500.00	167,265,000.00	
	LG UPLUS CORP	1,336	13,700.00	18,303,200.00	
	SK TELECOM	230	237,000.00	54,510,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,957	26,400.00	78,064,800.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	34,950.00	7,863,750.00	
	SK HYNIX INC	6,106	98,700.00	602,662,200.00	
韓国ウォン 小計		169,596		9,745,058,830.00 (910,188,494)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	14,000	96.90	1,356,600.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	48.70	1,071,400.00	
	CHINA STEEL CORP	132,000	24.05	3,174,600.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	39,000	88.20	3,439,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	50,000	99.00	4,950,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	58,000	72.80	4,222,400.00	
	TAIWAN CEMENT	55,121	44.95	2,477,688.95	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	520.00	520,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	32,000	29.40	940,800.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,111	330.50	697,685.50	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	8.98	152,660.00	
	EVA AIRWAYS CORP	26,023	13.60	353,912.80	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	11,550	12.95	149,572.50	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	38.95	856,900.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	19,000	42.25	802,750.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	402.50	813,050.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	190.00	646,000.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	34.40	344,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	3,000	194.00	582,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	285.00	570,000.00	
	POU CHEN	23,000	38.80	892,400.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	72.10	173,040.00	
	TATUNG CO LTD	21,000	21.65	454,650.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,000	702.00	2,106,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	308.00	1,848,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	3,120	70.90	221,208.00	

UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	54,000	75.40	4,071,600.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	62,554	22.45	1,404,337.30	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	208,000	22.90	4,763,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	117,425	29.30	3,440,552.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	112,551	24.55	2,763,127.05	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	89,778	22.45	2,015,516.10	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	122,000	32.35	3,946,700.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	120,995	13.50	1,633,432.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	108,785	14.70	1,599,139.50	
TAIWAN BUSINESS BANK	60,545	12.75	771,948.75	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	102,626	21.50	2,206,459.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	38,000	53.10	2,017,800.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	13,536	142.50	1,928,880.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	113,000	20.65	2,333,450.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	87,000	43.10	3,749,700.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	139,000	9.84	1,367,760.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	26.00	684,320.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	74,000	47.10	3,485,400.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	99,835	10.40	1,038,284.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	10,000	47.10	471,000.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	45.45	287,244.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	6,000	174.00	1,044,000.00	
ACER INC	31,000	18.05	559,550.00	
ADVANTECH CO LTD	4,000	314.50	1,258,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	8,000	236.00	1,888,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	10.55	907,300.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	254.50	1,781,500.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	7,015	88.50	620,827.50	
COMPAL ELECTRONICS	49,000	19.10	935,900.00	
DELTA ELECTRONICS INC	22,000	152.50	3,355,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	10,000	65.90	659,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	138,800	92.30	12,811,240.00	
INNOLUX CORP	91,000	9.34	849,940.00	
INVENTEC CORP	27,000	22.90	618,300.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,500	4,975.00	7,462,500.00	

	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	22,000	50.00	1,100,000.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	93.80	656,600.00	
	PEGATRON CORP	21,000	68.00	1,428,000.00	
	QUANTA COMPUTER INC	30,000	65.00	1,950,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	38.80	659,600.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	232.00	696,000.00	
	WISTRON CORP	33,951	29.40	998,159.40	
	WIWYNN CORP	1,000	721.00	721,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	15,960	39.00	622,440.00	
	YAGEO CORPORATION	3,198	415.50	1,328,769.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	134.50	807,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	42,000	109.50	4,599,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	15,000	70.70	1,060,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	18,000	108.50	1,953,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	39,000	79.00	3,081,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	420.00	840,000.00	
	MEDIATEK INC	17,000	419.00	7,123,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	85.20	1,022,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	230.50	1,613,500.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	354.00	708,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	8,000	111.50	892,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	260.50	1,302,500.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	275,000	333.00	91,575,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	130,000	16.05	2,086,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	10,000	79.30	793,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	286.00	1,144,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	34,000	19.20	652,800.00	
新台湾ドル 小計		3,614,439		245,961,794.35 (892,841,313)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	7,346	466.10	3,423,970.60	
	COAL INDIA LTD	13,201	193.95	2,560,333.95	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	7,166	244.80	1,754,236.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	20,764	119.65	2,484,412.60	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	27,649	118.35	3,272,259.15	
	PETRONET LNG LTD	6,627	276.80	1,834,353.60	

RELIANCE INDUSTRIES LTD	31,700	1,521.55	48,233,135.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	7,399	215.95	1,597,814.05	
ASIAN PAINTS LTD	3,257	1,786.80	5,819,607.60	
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,509	559.75	1,404,412.75	
GRASIM INDUSTRIES LTD	3,382	822.00	2,780,004.00	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	11,115	205.40	2,283,021.00	
JSW STEEL LTD	7,943	271.90	2,159,701.70	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,482	1,457.60	2,160,163.20	
SHREE CEMENT LTD	99	23,134.65	2,290,330.35	
TATA STEEL LTD	3,407	483.40	1,646,943.80	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,145	4,642.75	5,315,948.75	
UPL LTD	6,089	543.30	3,308,153.70	
VEDANTA LTD	21,197	155.90	3,304,612.30	
ASHOK LEYLAND LTD	13,960	86.50	1,207,540.00	
HAVELLS INDIA LTD	2,904	622.90	1,808,901.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	5,399	1,359.20	7,338,320.80	
SIEMENS LTD	766	1,624.95	1,244,711.70	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,972	384.75	2,682,477.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,410	561.35	1,352,853.50	
INTERGLOBE AVIATION LTD	850	1,501.50	1,276,275.00	
BAJAJ AUTO LTD	970	3,074.15	2,981,925.50	
BHARAT FORGE LTD	2,548	522.05	1,330,183.40	
BOSCH LTD	73	15,022.45	1,096,638.85	
EICHER MOTORS LTD	154	20,930.80	3,223,343.20	
HERO MOTOCORP LTD	1,135	2,468.65	2,801,917.75	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	8,530	567.75	4,842,907.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,199	7,128.45	8,547,011.55	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	11,300	145.10	1,639,630.00	
TATA MOTORS LTD	18,355	186.50	3,423,207.50	
PAGE INDUSTRIES LTD	54	26,214.50	1,415,583.00	
TITAN CO LTD	3,557	1,227.85	4,367,462.45	
INFO EDGE INDIA LTD	664	2,708.05	1,798,145.20	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	8,077	280.80	2,268,021.60	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,191	1,948.60	2,320,782.60	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	655	3,192.50	2,091,087.50	

ITC LTD	38,619	238.15	9,197,114.85	
NESTLE INDIA LTD	261	15,755.50	4,112,185.50	
UNITED SPIRITS LTD	3,303	578.10	1,909,464.30	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,514.35	1,060,045.00	
DABUR INDIA LTD	6,140	500.50	3,073,070.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	4,140	749.35	3,102,309.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	7,331	2,073.70	15,202,294.70	
MARICO LTD	4,549	340.55	1,549,161.95	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,579	501.10	1,292,336.90	
CIPLA LTD	3,351	458.85	1,537,606.35	
DIVI'S LABORATORIES LTD	700	1,910.50	1,337,350.00	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,316	3,031.40	3,989,322.40	
LUPIN LTD	2,600	740.15	1,924,390.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	800	1,675.40	1,340,320.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	9,619	447.80	4,307,388.20	
AXIS BANK LTD	23,522	737.40	17,345,122.80	
BANDHAN BANK LTD	4,494	481.85	2,165,433.90	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	18,395	2,450.75	45,081,546.25	
ICICI BANK LTD	53,005	533.85	28,296,719.25	
LIC HOUSING FINANCE LTD	3,542	462.15	1,636,935.30	
STATE BANK OF INDIA	20,286	324.05	6,573,678.30	
BAJAJ FINANCE LTD	1,979	4,194.50	8,300,915.50	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	475	3,209.50	1,524,512.50	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	3,822	368.90	1,409,935.80	
REC LTD	7,000	141.45	990,150.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,008	1,083.90	2,176,471.20	
BAJAJ FINSERV LTD	424	9,633.75	4,084,710.00	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	5,000	607.25	3,036,250.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,609	1,350.35	2,172,713.15	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,770	519.95	1,960,211.50	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,852	999.80	3,851,229.60	
DLF LTD	6,420	262.85	1,687,497.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	12,260	607.70	7,450,402.00	
INFOSYS LTD	37,724	782.75	29,528,461.00	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,129	2,183.40	22,115,658.60	

