【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年11月17日提出
【計算期間】	第1特定期間(自 2020年3月31日至 2020年8月17日)
【ファンド名】	リスクコントロール・オープン
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡　明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【事務連絡者氏名】	塚田　光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

①　ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

②　ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国　内	株　式
	海　外	債　券
追加型投信	内　外	不動産投信
		その他資産（　　）
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年１回 年２回 年４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 中近東 （中東）	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 （投資信託証券（資産複合（債券、株式、不動産投信）資産配分変更型））		エマージング		
資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型				

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

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

＜商品分類の定義＞

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

◆「保証契約」の表記について
本書において、信託期間中の基準価額が、あらかじめ定められた価格(以下、本書において『確保ライン』といいます。)を下回った場合に、株式会社りそな銀行が『確保ライン』を下回る差額を信託財産に支払うことを約束する契約について「保証契約」ということがあります。
本契約は民法上の保証契約を意味するものではなく、保証類似行為として行われるものです。
また本契約は、株式会社りそな銀行がファンドの元本を保証するものではありません。

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

投資対象

- 主として複数のマザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)などへの分散投資を行います。
- RAMマネーマザーファンドを除く各マザーファンドは、各投資対象資産における代表的なインデックスの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

ファンドの特色

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

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

3　原則として、年4回の決算時に収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

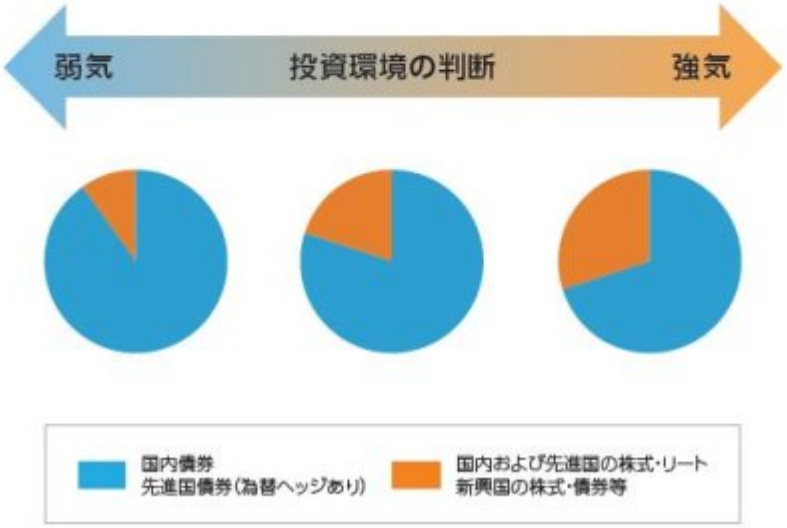
- 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
- 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。

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

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

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

投資環境の判断と投資割合のイメージ

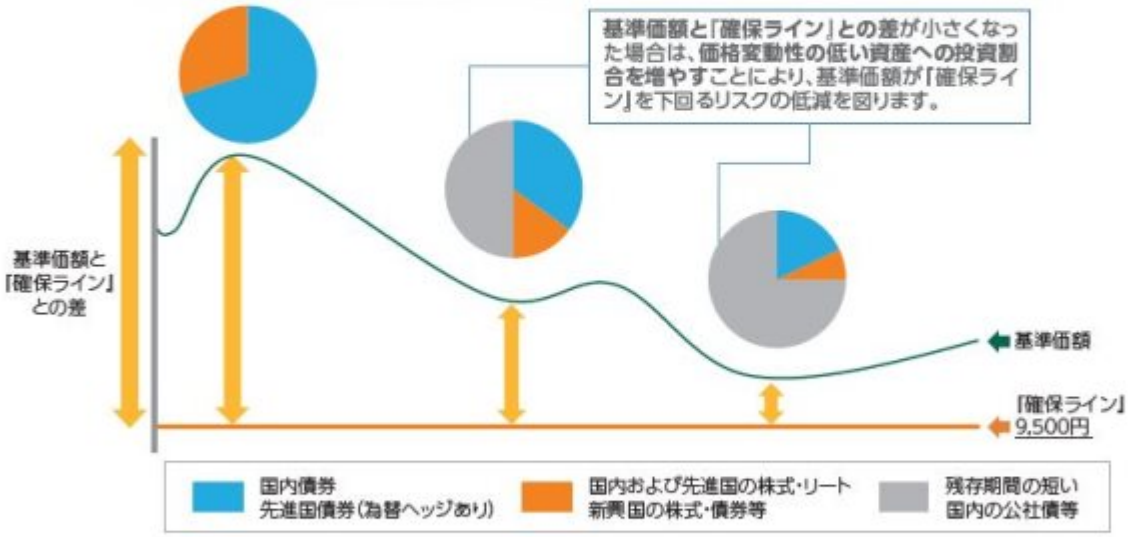


2 基準価額下落時においても、あらかじめ設定した『確保ライン』を上回る水準で運用を継続することを目指します。

Point

●投資環境の悪化等により基準価額が『確保ライン』に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。
●『確保ライン』は9,500円とし、信託期間を通じて変更は行いません。