	TECH MAHINDRA LTD	5,249	787.30	4,132,537.70	
	WIPRO LTD	13,013	247.60	3,222,018.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	27,345	524.25	14,335,616.25	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	244.30	586,320.00	
	GAIL INDIA LTD	14,950	129.50	1,936,025.00	
	NTPC LTD	27,098	114.75	3,109,495.50	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	20,817	196.95	4,099,908.15	
	TATA POWER CO LTD	14,068	61.20	860,961.60	
インドルピー 小計		705,864		437,298,137.90 (673,439,132)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	5,400	22.61	122,094.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.26	109,836.00	
	INDUSTRIES QATAR	21,013	10.27	215,803.51	
	COMMERCIAL BANK PQSC	22,400	4.94	110,656.00	
	MASRAF AL RAYAN	43,202	4.14	178,856.28	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	8,438	9.40	79,317.20	
	QATAR ISLAMIC BANK	12,010	16.58	199,125.80	
	QATAR NATIONAL BANK	51,178	20.70	1,059,384.60	
	QATAR INSURANCE CO	11,300	3.20	36,160.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	21,430	3.60	77,148.00	
	OOREDOO QPSC	9,487	6.97	66,124.39	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,415	16.29	104,500.35	
カタールリアル 小計		260,873		2,359,006.13 (70,369,152)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,451	129.06	316,326.06	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	621	1,192.27	740,399.67	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	4,713	293.42	1,382,888.46	
	GOLD FIELDS LTD	9,532	91.41	871,320.12	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,788	135.50	1,190,774.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	771	381.07	293,804.97	
	NORTHAM PLATINUM LTD	3,885	122.45	475,718.25	
	SASOL LTD	6,375	264.50	1,686,187.50	
	SIBANYE GOLD LTD	24,891	38.29	953,076.39	
	BIDVEST GROUP LTD	3,332	221.24	737,171.68	
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,992	113.08	564,495.36	

	MR PRICE GROUP LTD	2,412	182.62	440,479.44	
	NASPERS LTD-N SHS	4,864	2,467.09	11,999,925.76	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	16.72	166,380.72	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	149.01	350,471.52	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	9,500	47.65	452,675.00	
	BID CORP LTD	3,796	348.00	1,321,008.00	
	CLICKS GROUP LTD	2,931	258.25	756,930.75	
	PICK N PAY STORES LTD	4,165	66.54	277,139.10	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	5,362	122.50	656,845.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,219	204.03	452,742.57	
	TIGER BRANDS LTD	1,537	210.00	322,770.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	25.33	323,286.79	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	4,567	117.09	534,750.03	
	ABSA GROUP LTD	7,686	140.17	1,077,346.62	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	484	1,392.00	673,728.00	
	NEDBANK GROUP LTD	3,933	203.51	800,404.83	
	STANDARD BANK GROUP LTD	14,223	163.55	2,326,171.65	
	FIRSTRAND LTD	38,316	60.40	2,314,286.40	
	INVESTEC LTD	3,650	86.48	315,652.00	
	PSG GROUP LTD	1,851	222.80	412,402.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,778	304.65	541,667.70	
	REMGRO LTD	6,142	189.59	1,164,461.78	
	RMB HOLDINGS LTD	9,165	76.99	705,613.35	
	DISCOVERY LTD	4,432	125.29	555,285.28	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	800	109.68	87,744.00	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	21.20	213,738.40	
	OLD MUTUAL LTD	54,790	18.00	986,220.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	8,594	28.66	246,304.04	
	SANLAM LTD	21,283	76.87	1,636,024.21	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,359	125.26	546,008.34	
	MTN GROUP LTD	19,135	82.48	1,578,254.80	
	TELKOM SA SOC LTD	2,500	32.25	80,625.00	
	VODACOM GROUP LTD	7,288	120.80	880,390.40	
南アフリカランド 小計		357,261		44,409,896.74 (335,738,819)	

アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	29,639	7.97	236,222.83	
	DUBAI ISLAMIC BANK	19,940	5.78	115,253.20	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	31,076	15.78	490,379.28	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	45,017	2.22	99,937.74	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.83	56,133.42	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	40,305	4.11	165,653.55	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	18,405	16.50	303,682.50	
アラブディルハム 小計		215,056		1,467,262.52 (43,636,387)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.31	12,620.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	19,800	4.94	97,812.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	17.28	25,920.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	3.25	3,575.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	7.19	3,595.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	5.64	28,764.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	8.39	20,975.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.70	2,010.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	7.79	28,823.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	5.58	2,232.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	36.98	33,282.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.68	9,592.88	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.30	6,930.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	780	3.03	2,363.40	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,200	48.00	153,600.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	5.43	43,440.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.40	3,060.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	27.17	32,604.00	
	BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	2,000	6.20	12,400.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	10.00	29,000.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.12	28,016.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	10.14	5,070.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	5.77	20,195.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	5,000	9.21	46,050.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	17.07	61,793.40	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,500	13.72	20,580.00	

HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.41	3,615.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	21.40	23,540.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.43	15,505.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.25	22,375.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	2.92	10,220.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	64.52	19,356.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	15.13	4,539.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	43.37	8,674.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	7.29	2,916.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	16.19	27,523.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,200	9.66	11,592.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.84	1,988.00	
NANJING IRON & STEEL CO-A	3,700	3.23	11,951.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.62	18,864.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	11.50	4,600.00	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	8.46	17,766.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	420	32.47	13,637.40	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	18.21	25,494.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.24	22,400.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	24.55	19,640.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	9.29	20,438.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.85	18,480.00	
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	3,800	3.35	12,730.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,500	8.10	12,150.00	
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	4.06	2,030.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	7,400	1.47	10,878.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.88	2,328.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	15.30	16,830.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	30.82	6,164.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.16	21,240.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.21	3,315.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	7.10	9,230.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,500	51.91	129,775.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	46.90	18,760.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	12.50	15,000.00	

XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	1,800	6.20	11,160.00	
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	3,300	3.84	12,672.00	
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	2,700	4.71	12,717.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	12.39	21,063.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	59.10	35,460.00	
YUNNAN TIN CO LTD-A	1,400	10.56	14,784.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	47.20	12,272.00	
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	1,200	9.97	11,964.00	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	6.97	16,031.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	13.37	5,348.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.11	3,244.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	1,800	4.29	7,722.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	12.90	12,900.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	200	21.59	4,318.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	16.64	6,656.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	6.84	20,520.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	29.00	2,900.00	
AVICOPTER PLC-A	500	44.43	22,215.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	25.75	36,050.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	6.14	14,122.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	14.35	1,435.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	8.40	2,520.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.29	3,145.00	
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	240	9.17	2,200.80	
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	13.32	11,988.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	7.02	3,510.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	3,800	9.42	35,796.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	18,000	5.56	100,080.00	
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	1,900	10.35	19,665.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	7,900	5.04	39,816.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	29.48	2,948.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	32,600	5.47	178,322.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,800	130.57	235,026.00	
CRRC CORP LTD-A	15,400	6.76	104,104.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	8.88	5,328.00	

EVE ENERGY CO LTD-A	800	60.30	48,240.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	298	11.22	3,343.56	
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	24.95	24,950.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	36.89	22,134.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	34.37	41,244.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	10.61	14,854.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	700	50.49	35,343.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	8.26	21,476.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.69	4,842.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	1,439	18.17	26,146.63	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	4.07	16,280.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	2,500	16.03	40,075.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.38	18,928.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	4.85	3,880.00	
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	700	16.18	11,326.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.82	1,746.00	
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	700	16.93	11,851.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	29.25	20,475.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	15.13	19,669.00	
SINOCHEM INTL CORP-A	2,300	5.21	11,983.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	24.30	31,590.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.68	3,472.00	
TBEA CO LTD-A	400	6.36	2,544.00	
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	3,500	3.10	10,850.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	800	13.53	10,824.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	5.19	5,709.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	8.57	2,571.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.77	4,708.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	26.66	5,332.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	300	69.78	20,934.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,300	20.80	47,840.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	12.40	16,120.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	15.78	3,156.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	53.46	26,730.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	6.30	5,670.00	

BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	8.57	22,282.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	16.20	22,680.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	50.10	40,080.00	
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	200	8.79	1,758.00	
AIR CHINA LTD-A	800	8.25	6,600.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	5.10	6,630.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	6.43	7,073.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.43	3,645.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.75	5,700.00	
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	24,000	1.96	47,040.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	5,100	7.70	39,270.00	
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	2.87	2,870.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	3,500	15.34	53,690.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	4,000	13.20	52,800.00	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.66	20,130.00	
S F HOLDING CO LTD-A	200	39.22	7,844.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	68.98	20,694.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	5.20	5,200.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	9.03	17,157.00	
SINOTRANS LIMITED-A	12,000	4.11	49,320.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	39.17	3,917.00	
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	19,000	2.47	46,930.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	900	29.66	26,694.00	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	6.48	20,736.00	
BYD CO LTD -A	200	59.83	11,966.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	98.50	19,700.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	9.88	4,940.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	24.59	4,918.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	10.86	2,172.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,000	26.70	26,700.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	21.73	26,076.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	5,010	22.61	113,276.10	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	22.06	2,206.00	
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	5.90	2,360.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	18.28	1,828.00	

ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	7.25	14,500.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	63.94	89,516.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,000	18.57	37,140.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	32.82	3,282.00	
NAVINFO CO LTD-A	3,500	15.75	55,125.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	113.00	11,300.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	2,600	19.69	51,194.00	
TCL CORP-A	1,900	5.06	9,614.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.33	3,732.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	900	70.62	63,558.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	17.20	13,760.00	
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	1,600	82.00	131,200.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	26.05	15,630.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.08	7,788.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	600	26.94	16,164.00	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	5,400	10.57	57,078.00	
CHINA FILM CO LTD-A	200	13.81	2,762.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	12.24	2,448.00	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	14.37	1,437.00	
CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	3.44	1,720.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	1,700	5.88	9,996.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY-A	100	372.50	37,250.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	18.10	3,620.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	510	45.99	23,454.90	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	5,200	10.26	53,352.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	10.62	3,186.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	47.49	4,749.00	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	3,800	17.29	65,702.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	200	32.41	6,482.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	2,700	27.70	74,790.00	
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	3.69	1,845.00	
HLA CORP LTD -A	200	7.44	1,488.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	16.33	3,266.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.59	37,950.00	
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	10.00	33,000.00	

VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	2,000	17.80	35,600.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	5.05	30,300.00	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	73.50	14,700.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	300	83.00	24,900.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	7.57	23,467.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	27.97	19,579.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	143.20	42,960.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	51.00	25,500.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	5.85	2,925.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	52.40	31,440.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.31	15,144.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	47.91	19,164.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	23.55	16,485.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,300	107.21	139,373.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.95	18,855.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	34.05	44,265.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	9.80	24,500.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	400	29.26	11,704.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	3,700	30.64	113,368.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	30.86	30,860.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	700	107.16	75,012.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	13.84	27,680.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	1,000	37.86	37,860.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	1,000	38.18	38,180.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	800	1,052.80	842,240.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	500	82.65	41,325.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	1,200	81.68	98,016.00	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	18.14	47,164.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	100	91.68	9,168.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	51.39	20,556.00	
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	1,000	9.96	9,960.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	500	38.33	19,165.00	
TONGWEI CO LTD-A	400	13.54	5,416.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	48.33	4,833.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	4,200	32.68	137,256.00	

WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,800	126.16	353,248.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	17.97	19,767.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	16.80	21,840.00	
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	28.45	17,070.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	1,170	40.00	46,800.00	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	500	113.50	56,750.00	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	1,100	49.48	54,428.00	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	1,900	29.60	56,240.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	900	50.45	45,405.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	20.85	5,004.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	700	80.78	56,546.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	2,500	24.41	61,025.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	16.46	3,292.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	31.91	22,337.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	14.07	6,753.60	
OVCTEK CHINA INC-A	900	52.18	46,962.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	18.91	3,782.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	200	187.68	37,536.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	500	102.50	51,250.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	3,200	15.93	50,976.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	152.01	30,402.00	
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	900	14.20	12,780.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	900	31.32	28,188.00	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	27.35	5,470.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	73.29	21,987.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	79.50	23,850.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	498.00	49,800.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	38.25	22,950.00	
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	900	13.77	12,393.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	35.76	3,576.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	500	59.59	29,795.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	34.13	3,413.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	37.68	7,536.00	
GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	1,200	9.07	10,884.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	73.26	21,978.00	

HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,200	36.09	43,308.00	
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	26.06	18,242.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	2,500	87.99	219,975.00	
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	16.33	16,330.00	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	20.16	18,144.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	10.38	16,608.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	37.95	18,975.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	500	49.74	24,870.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	20.79	5,405.40	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	26.18	5,236.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	22.80	20,520.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	100.22	30,066.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	18.56	1,856.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	16.23	16,230.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	25.00	5,000.00	
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	15.66	3,132.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.16	2,432.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	28.22	16,932.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	1,400	95.79	134,106.00	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	17.90	17,900.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	86.60	95,260.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	100	128.79	12,879.00	
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	6.07	13,354.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,100	17.49	19,239.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	23.57	41,954.60	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	48.38	19,352.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	41,700	3.52	146,784.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	5.42	40,650.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	8.68	13,020.00	
BANK OF CHINA LTD-A	23,400	3.61	84,474.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	26,200	5.47	143,314.00	
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	280	8.87	2,483.60	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	9.17	4,585.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	6.95	22,240.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	8.27	19,848.00	

BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	26.93	91,562.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.91	78,497.10	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.82	3,492.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.97	20,910.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	25,600	4.02	102,912.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	13,900	36.81	511,659.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	24,600	6.08	149,568.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	7.40	32,560.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	31,400	5.72	179,608.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	18.59	254,683.00	
PING AN BANK CO LTD-A	10,200	15.54	158,508.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	16,800	11.35	190,680.00	
ANXIN TRUST CO LTD-A	500	3.68	1,840.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.54	4,086.00	
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	3.46	34,600.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.82	16,230.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	6.88	5,504.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	1,900	18.75	35,625.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,300	23.90	150,570.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	3,400	33.90	115,260.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	12.27	2,454.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	2,700	15.08	40,716.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	12.40	4,960.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.70	3,850.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	800	8.04	6,432.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	800	14.81	11,848.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	12.30	7,380.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	2,500	17.57	43,925.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.69	4,345.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	2,800	14.55	40,740.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	109.05	21,810.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	6.97	2,788.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	7,100	18.94	134,474.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	10.60	3,180.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	6.80	4,760.00	

NANJING SECURITIES CO LTD-A	7,000	12.74	89,180.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.63	25,890.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	600	10.29	6,174.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	16,000	3.52	56,320.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	13.96	8,376.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	10,000	4.65	46,500.00	
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A	5,000	9.09	45,450.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.92	3,168.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.82	73,264.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	8.83	2,649.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.14	2,742.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.07	19,266.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.25	4,625.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	6,000	10.57	63,420.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	800	32.26	25,808.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	3,500	35.96	125,860.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	6.48	3,888.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	700	47.99	33,593.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	7,700	83.49	642,873.00	
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	7.42	16,324.00	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.56	15,504.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,100	26.40	29,040.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	6,500	18.13	117,845.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	5,500	28.98	159,390.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	7.50	3,000.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	34.00	27,200.00	
GEMDALE CORP-A	600	13.17	7,902.00	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	6.34	17,118.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.49	7,788.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.29	28,799.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.14	4,998.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	4.57	5,484.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	7,200	15.33	110,376.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	9.06	5,436.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	14.50	13,050.00	

SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	6.87	17,175.00	
TAHOE GROUP CO LTD-A	2,100	5.61	11,781.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.51	4,212.00	
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	7.17	24,378.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	24.57	7,371.00	
AISINO CORP-A	200	22.90	4,580.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	37.56	3,756.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	2,000	21.20	42,400.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	800	72.30	57,840.00	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	2,000	22.71	45,420.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	13.92	5,568.00	
GLODON CO LTD-A	1,800	40.00	72,000.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	130	88.69	11,529.70	
IFLYTEK CO LTD - A	300	35.19	10,557.00	
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	2,000	18.67	37,340.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	500	154.00	77,000.00	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	3.16	2,464.80	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,000	37.62	37,620.00	
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	2,000	20.53	41,060.00	
VENUSTECH GROUP INC-A	1,500	39.19	58,785.00	
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	8.20	7,380.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	260	32.56	8,465.60	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	29.55	17,730.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	37.37	33,633.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	4.72	96,760.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	23.21	16,247.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	14.18	36,868.00	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	800	41.65	33,320.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	26.00	28,600.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	1,200	20.00	24,000.00	
GOERTEK INC -A	500	23.61	11,805.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	10.13	22,286.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	5,200	12.96	67,392.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	11.92	3,576.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	7,200	36.00	259,200.00	

HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	16.58	3,316.00	
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	6.10	17,080.00	
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	12.80	11,520.00	
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	1,700	8.22	13,974.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	1,200	34.13	40,956.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	20.68	26,884.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	7.56	17,388.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	3,080	45.15	139,062.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	400	118.50	47,400.00	
NINESTAR CORP-A	100	39.00	3,900.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	17.92	7,168.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	2,100	24.32	51,072.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	300	177.49	53,247.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	44.00	39,600.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	28.70	20,090.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	16.54	4,962.00	
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	3.05	2,440.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	55.84	27,920.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	140	33.06	4,628.40	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	19.77	25,701.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	25.72	20,576.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	800	31.07	24,856.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	23.97	38,352.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	43.99	17,596.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	500	82.08	41,040.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	20.12	8,048.00	
ZTE CORP-A	1,300	39.17	50,921.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	18,500	5.65	104,525.00	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	4.45	11,125.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.85	20,855.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	15,900	17.15	272,685.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.22	6,216.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.54	4,602.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	5.41	4,328.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.83	2,298.00	

	INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.54	12,446.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.16	8,976.00	
	SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.46	16,412.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.54	3,878.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	5.91	2,955.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.11	6,377.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	5.89	25,327.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	400	283.00	113,200.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	16.95	33,900.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,200	29.05	34,860.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	300	22.56	6,768.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	338.06	84,515.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	15.68	36,064.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	15.50	17,050.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	500	185.55	92,775.00	
オフショア人民元 小計		1,167,928		16,600,533.87 (260,462,376)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,027	20.48	61,992.96	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	11,400	34.30	391,020.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,224	49.30	60,343.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	12.90	48,787.80	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	17.70	61,950.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	1,897	77.10	146,258.70	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	4,879	43.50	212,236.50	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	8,438	89.80	757,732.40	
	SAUDI CEMENT	865	69.00	59,685.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,544	24.26	61,717.44	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,000	10.16	81,280.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,200	52.90	116,380.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	102.40	43,212.80	
	JARIR MARKETING CO	629	166.40	104,665.60	
	ALMARAI CO	2,821	47.80	134,843.80	
	SAVOLA	2,962	34.70	102,781.40	
	AL RAJHI BANK	13,807	65.50	904,358.50	
	ALINMA BANK	8,420	25.85	217,657.00	

	ARAB NATIONAL BANK	6,732	27.30	183,783.60	
	BANK AL-JAZIRA	3,554	15.22	54,091.88	
	BANK ALBILAD	4,268	27.05	115,449.40	
	BANQUE SAUDI FRANSI	6,201	38.20	236,878.20	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	13,550	46.70	632,785.00	
	RIYAD BANK	13,644	24.20	330,184.80	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	11,127	30.05	334,366.35	
	SAUDI BRITISH BANK	8,027	34.25	274,924.75	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	298	104.00	30,992.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	78.20	51,690.20	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	5,942	9.70	57,637.40	
	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	10.28	44,152.60	
	ETIHAD ETISALAT CO	4,227	26.80	113,283.60	
	SAUDI TELECOM CO	4,487	92.60	415,496.20	
	SAUDI ELECTRICITY CO	9,459	19.86	187,855.74	
サウジアラビアリアル 小計		177,289		6,630,474.82 (193,013,122)	
合　計		29,832,951		7,576,678,079 (7,576,678,079)	

(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	35,500	1,143,455.00	
	メキシコペソ 小計		35,500	1,143,455.00 (6,620,604)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	223,245.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	33,820	715,969.40	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	62,770	458,221.00	
	南アフリカランド 小計		108,690	1,397,435.40 (10,564,611)	
合計				17,185,215 (17,185,215)	

(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	58銘柄	100.0%	—	14.0%
メキシコペソ	株式	24銘柄	96.3%	—	2.3%
	投資証券	1銘柄	—	3.7%	0.1%
ブラジルレアル	株式	52銘柄	100.0%	—	7.3%
チリペソ	株式	17銘柄	100.0%	—	0.7%
コロンビアペソ	株式	7銘柄	100.0%	—	0.4%
ユーロ	株式	8銘柄	100.0%	—	0.3%
トルコリラ	株式	15銘柄	100.0%	—	0.5%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	—	0.3%
ポーランドズロチ	株式	18銘柄	100.0%	—	0.9%
香港ドル	株式	207銘柄	100.0%	—	21.4%
マレーシアリンギット	株式	40銘柄	100.0%	—	1.8%
タイバーツ	株式	40銘柄	100.0%	—	2.4%
フィリピンペソ	株式	21銘柄	100.0%	—	0.9%
インドネシアルピア	株式	28銘柄	100.0%	—	2.0%
韓国ウォン	株式	105銘柄	100.0%	—	12.0%
新台湾ドル	株式	88銘柄	100.0%	—	11.8%
インドルピー	株式	84銘柄	100.0%	—	8.9%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%	—	0.9%
南アフリカランド	株式	44銘柄	96.9%	—	4.4%
	投資証券	3銘柄	—	3.1%	0.1%
アラブディルハム	株式	7銘柄	100.0%	—	0.6%
オフショア人民元	株式	461銘柄	100.0%	—	3.4%
サウジアラビアリアル	株式	33銘柄	100.0%	—	2.5%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	669,750,075
投資証券	24,030,863,630
派生商品評価勘定	8,740,170
未収入金	56,939,080
未収配当金	158,795,636
差入委託証拠金	11,415,500
流動資産合計	24,936,504,091
資産合計	24,936,504,091
負債の部	
流動負債	
前受金	12,139,600
未払金	226,843,015
未払解約金	138,505,000
未払利息	1,816
流動負債合計	377,489,431
負債合計	377,489,431
純資産の部	
元本等	
元本	16,608,377,856
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,950,636,804
元本等合計	24,559,014,660
純資産合計	24,559,014,660
負債純資産合計	24,936,504,091

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 1月27日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	10,367,134,330円
期中追加設定元本額	17,725,311,130円
期中一部解約元本額	11,484,067,604円
期末元本額	16,608,377,856円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	409,235,380円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	294,146,363円
りそなラップ型ファンド（成長型）	389,622,834円
ＤＣりそな　グローバルバランス	7,435,812円
つみたてバランスファンド	384,539,664円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	97,777,349円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	46,798,891円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	26,021,037円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	1,839,793円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,266,857円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	361,111円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	349,148円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	4,522,556,621円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	2,464,261,785円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	1,934,565,748円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	10,793,425円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	34,818,000円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	34,700,963円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	81,922,297円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	249,849,080円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	455,061,505円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	259,430,990円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	189,754,155円

Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,487,107,932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）	1,122,959円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,223,038,157円
２．　計算日における受益権の総数	
	16,608,377,856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	1.4787円
(10,000口当たり純資産額)	(14,787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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	1,934,904,100
合計	1,934,904,100

(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 1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	518,205,330	－	526,945,500	8,740,170
合計		518,205,330	－	526,945,500	8,740,170

（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	221	31,138,900	
	サンケイリアルエステート投資法人	312	42,276,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	715	499,785,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2,760	342,516,000	
	森ヒルズリート投資法人	2,475	455,400,000	
	産業ファンド投資法人	2,771	466,082,200	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,040	702,780,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,339	288,956,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,078	611,226,000	
	ＧＬＰ投資法人	5,358	731,367,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	896	321,216,000	
	日本プロロジスリート投資法人	3,091	923,590,800	
	星野リゾート・リート投資法人	327	182,139,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	335	120,432,500	
	イオンリート投資法人	2,322	349,461,000	
	ヒューリックリート投資法人	1,830	360,327,000	
	日本リート投資法人	699	350,898,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13,821	322,443,930	
	日本ヘルスケア投資法人	104	22,360,000	
	積水ハウス・リート投資法人	6,290	575,535,000	
	トーセイ・リート投資法人	468	63,414,000	
	ケネディクス商業リート投資法人	831	225,117,900	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	459	65,178,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	431	51,461,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	6,945	1,293,853,500	
	いちごホテルリート投資法人	356	47,063,200	