「基準価額と『確保ライン』との差」と投資割合のイメージ



ご注意ください

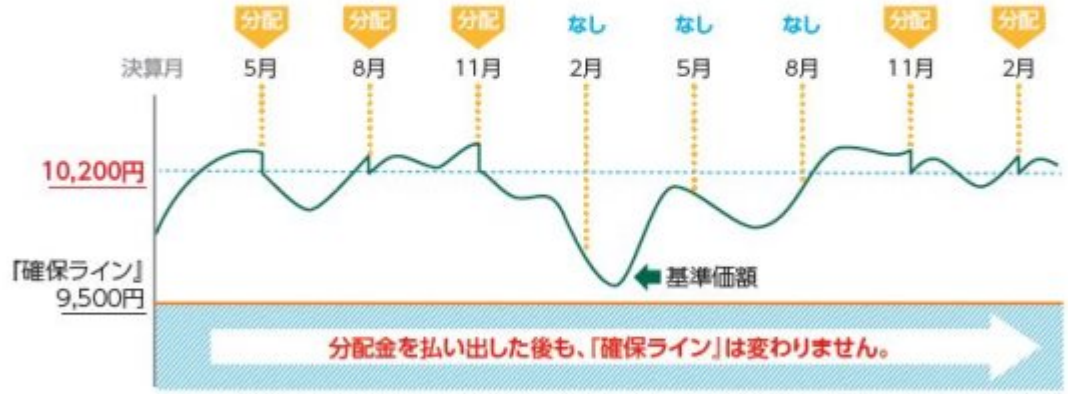
ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないよう運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。

3 原則として、年4回の決算時に収益分配方針に基づいて分配を行います。

Point

●ファンドの決算は毎年2月、5月、8月、11月の各月15日(休業日の場合は翌営業日)です。
原則として、各決算日における収益分配前の基準価額*1が10,200円を超過している場合、10,200円を超える額を目途として分配金額を決定します*2。
●分配金を払い出した後も、『確保ライン』は変わりません。

収益分配と『確保ライン』のイメージ

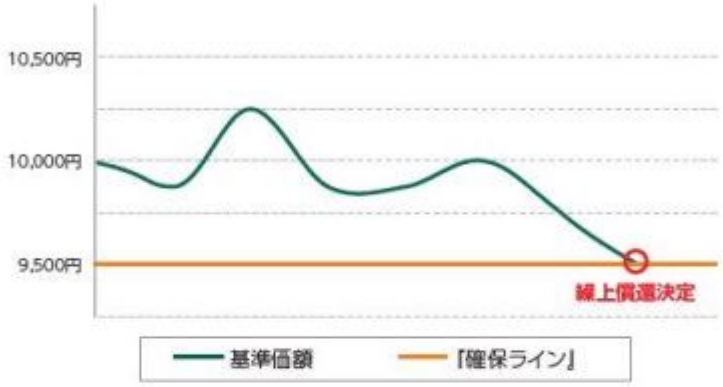


*1分配金額は各決算日の収益分配前の基準価額で決定されますので、それより前の基準価額水準は考慮されません。
*2決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額水準および市況動向により、委託会社の判断で、収益分配前の基準価額が10,200円を超過している額を必ずしも全額分配しない場合や、分配が行われない場合があります。
※投資者ごとに購入価額が異なるため、分配金の一部または全部が実質的に元本の一部払い戻しに相当する場合があります。詳しくは後述の「収益分配金に関する留意事項」をご確認ください。

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

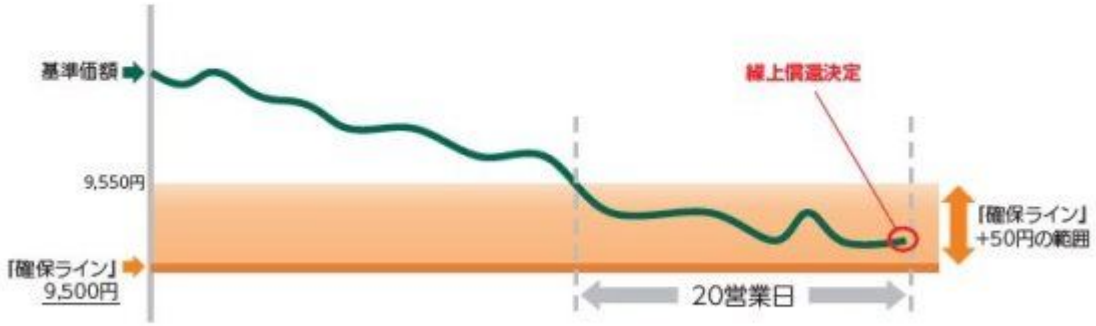
条件① 基準価額が「確保ライン」まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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



※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。
※保証契約には保証料がかかり、投資者に信託財産で間接的にご負担いただきます。詳しくは後述の「手続・手数料等　ファンドの費用・税金」をご確認ください。
※繰上償還について、詳しくは後述の「投資リスク　その他の留意点」をご確認ください。

運用プロセスのイメージ

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

分配方針

原則、毎年2月、5月、8月、11月の15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

②原則として、各決算日における収益分配前の基準価額が10,200円を超過している場合、10,200円を超える額を目途として分配金額を決定します。なお、決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額の動向等によっては実際の分配額がこれと異なる場合があります。

③分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

④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。

追加的記載事項

収益分配金に関する留意事項

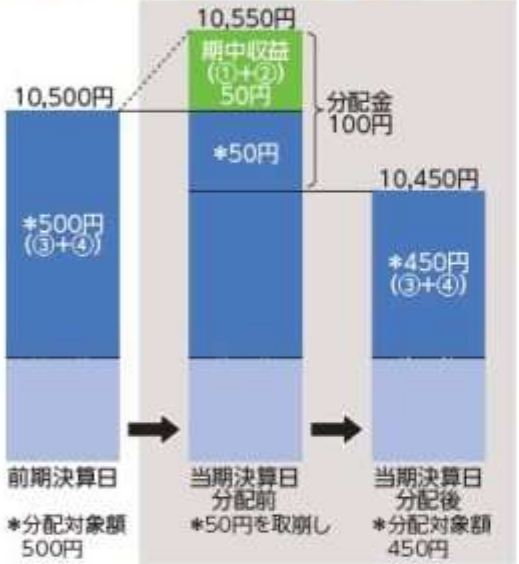
●投資信託の分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ

●分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。
また、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率を示すものではありません。

計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合

前期決算日から基準価額が上昇した場合



前期決算日から基準価額が下落した場合

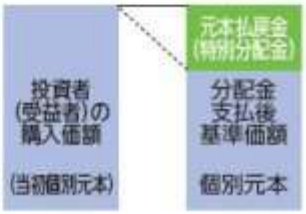
(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益、②経費控除後の評価益を含む売買益、③分配準備積立金、④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意ください。

●投資者（受益者）のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には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。

分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合

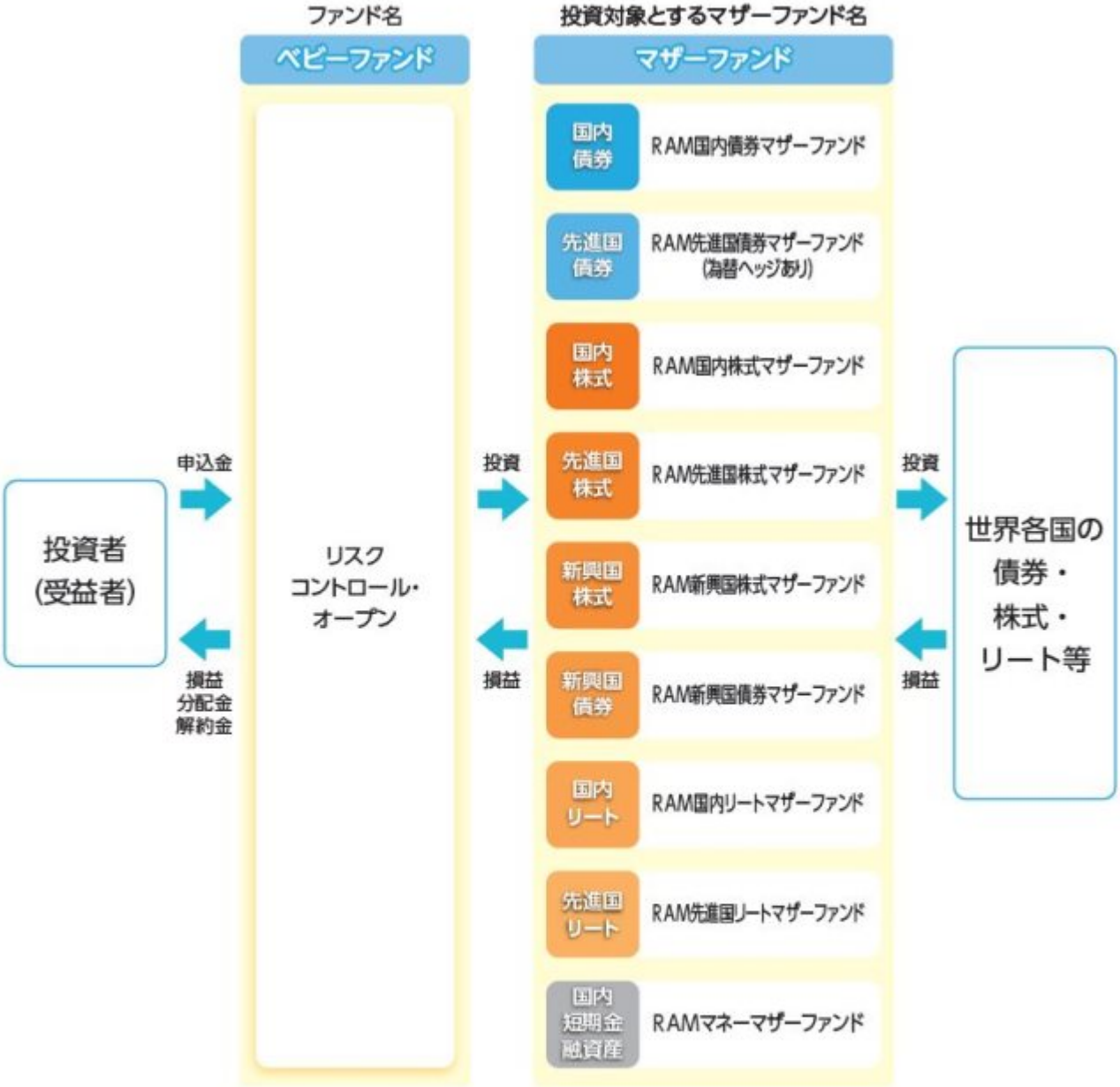
分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合