	ラサールロジポート投資法人	2,000	335,400,000	
	スターアジア不動産投資法人	714	82,681,200	
	マリモ地方創生リート投資法人	212	26,966,400	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	530	283,020,000	
	大江戸温泉リート投資法人	366	33,672,000	
	さくら総合リート投資法人	465	44,640,000	
	投資法人みらい	2,446	147,738,400	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	505	74,639,000	
	三菱地所物流リート投資法人	423	156,721,500	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	404	58,378,000	
	ザイマックス・リート投資法人	312	43,274,400	
	タカラレーベン不動産投資法人	611	78,696,800	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	333	42,657,300	
	日本ビルファンド投資法人	2,083	1,787,214,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,151	1,684,233,000	
	日本リテールファンド投資法人	4,066	934,366,800	
	オリックス不動産投資法人	4,286	995,209,200	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,362	661,932,000	
	プレミア投資法人	1,943	303,496,600	
	東急リアル・エステート投資法人	1,442	307,434,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,494	214,389,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,830	941,850,000	
	森トラスト総合リート投資法人	1,538	301,294,200	
	インヴィンシブル投資法人	9,436	512,374,800	
	フロンティア不動産投資法人	764	343,036,000	
	平和不動産リート投資法人	1,340	186,126,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,406	409,146,000	
	福岡リート投資法人	1,113	206,906,700	
	ケネディクス・オフィス投資法人	665	569,240,000	
	いちごオフィスリート投資法人	1,666	193,755,800	
	大和証券オフィス投資法人	497	426,426,000	
	阪急阪神リート投資法人	972	165,045,600	
	スターツプロシード投資法人	335	68,742,000	
	大和ハウスリート投資法人	2,900	820,410,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,930	501,039,000	
	日本賃貸住宅投資法人	2,420	256,036,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,990	386,657,000	
合計		125,224	24,030,863,630	

(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 1月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	52,057,074
コール・ローン	61,612,597
投資証券	24,904,886,156
派生商品評価勘定	711
未収入金	166,156,534
未収配当金	39,349,174
流動資産合計	25,224,062,246
資産合計	25,224,062,246
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	906,725
未払金	204,411,887
未払解約金	37,893,000
未払利息	167
流動負債合計	243,211,779
負債合計	243,211,779
純資産の部	
元本等	
元本	20,554,057,909
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,426,792,558
元本等合計	24,980,850,467
純資産合計	24,980,850,467
負債純資産合計	25,224,062,246

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	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 1月27日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 1月26日
期首元本額	11,241,072,465円
期中追加設定元本額	12,927,922,372円
期中一部解約元本額	3,614,936,928円
期末元本額	20,554,057,909円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	490,532,590円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,925,038,738円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,694,870,173円
ＤＣりそな　グローバルバランス	8,545,670円
つみたてバランスファンド	228,930,835円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	129,597,879円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	62,387,528円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	35,518,615円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	2,505,192円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	1,801,239円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	494,721円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	476,362円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	7,088,880,846円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	3,606,261,847円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	772,832,258円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	12,927,856円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	42,113,797円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	48,542,072円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０３	198,853,079円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	606,478,095円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,104,622,763円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	629,745,255円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	460,611,716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）	1,788,384円

りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	1,399,700,399円
２．　計算日における受益権の総数	
	20,554,057,909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	1.2154円
(10,000口当たり純資産額)	(12,154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 1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 1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 1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 1月27日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	1,835,465,928
合計	1,835,465,928

(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 1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	180,709,334	－	179,803,320	△906,014
	米ドル	144,980,742	－	144,368,960	△611,782
	ユーロ	7,266,504	－	7,218,000	△48,504

	英ポンド	7,906,288	－	7,837,500	△68,788
	オーストラリアドル	10,129,860	－	10,029,150	△100,710
	ニュージーランドドル	3,044,748	－	3,016,020	△28,728
	シンガポールドル	7,381,192	－	7,333,690	△47,502
合計		180,709,334	－	179,803,320	△906,014

（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	14,100	366,882.00	
		AGREE REALTY CORP	6,948	518,807.16	
		ALEXANDER'S INC	329	111,915.93	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,378	3,355,441.48	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,318	397,101.32	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	22,399	1,050,513.10	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	17,369	229,791.87	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	41,984	1,149,102.08	
		AMERICOLD REALTY TRUST	31,589	1,113,512.25	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,885	1,344,287.70	

		APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,824	539,423.76	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	92,000	79,580.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,694	30,521.34	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,180	5,084,069.40	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	41,245.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	23,797	3,379,411.97	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	41,023.71	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	28,747	462,826.70	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,043	1,032,355.15	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC	10,124	194,077.08	
		BRT APARTMENTS CORP	877	15,636.91	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	15,884	1,763,759.36	
		CARETRUST REIT INC	15,349	335,682.63	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	16,088.10	
		CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	45,212.80	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,636	134,469.96	
		CITY OFFICE REIT INC	10,006	136,882.08	
		CLIPPER REALTY INC	1,350	14,917.50	
		COLONY CAPITAL INC	77,590	360,017.60	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,907	436,361.44	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,483	159,660.72	
		CORECIVIC INC	18,869	306,243.87	
		COREPOINT LODGING INC	6,500	61,620.00	
		CORESITE REALTY CORP	6,265	737,515.80	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	18,565	556,578.70	
		COUSINS PROPERTIES INC	24,783	1,014,368.19	
		CUBESMART	31,588	999,760.20	
		CYRUSONE INC	18,981	1,188,590.22	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	32,057	324,416.84	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	34,401	4,412,272.26	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	37,686	303,183.87	
		DOUGLAS EMMETT INC	26,820	1,136,631.60	
		DUKE REALTY CORP	60,785	2,194,338.50	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	43,460.00	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,895	311,027.40	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	6,387	876,104.79	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,413	344,223.30	
		EPR PROPERTIES	13,136	949,601.44	
		EQUINIX INC	14,120	8,358,475.20	
		EQUITY COMMONWEALTH	19,750	645,825.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,392	2,190,655.36	
		EQUITY RESIDENTIAL	57,518	4,760,189.68	

		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15,080	402,334.40	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,928	3,381,888.16	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	21,453	2,379,781.29	
		FARMLAND PARTNERS INC	3,259	22,096.02	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,528	1,496,449.68	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,048	912,641.28	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,428	339,411.60	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	16,048	125,174.40	
		FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	7,075	80,089.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,517	1,548,150.23	
		GEO GROUP INC/THE	20,928	339,033.60	
		GETTY REALTY CORP	6,020	195,770.40	
		GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,336	95,999.04	
		GLADSTONE LAND CORP	2,563	34,626.13	
		GLOBAL MEDICAL REIT INC	6,693	98,855.61	
		GLOBAL NET LEASE INC	14,471	296,655.50	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,267	792,482.53	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	33,769	1,083,984.90	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,380	3,048,060.00	
		HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,293	70,979.13	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,369	871,750.11	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	118,017	2,015,730.36	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25,269	930,404.58	
		INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	14,706	218,678.22	
		INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	10,160	233,781.60	
		INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	2,062	166,527.12	
		INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,725	127,098.00	
		INVITATION HOMES INC	89,672	2,810,320.48	
		IRON MOUNTAIN INC	47,905	1,511,402.75	
		JBG SMITH PROPERTIES	19,991	820,630.55	
		KILROY REALTY CORP	16,056	1,322,211.60	
		KIMCO REALTY CORP	69,316	1,410,580.60	
		KITE REALTY GROUP TRUST	14,063	260,728.02	
		LEXINGTON REALTY TRUST	42,425	462,856.75	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	26,194	1,698,942.84	
		LIFE STORAGE INC	7,597	868,337.10	
		LTC PROPERTIES INC	6,590	309,400.50	
		MACERICH CO/THE	18,451	461,275.00	
		MACK-CALI REALTY CORP	14,367	331,159.35	
		MANULIFE US REAL ESTATE INV	235,900	240,618.00	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86,411	1,935,606.40	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,997	2,601,829.12	

		MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	15,829	236,326.97	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,168	1,591,773.68	
		NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,836	343,768.20	
		NATL HEALTH INVESTORS INC	7,159	615,387.64	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	95,486.85	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,914	189,202.76	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,699	262,843.86	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,316	1,572,119.64	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,220	63,714.00	
		PARAMOUNT GROUP INC	33,791	479,156.38	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	39,457	927,239.50	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,276	523,389.60	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	37,816.35	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	30,064	588,352.48	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,159	490,677.21	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	39,165.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	7,928	104,728.88	
		PRIME US REIT	57,000	56,430.00	
		PROLOGIS INC	104,605	10,057,770.75	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,441	587,585.16	
		PUBLIC STORAGE	24,931	5,596,261.57	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	9,783	559,685.43	
		REALTY INCOME CORP	53,749	4,145,660.37	
		REGENCY CENTERS CORP	27,475	1,752,492.87	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20,132	353,014.62	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	35,573	466,006.30	
		RETAIL VALUE INC	2,471	86,089.64	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,483	897,164.82	
		RLJ LODGING TRUST	28,449	462,011.76	
		RPT REALTY	13,829	205,360.65	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,029	778,841.54	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,884	729,695.96	
		SAFEHOLD INC	1,750	79,205.00	
		SAUL CENTERS INC	1,742	98,057.18	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,784	230,550.24	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	26,627	614,018.62	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	50,891	7,370,034.62	
		SITE CENTERS CORP	24,303	327,361.41	
		SL GREEN REALTY CORP	13,681	1,277,258.16	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,758	869,069.88	
		STAG INDUSTRIAL INC	24,974	822,393.82	
		STORE CAPITAL CORP	35,171	1,352,324.95	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,935	209,301.45	

	SUN COMMUNITIES INC	15,464	2,444,239.84	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,251	488,733.12	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,481	255,949.93	
	TAUBMAN CENTERS INC	10,733	333,259.65	
	TERRENO REALTY CORP	11,248	643,273.12	
	UDR INC	48,611	2,342,077.98	
	UMH PROPERTIES INC	5,542	91,055.06	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,113	261,103.41	
	URBAN EDGE PROPERTIES	18,399	359,884.44	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,201	124,824.00	
	VENTAS INC	61,518	3,619,103.94	
	VEREIT INC	175,153	1,698,984.10	
	VICI PROPERTIES INC	76,311	2,033,688.15	
	VORNADO REALTY TRUST	25,956	1,747,098.36	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	33,673	113,141.28	
	WASHINGTON REIT	13,121	403,077.12	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,312	623,781.52	
	WELLTOWER INC	67,359	5,856,865.05	
	WHITESTONE REIT	5,894	80,983.56	
	WP CAREY INC	28,763	2,425,871.42	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,506	384,268.20	
米ドル 小計		4,134,047	168,486,051.49 (18,375,088,775)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,226	564,679.72	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,399	125,619.92	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,844	184,819.52	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,890	790,063.20	
	CHOICE PROPERTIES REIT	26,627	394,079.60	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,739	216,073.74	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,405	103,504.80	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,585	140,794.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	11,081	156,242.10	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,818	157,693.14	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,100	394,580.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,114	293,287.06	
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,204	507,007.40	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,895	183,798.65	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,249	146,647.27	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,685	66,856.50	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,747	52,357.82	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	5,133	160,200.93	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	11,225	137,394.00	

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,805	708,347.25	
	SLATE OFFICE REIT	4,169	24,638.79	
	SLATE RETAIL REIT - U	2,120	28,641.20	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,019	386,651.23	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	11,841	150,262.29	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	36,432.00	
	カナダドル 小計	256,720	6,110,672.13 (506,819,146)	
ユーロ	AEDIFICA	4,133	505,052.60	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	25,773	455,151.18	
	ALTAREA	579	121,011.00	
	BEFIMMO	3,744	203,673.60	
	COFINIMMO	4,201	589,820.40	
	COVIVIO	7,462	805,896.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	7,000	168,140.00	
	GECINA SA	8,999	1,523,530.70	
	HAMBORNER REIT AG	11,095	112,503.30	
	HIBERNIA REIT PLC	123,689	175,143.62	
	ICADE	4,570	454,486.50	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	7,320	45,530.40	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,526	487,527.78	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,311	88,734.80	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	67,357	112,486.19	
	KLEPIERRE	34,025	1,110,235.75	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	9,624	65,924.40	
	MERCIALYS	3,481	40,797.32	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	60,726	790,652.52	
	MONTEA	1,974	167,395.20	
	NSI NV	2,995	135,823.25	
	RETAIL ESTATES	1,878	159,254.40	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,801	3,009,732.00	
	VASTNED RETAIL NV	3,177	78,313.05	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,482	538,124.10	
	WERELDHAVE NV	7,312	133,151.52	
	ユーロ 小計	489,234	12,078,091.58 (1,452,994,417)	
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	19,760.00	
	ASSURA PLC	406,515	319,114.27	
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,414	299,885.20	
	BRITISH LAND CO PLC	155,182	915,884.16	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	10,949.40	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	95,927	94,488.09	

		DERWENT LONDON PLC	17,440	723,062.40	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,846	102,660.76	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,068	389,571.04	
		HAMMERSON PLC	128,054	333,836.77	
		HANSTEEN HOLDINGS PLC	61,038	71,048.23	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	22,210.88	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	123,385	1,196,834.50	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	136,689	313,564.56	
		LXI REIT PLC	93,342	127,131.80	
		NEWRIVER REIT PLC	53,666	103,253.38	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	87,000	87,870.00	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	210,813	334,771.04	
		RDI REIT PLC	40,782	54,403.18	
		REGIONAL REIT LTD	63,560	73,602.48	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	35,358	282,510.42	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	86,640	47,738.64	
		SEGRO PLC	181,625	1,663,321.75	
		SHAFTESBURY PLC	38,216	356,746.36	
		TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	63,121	62,868.51	
		TRITAX BIG BOX REIT PLC	279,045	399,034.35	
		UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	151,619	132,818.24	
		UNITE GROUP PLC	59,477	776,174.85	
		WORKSPACE GROUP PLC	22,311	278,218.17	
		英ポンド 小計	2,901,302	9,593,333.43 (1,367,145,947)	
	オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	64,226	245,985.58	
		APN INDUSTRIA REIT	11,379	34,250.79	
		ARENA REIT	42,342	129,143.10	
		BWP TRUST	82,525	337,527.25	
		CENTURIA METROPOLITAN REIT	64,500	192,855.00	
		CHARTER HALL GROUP	78,188	986,732.56	
		CHARTER HALL LONG WALE REIT	71,605	403,852.20	
		CHARTER HALL RETAIL REIT	54,211	253,165.37	
		CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	36,680	129,847.20	
		CROMWELL PROPERTY GROUP	304,913	373,518.42	
		DEXUS	180,102	2,281,892.34	
		GDI PROPERTY GROUP	78,244	120,104.54	
		GOODMAN GROUP	266,913	4,009,033.26	
		GPT GROUP	322,007	1,915,941.65	
		GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	43,404	187,939.32	
		HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	23,020	76,656.60	
		INGENIA COMMUNITIES GROUP	43,577	205,683.44	
		MIRVAC GROUP	650,551	2,263,917.48	

	NATIONAL STORAGE REIT	133,471	288,297.36	
	RURAL FUNDS GROUP	60,734	116,305.61	
	SCENTRE GROUP	888,152	3,481,555.84	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	147,977	421,734.45	
	STOCKLAND	400,425	2,014,137.75	
	VICINITY CENTRES	531,994	1,361,904.64	
	VIVA ENERGY REIT	70,923	190,782.87	
オーストラリアドル 小計		4,652,063	22,022,764.62 (1,636,291,411)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	127,750	183,960.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	185,089	429,406.48	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	278,014	439,262.12	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	176,114	333,736.03	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	51,700	146,569.50	
ニュージーランドドル 小計		818,667	1,532,934.13 (110,095,329)	
香港ドル	CHAMPION REIT	311,000	1,536,340.00	
	FORTUNE REIT	225,000	2,067,750.00	
	LINK REIT	345,700	28,209,120.00	
	PROSPERITY REIT	180,000	547,200.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	175,000	890,750.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	259,000	1,364,930.00	
香港ドル 小計		1,495,700	34,616,090.00 (485,663,742)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	70,800	102,660.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	488,000	1,537,200.00	
	ASCOTT TRUST	302,696	399,558.72	
	CACHE LOGISTICS TRUST	159,000	115,275.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	485,500	1,038,970.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	470,400	1,232,448.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	114,800	187,124.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	140,800	230,912.00	
	ESR REIT	354,300	198,408.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	149,300	108,242.50	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	89,100	89,100.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	126,800	361,380.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	109,100	181,106.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	128,800	92,092.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	267,400	326,228.00	
	KEPPEL DC REIT	211,800	478,668.00	
	KEPPEL REIT	309,500	393,065.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	338,800	76,230.00	