普　通　分　配　金：個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。
元本払戻金（特別分配金）：個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

インデックスの著作権等について

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

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

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

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

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

● **RAM新興国債券マザーファンド**
「JPモルガンGBI−EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI−EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI−EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・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国内リートマザーファンド**
「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

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

※RAMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

④　信託金限度額

・1,000億円を限度として信託金を追加することができます。

・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

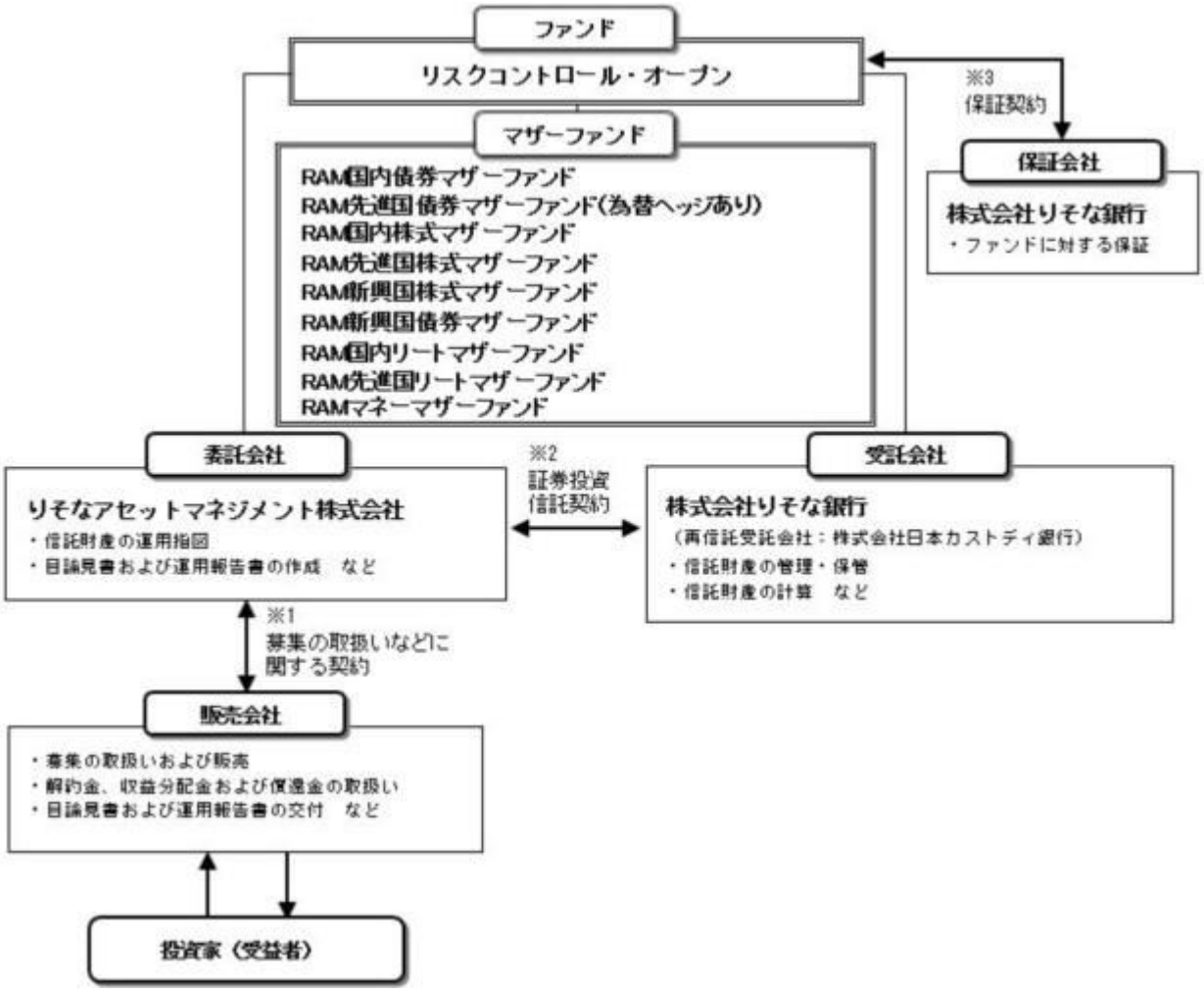
（2）【ファンドの沿革】

2020年3月31日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



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

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

※3 基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を保証会社が信託財産に支払うことを規定したもの。

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

② 委託会社の概況（2020年8月末現在）

1）資本金

1,000百万円

2）沿革

2015年8月3日：　りそなアセットマネジメント株式会社設立

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

3）大株主の状況

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

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

マザーファンド、ＲＡＭ先進国株式マザーファンド、ＲＡＭ新興国株式マザーファンド、ＲＡＭ新興国債券マザーファンド、ＲＡＭ国内リートマザーファンド、ＲＡＭ先進国リートマザーファンドおよびＲＡＭマネーマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします＊。

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

① 主として、次項に掲げる各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内債券および先進国債券（為替ヘッジあり）に投資を行い、安定した収益を確保しつつ、定量的手法による投資環境の判定基準に従って、国内および先進国の株式・不動産投資信託証券（リート）ならびに新興国の株式・債券等へも機動的に投資することにより、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。

② 各投資対象資産への投資は、各資産を投資対象とするマザーファンドを通じて行います。また、各マザーファンドは下記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

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

③ 実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

④ 投資環境の悪化等により、基準価額があらかじめ定めた閾値（以下『確保ライン』といいます。）に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、ＲＡＭマネーマザーファンド受益証券への投資を通じて残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。

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

⑤ 『確保ライン』は9,500円とし、信託期間を通じて変更は行いません。

⑥ 上記の方針に関わらず、以下の場合は、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替えた後、繰上償還を行います。

イ　基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

⑦ 一の会社（以下「保証会社」といいます。）との間で、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回ることがないよう保証契約を締結します。信託契約締結当初の保証会社は、株式会社りそな銀行です。保証会社は、基準価額が『確保ライン』まで下落した場合および償還時において、契約の規定に基づき基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。ただし、保証会社が破綻した場合は、保証契約の履行はありません。

⑧ 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新興国債券マザーファンド＞

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

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

＜ＲＡＭ国内リートマザーファンド＞

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

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

＜ＲＡＭ先進国リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

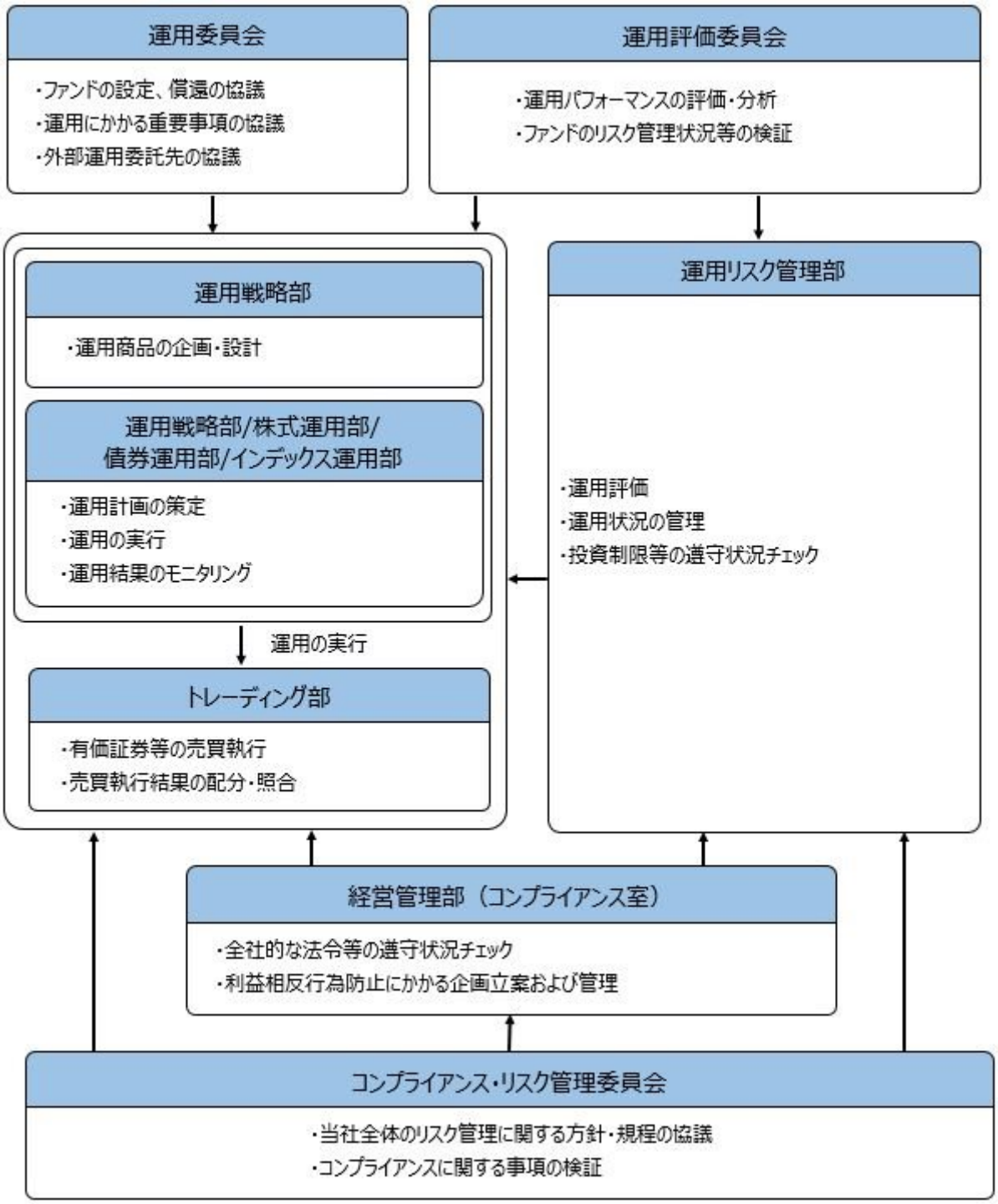
＜ＲＡＭマネーマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、金融市場の短期金利水準に応じた投資成果と流動性の確保を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の公社債を主要投資対象とします。
投資方針	①　主として、残存期間の短い国内の公社債への投資により利息等収益の獲得および流動性の確保を図ります。 ②　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	①　株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資は行いません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年2月15日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