		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	347,900	845,397.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	259,800	732,636.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	501,500	917,745.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	361,400	448,136.00	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	445,200	249,312.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	60,400	210,192.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	137,400	63,891.00	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	89,500	78,312.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	51,963.50	
		SPH REIT	146,700	159,903.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	212,500	155,125.00	
		SUNTEC REIT	378,400	703,824.00	
	シンガポールドル 小計		7,358,496	11,765,104.22 (948,267,400)	
	韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	30,791,000.00	
	韓国ウォン 小計		4,100	30,791,000.00 (2,875,879)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	29,365	622,831.65	
	イスラエルシュケル 小計		29,365	622,831.65 (19,644,110)	
合計				24,904,886,156 (24,904,886,156)	

(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	158銘柄	100.0%	73.8%
カナダドル	投資証券	25銘柄	100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券	26銘柄	100.0%	5.8%
英ポンド	投資証券	29銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券	25銘柄	100.0%	6.6%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	3.8%
韓国ウォン	投資証券	1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。

【中間財務諸表】

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

（１）　当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期中間計算期間(2020年 1月28日から2020年 7月27日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【りそなラップ型ファンド（安定型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2020年 1月27日現在	第5期中間計算期間末 2020年 7月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	215,489,268	314,763,959
親投資信託受益証券	30,381,306,096	30,915,694,752
流動資産合計	30,596,795,364	31,230,458,711
資産合計	30,596,795,364	31,230,458,711
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,027,316	27,051,036
未払受託者報酬	6,429,744	6,516,182
未払委託者報酬	90,016,275	91,226,440
未払利息	584	853
その他未払費用	1,366,236	1,270,561
流動負債合計	130,840,155	126,065,072
負債合計	130,840,155	126,065,072
純資産の部		
元本等		
元本	28,302,487,782	29,030,512,245
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,163,467,427	2,073,881,394
（分配準備積立金）	1,299,355,430	1,175,620,240
元本等合計	30,465,955,209	31,104,393,639
純資産合計	30,465,955,209	31,104,393,639
負債純資産合計	30,596,795,364	31,230,458,711

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自　2019年 1月26日 至　2019年 7月25日	第5期中間計算期間 自　2020年 1月28日 至　2020年 7月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	822,141,010	△56,611,344
営業収益合計	822,141,010	△56,611,344
営業費用		
支払利息	96,153	84,082
受託者報酬	5,718,495	6,516,182
委託者報酬	80,058,914	91,226,440
その他費用	1,219,443	1,292,503
営業費用合計	87,093,005	99,119,207
営業利益又は営業損失（△）	735,048,005	△155,730,551
経常利益又は経常損失（△）	735,048,005	△155,730,551
中間純利益又は中間純損失（△）	735,048,005	△155,730,551
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	48,026,776	△60,429,552
期首剰余金又は期首欠損金（△）	825,012,706	2,163,467,427
剰余金増加額又は欠損金減少額	209,946,561	219,787,721
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	209,946,561	219,787,721
剰余金減少額又は欠損金増加額	99,892,515	214,072,755
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	99,892,515	214,072,755
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,622,087,981	2,073,881,394

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

第4期 2020年 1月27日現在		第5期中間計算期間末 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	24,982,698,968円	期首元本額	28,302,487,782円
期中追加設定元本額	8,485,272,377円	期中追加設定元本額	3,551,373,988円
期中一部解約元本額	5,165,483,563円	期中一部解約元本額	2,823,349,525円
２．　計算期間の末日における受益権の総数	28,302,487,782口	２．　中間計算期間の末日における受益権の総数	29,030,512,245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	1.0764円	３．　中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0714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)	(10,764円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,714円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 1月27日現在	第5期中間計算期間末 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.中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。	3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

（1）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2020年 1月27日現在	第5期中間計算期間末 2020年 7月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	211,932,204	199,662,995
親投資信託受益証券	21,743,733,155	22,625,544,746
流動資産合計	21,955,665,359	22,825,207,741
資産合計	21,955,665,359	22,825,207,741
負債の部		
流動負債		
未払解約金	26,548,996	16,293,231
未払受託者報酬	4,387,207	4,599,375
未払委託者報酬	105,292,925	110,384,834
未払利息	574	541
その他未払費用	932,201	896,790
流動負債合計	137,161,903	132,174,771
負債合計	137,161,903	132,174,771
純資産の部		
元本等		
元本	19,342,581,547	21,008,549,321
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,475,921,909	1,684,483,649
（分配準備積立金）	1,431,144,793	1,330,751,800
元本等合計	21,818,503,456	22,693,032,970
純資産合計	21,818,503,456	22,693,032,970
負債純資産合計	21,955,665,359	22,825,207,741

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自　2019年 1月26日 至　2019年 7月25日	第5期中間計算期間 自　2020年 1月28日 至　2020年 7月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	724,455,518	△761,188,409
営業収益合計	724,455,518	△761,188,409
営業費用		
支払利息	67,470	70,306
受託者報酬	3,657,273	4,599,375
委託者報酬	87,774,504	110,384,834
その他費用	780,287	915,961
営業費用合計	92,279,534	115,970,476
営業利益又は営業損失（△）	632,175,984	△877,158,885
経常利益又は経常損失（△）	632,175,984	△877,158,885
中間純利益又は中間純損失（△）	632,175,984	△877,158,885
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	37,485,015	△54,774,647
期首剰余金又は期首欠損金（△）	696,141,594	2,475,921,909
剰余金増加額又は欠損金減少額	229,735,360	211,269,269
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	229,735,360	211,269,269
剰余金減少額又は欠損金増加額	54,279,075	180,323,291
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	54,279,075	180,323,291
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,466,288,848	1,684,483,649

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

第4期 2020年 1月27日現在		第5期中間計算期間末 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	15,118,454,328円	期首元本額	19,342,581,547円
期中追加設定元本額	6,629,563,738円	期中追加設定元本額	3,097,816,338円
期中一部解約元本額	2,405,436,519円	期中一部解約元本額	1,431,848,564円
２．　計算期間の末日における受益権の総数	19,342,581,547口	２．　中間計算期間の末日における受益権の総数	21,008,549,321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	1.1280円	３．　中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0802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)	(11,280円)	(10,000口当たり純資産額)	(10,802円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 1月27日現在	第5期中間計算期間末 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.中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。	3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

【りそなラップ型ファンド（成長型）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 2020年 1月27日現在	第5期中間計算期間末 2020年 7月27日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	164,330,020	147,769,036
親投資信託受益証券	11,066,872,049	11,737,469,141
流動資産合計	11,231,202,069	11,885,238,177
資産合計	11,231,202,069	11,885,238,177
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,861,815	6,861,094
未払受託者報酬	2,204,607	2,337,427
未払委託者報酬	58,422,111	61,941,795
未払利息	445	400
その他未払費用	468,401	455,710
流動負債合計	76,957,379	71,596,426
負債合計	76,957,379	71,596,426
純資産の部		
元本等		
元本	8,513,254,407	10,321,988,633
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	2,640,990,283	1,491,653,118
（分配準備積立金）	1,211,877,747	1,077,898,305
元本等合計	11,154,244,690	11,813,641,751
純資産合計	11,154,244,690	11,813,641,751
負債純資産合計	11,231,202,069	11,885,238,177