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8月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（4）【分配方針】

① 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

2）原則として、各決算日における収益分配前の基準価額が10,200円を超過している場合、10,200円を超える額を目途として分配金額を決定します。なお、決算日にかけて基準価額が大きく上昇した場合など、基準価額の動向等によっては実際の分配額がこれと異なる場合があります。

3）分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

4）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け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

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

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

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

3．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限

月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

11）スワップ取引の運用指図および範囲

1．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

2．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

6．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下４．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資

産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5．前記３．および４．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

6．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

7．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13）直物為替先渡取引の運用指図

1．委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する直物為替先渡取引の一部の解約（反対の売買による解消を含む。）を指図するものとします。

4．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5．直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

6．委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

14）有価証券の貸付けの指図および範囲

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

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

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

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

2．前記１．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

15）特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合

には、制約されることがあります。

16）外国為替予約取引の指図および範囲

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

17）資金の借入れ

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

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

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

4．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

② 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

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

① 市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

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

（その他の留意点）

①当ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を割り込むことがないよう運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。

②当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証会社の破綻等により保証契約が履行されない場合には、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回る可能性があります。

③次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。
・基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
・基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
・保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき。

④また次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意の上、繰上償還することができます。
・信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき。
・繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき。
・やむを得ない事情が発生したとき。

⑤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。

⑥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。

⑦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。

⑧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。

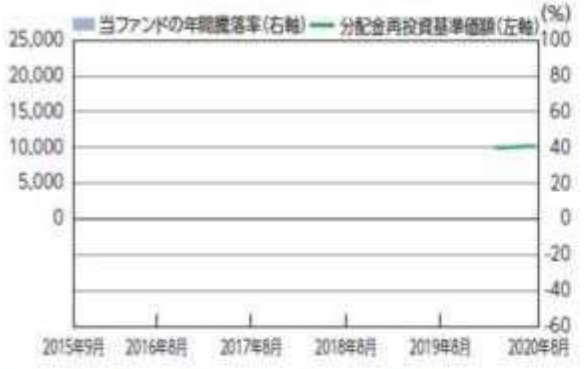
運用リスクを管理する部門は、運用業務等に係る情報のうち、経営に重要な影響を与えるまたは受益者の利益が著しく阻害される一切の事案についてはすみやかに、また法令・主な投資制限等の遵守状況については定期的に取締役会等に報告します。

※上記体制は2020年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

〔参考情報〕

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

2015年9月末～2020年8月末

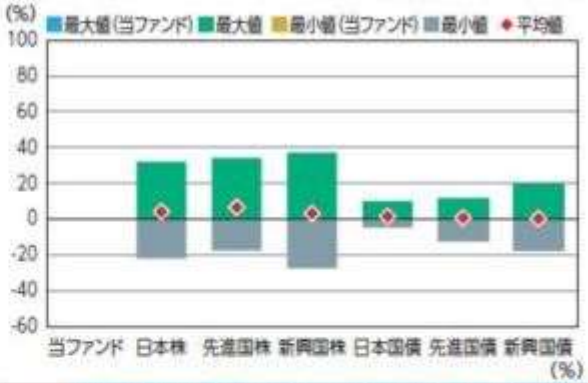


＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

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9月末～2020年8月末



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	—	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	—	4.2	6.6	3.2	1.6	0.7	0.3

＊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9月から2020年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
＊決算日に対応した数値とは異なります。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX、配当込み)
東証株価指数(TOPIX、配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

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

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

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

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

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

申込手数料につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。

・販売会社における申込手数料率は1.65%（税抜1.5%）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（当初申込期間中は１口当

たり１円）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、ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