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自　2019年 1月26日 至　2019年 7月25日	第5期中間計算期間 自　2020年 1月28日 至　2020年 7月27日
営業収益		
有価証券売買等損益	636,503,593	△1,339,402,908
営業収益合計	636,503,593	△1,339,402,908
営業費用		
支払利息	35,807	38,464
受託者報酬	1,826,450	2,337,427
委託者報酬	48,400,900	61,941,795
その他費用	389,920	465,500
営業費用合計	50,653,077	64,783,186
営業利益又は営業損失（△）	585,850,516	△1,404,186,094
経常利益又は経常損失（△）	585,850,516	△1,404,186,094
中間純利益又は中間純損失（△）	585,850,516	△1,404,186,094
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	67,388,039	△197,201,752
期首剰余金又は期首欠損金（△）	907,354,175	2,640,990,283
剰余金増加額又は欠損金減少額	396,327,820	375,244,539
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	396,327,820	375,244,539
剰余金減少額又は欠損金増加額	146,519,174	317,597,362
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	146,519,174	317,597,362
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,675,625,298	1,491,653,118

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（中間貸借対照表に関する注記）

第4期 2020年 1月27日現在		第5期中間計算期間末 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	6,654,797,679円	期首元本額	8,513,254,407円
期中追加設定元本額	4,205,065,813円	期中追加設定元本額	2,922,426,981円
期中一部解約元本額	2,346,609,085円	期中一部解約元本額	1,113,692,755円
２．　計算期間の末日における受益権の総数	8,513,254,407口	２．　中間計算期間の末日における受益権の総数	10,321,988,633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	1.3102円	３．　中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.1445円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(13,102円)	(10,000口当たり純資産額)	(11,445円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第4期 2020年 1月27日現在	第5期中間計算期間末 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.中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	２.時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、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。	3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

「りそなラップ型ファンド」の各ファンドは「ＲＡＭ国内債券マザーファンド」、「ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「ＲＡＭ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、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

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

	2020年 7月27日現在
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	2020年 1月28日
期首元本額	75,458,660,146円
期中追加設定元本額	46,870,868,192円
期中一部解約元本額	41,572,462,398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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 7月27日現在
資産の部	
流動資産	
預金	216,071,761
コール・ローン	616,578,962
国債証券	181,204,034,121
派生商品評価勘定	1,427,365,794
未収利息	852,489,128
前払費用	305,542,680
流動資産合計	184,622,082,446
資産合計	184,622,082,446
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,018,338,301
未払金	4,019,096
未払解約金	50,563,000
未払利息	1,672
流動負債合計	2,072,922,069
負債合計	2,072,922,069
純資産の部	
元本等	
元本	170,226,237,794
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	12,322,922,583
元本等合計	182,549,160,377
純資産合計	182,549,160,377
負債純資産合計	184,622,082,446

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	為替予約取引

法	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5.その他財務諸表作成のための基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	2020年 1月28日
期首元本額	166,192,163,018円
期中追加設定元本額	135,214,307,935円
期中一部解約元本額	131,180,233,159円
期末元本額	170,226,237,794円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	13,735,889,965円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	6,828,599,239円
りそなラップ型ファンド（成長型）	811,810,372円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,080,428,359円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	217,074,357円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	50,655,609円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,038,446円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	4,477,606円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	468,714円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	151,368円
リスクコントロール・オープン	201,570,116円
FWりそな円建債券アクティブファンド	2,080,021,987円
FWりそな先進国債券インデックスファンド（為替ヘッジあり）	83,385,812,874円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	667,912,077円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	335,475,821円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	232,012,912円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	83,741,350円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	13,454,931,920円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	9,660,675,015円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	6,116,470,612円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	3,939,038,647円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	12,567,669,163円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	2,043,620,809円
りそなＦＴ　先進国債券インデックス・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	7,286,064,011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）	9,098,368円
りそなＤＡＡファンド（適格機関投資家専用）	5,330,613,848円
りそなＦＴ　ＲＣバランスファンド（適格機関投資家専用）	88,914,229円
２．　計算日における受益権の総数	
	170,226,237,794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	1.0724円
(10,000口当たり純資産額)	(10,724円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（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				
	売建	180,695,548,703	－	181,286,521,210	△590,972,507
	米ドル	82,198,646,827	－	80,792,071,980	1,406,574,847
	カナダドル	3,376,958,923	－	3,384,755,000	△7,796,077
	メキシコペソ	1,325,766,804	－	1,354,258,250	△28,491,446
	ユーロ	73,023,919,454	－	74,577,336,400	△1,553,416,946
	英ポンド	11,604,748,482	－	11,872,420,560	△267,672,078
	スウェーデンクローナ	507,807,174	－	528,266,980	△20,459,806
	ノルウェークローネ	364,647,621	－	381,208,140	△16,560,519
	デンマーククローネ	905,933,340	－	926,215,980	△20,282,640
	ポーランドズロチ	1,089,581,262	－	1,124,864,050	△35,282,788
	オーストラリアドル	4,007,327,741	－	4,075,393,440	△68,065,699
	シンガポールドル	766,733,011	－	760,498,720	6,234,291
	マレーシアリンギット	820,646,911	－	810,855,500	9,791,411
	イスラエルシュケル	702,831,153	－	698,376,210	4,454,943
合計		180,695,548,703	－	181,286,521,210	△590,972,507

（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。

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
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	2020年 1月28日
期首元本額	29,562,938,389円
期中追加設定元本額	8,638,788,191円
期中一部解約元本額	13,777,829,440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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（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。

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	2020年 1月28日
期首元本額	5,408,384,361円
期中追加設定元本額	2,406,907,756円
期中一部解約元本額	3,323,265,651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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

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
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	2020年 1月28日
期首元本額	34,456,230,681円
期中追加設定元本額	17,686,529,983円
期中一部解約元本額	27,758,169,886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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（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。

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
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	2020年 1月28日
期首元本額	40,465,219,618円
期中追加設定元本額	37,174,468,968円
期中一部解約元本額	31,465,552,725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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（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。

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	2020年 1月28日
期首元本額	7,682,410,355円
期中追加設定元本額	4,727,792,218円
期中一部解約元本額	5,493,249,247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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（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。

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	
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	2020年 1月28日
期首元本額	16,608,377,856円
期中追加設定元本額	7,434,689,430円
期中一部解約元本額	8,575,060,005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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）
デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

（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。

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	
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	2020年 1月28日
期首元本額	20,554,057,909円
期中追加設定元本額	13,610,072,479円
期中一部解約元本額	12,937,888,717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）
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。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（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。

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。

【りそなラップ型ファンド（安定型）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	31,263,800,117円
Ⅱ　負債総額	48,993,408円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,214,806,709円
Ⅳ　発行済口数	29,149,803,672口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0708円

【りそなラップ型ファンド（安定成長型）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	22,783,137,464円
Ⅱ　負債総額	14,587,275円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	22,768,550,189円
Ⅳ　発行済口数	21,110,844,062口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0785円

【りそなラップ型ファンド（成長型）】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	11,844,709,318円
Ⅱ　負債総額	2,545,763円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	11,842,163,555円
Ⅳ　発行済口数	10,370,262,582口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1419円

（参考）

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（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	184,926,867,989円
Ⅱ　負債総額	2,448,606,558円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	182,478,261,431円
Ⅳ　発行済口数	169,437,348,642口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0770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。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

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
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	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。
松井証券株式会社	11,945百万円	
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【その他】

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

独立監査人の監査報告書

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3月２３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

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定型）の２０１９年1月２６日から２０２０年1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。

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。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
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。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（安定型）の２０２０年1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すべ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。

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。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

２０２０年3月２３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

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定成長型）の２０１９年1月２６日から２０２０年1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。

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。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
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。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（安定成長型）の２０２０年１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すべ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。

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。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

２０２０年3月２３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

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（成長型）の２０１９年1月２６日から２０２０年1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。

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。

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、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。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。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に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るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。
監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。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、当監査法人は、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、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。
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。

監査意見
当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（成長型）の２０２０年1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すべ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。

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。

独 立 監 査 人 の 中 間 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

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定型）の２０２０年1月２８日から２０２０年7月２７日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（安定型）の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中間計算期間（２０２０年1月２８日から２０２０年7月２７日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

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

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（安定成長型）の２０２０年1月２８日から２０２０年7月２７日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（安定成長型）の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中間計算期間（２０２０年1月２８日から２０２０年7月２７日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

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

独 立 監 査 人 の 中 間 監 査 報 告 書

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

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　山 田 信 之　印

当監査法人は、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそなラップ型ファンド（成長型）の２０２０年1月２８日から２０２０年7月２７日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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

監査人の責任
当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。
中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。
当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見
当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなラップ型ファンド（成長型）の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中間計算期間（２０２０年1月２８日から２０２０年7月２７日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以　上

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