＜当初設定日以降、2020年5月11日まで＞
年率1.243%（税抜1.13%）

＜2020年5月12日以降＞
1ヵ月に1度見直すものとし、前月末営業日における各マザーファンド（ＲＡＭマネーマザーファンドを除きます。）の時価総額のうち当ファンドが保有する部分の合計が、純資産総額に占める割合（以下「リスク性資産割合」といいます。）に応じ、以下の表に掲げる率を毎月初第5営業日より適用するものとします。

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

※税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
※基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の信託報酬の総額は0円とします。

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。
＜当初設定日以降、2020年5月11日まで＞

信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.55%	0.55%	0.03%

＜2020年5月12日以降＞

リスク性資産割合	信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
	委託会社	販売会社	受託会社
50%以上	0.55%	0.55%	0.03%
25%以上50%未満	0.24%	0.24%	0.03%
25%未満	0.12%	0.12%	0.03%

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

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、毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

④　保証料
保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率0.25%を乗じて得た額とします。
信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。
※上記①の信託報酬に保証料を加えた費用は最大で年率1.493%（税込）となります。
税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。
※基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の保証料の総額は0円とします。

（４）【その他の手数料等】

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)

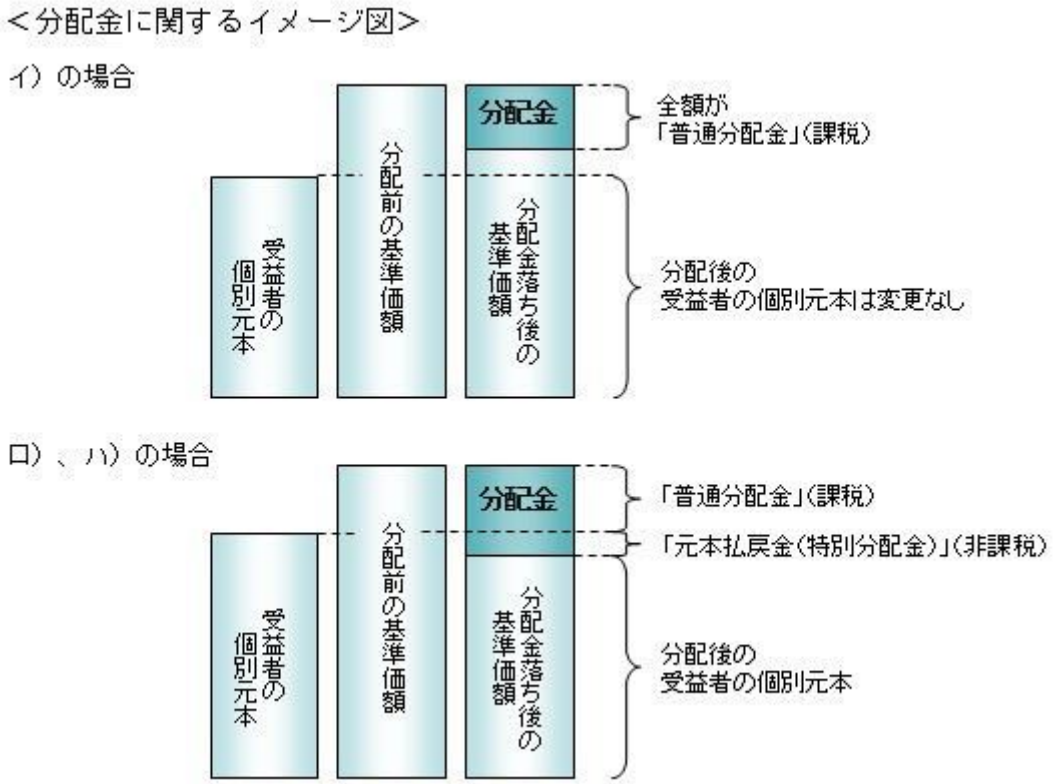
１）収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」（元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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。



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

5【運用状況】

【リスクコントロール・オープン】

以下の運用状況は2020年 8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	337,810,783	99.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	240,483	0.07
合計（純資産総額）		338,051,266	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）	195,304,406	1.0667	208,333,356	1.0637	207,745,296	61.45
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内債券マザーファンド	49,790,094	1.0497	52,264,756	1.0495	52,254,703	15.46
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	35,462,854	1.3972	49,548,844	1.4301	50,715,427	15.00
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	5,788,361	1.3309	7,703,825	1.3547	7,841,492	2.32
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	7,986,752	0.9616	7,680,307	0.9697	7,744,753	2.29
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	6,674,759	1.1415	7,619,892	1.1479	7,661,955	2.27
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	1,587,956	1.1684	1,855,419	1.2149	1,929,207	0.57
日本	親投資信託受益証券	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	1,853,809	1.0388	1,925,854	1.0346	1,917,950	0.57

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.93
合　　計	99.93

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特定期間末　(2020年 8月17日)	329	330	1.0202	1.0222
2020年 3月末日	210	―	1.0000	―
4月末日	260	―	1.0022	―
5月末日	276	―	1.0049	―
6月末日	311	―	1.0095	―
7月末日	334	―	1.0196	―
8月末日	338	―	1.0223	―

(注)分配付きの金額は、特定期間末の金額に当該特定期間末の分配金を加算した金額です。

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	0.0020

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	2.22

(注)各特定期間の収益率は、特定期間末の基準価額（分配落ち）に当該特定期間の分配金を加算し、当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（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特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	333,507,277	10,494,560

(注)第1特定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 8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	72,680,331,240	83.64
地方債証券	日本	4,456,805,200	5.13
特殊債券	日本	5,405,282,826	6.22
社債券	日本	3,501,790,000	4.03
	フランス	98,564,000	0.11
	オーストラリア	100,198,000	0.12
	小計	3,700,552,000	4.26
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	650,706,641	0.75
合計（純資産総額）		86,893,677,907	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	100.45	1,285,785,600	0.100	2022/9/20	1.48
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	100.78	1,078,367,400	0.100	2024/6/20	1.24
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	100.49	1,065,257,600	0.100	2022/12/20	1.23
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	1,000,000,000	100.72	1,007,262,400	100.54	1,005,490,000	0.100	2023/3/20	1.16
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	940,000,000	100.90	948,507,500	100.73	946,862,000	0.100	2024/3/20	1.09
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	910,000,000	101.30	921,897,300	100.72	916,570,200	0.100	2029/9/20	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	101.08	879,439,500	0.100	2027/3/20	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	100.60	855,125,500	0.100	2023/6/20	0.98
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	814,000,000	103.09	839,166,700	102.40	833,601,120	0.400	2025/9/20	0.96
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	790,000,000	101.42	801,240,300	100.96	797,639,300	0.100	2028/9/20	0.92
日本	国債証券	第３５７回利付国債（１０年）	760,000,000	101.22	769,287,600	100.64	764,932,400	0.100	2029/12/20	0.88
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	730,000,000	101.77	742,954,900	101.05	737,730,700	0.100	2028/3/20	0.85
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	720,000,000	100.90	726,484,900	100.67	724,888,800	0.100	2023/12/20	0.83
日本	国債証券	第３５８回利付国債（１０年）	720,000,000	100.85	726,151,400	100.61	724,449,600	0.100	2030/3/20	0.83
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	690,000,000	101.51	700,480,300	101.03	697,127,700	0.100	2026/9/20	0.80
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	680,000,000	101.50	690,230,500	101.01	686,929,200	0.100	2026/6/20	0.79
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	680,000,000	101.09	687,446,200	100.84	685,725,600	0.100	2024/12/20	0.79
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	650,000,000	100.83	655,418,000	100.64	654,179,500	0.100	2023/9/20	0.75
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	640,000,000	101.49	649,574,400	101.04	646,681,600	0.100	2026/12/20	0.74
日本	国債証券	第３５４回利付国債（１０年）	640,000,000	101.50	649,627,000	100.85	645,465,600	0.100	2029/3/20	0.74
日本	国債証券	第３５５回利付国債（１０年）	640,000,000	101.40	648,960,000	100.79	645,062,400	0.100	2029/6/20	0.74
日本	国債証券	第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	102.78	648,591,900	102.21	644,970,340	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	630,000,000	100.95	636,034,000	100.84	635,310,900	0.100	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第１４１回利付国債（５年）	620,000,000	101.03	626,409,800	100.81	625,040,600	0.100	2024/9/20	0.72
日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	590,000,000	101.35	597,975,200	100.91	595,386,700	0.100	2028/12/20	0.69
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	570,000,000	100.69	573,950,200	100.53	573,055,200	0.100	2030/6/20	0.66
日本	国債証券	第４１４回利付国債（２年）	570,000,000	100.46	572,645,000	100.43	572,456,700	0.100	2022/7/1	0.66
日本	国債証券	第４１３回利付国債（２年）	550,000,000	100.46	552,569,700	100.42	552,359,500	0.100	2022/6/1	0.64
日本	国債証券	第３３２回利付国債（１０年）	532,000,000	102.98	547,859,440	102.33	544,422,200	0.600	2023/12/20	0.63

日本	国債証券	第３４１回利付国債（１０年）	520,000,000	102.49	532,981,900	101.99	530,374,000	0.300	2025/12/20	0.61

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.64
地方債証券	5.13
特殊債券	6.22
社債券	4.26
合　　計	99.25

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 8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	80,885,597,015	44.14
	カナダ	3,521,425,622	1.92
	メキシコ	1,381,654,171	0.75
	ドイツ	14,083,278,735	7.69
	イタリア	17,581,125,306	9.59
	フランス	19,321,552,849	10.54
	オランダ	3,572,415,178	1.95
	スペイン	11,243,755,554	6.14
	ベルギー	4,800,974,305	2.62
	オーストリア	2,927,000,654	1.60
	フィンランド	1,116,980,776	0.61
	アイルランド	1,510,898,268	0.82
	イギリス	11,985,061,580	6.54
	スウェーデン	547,542,065	0.30
	ノルウェー	406,886,486	0.22
	デンマーク	967,409,515	0.53

	ポーランド	1,108,507,391	0.60
	オーストラリア	4,356,419,042	2.38
	シンガポール	804,014,236	0.44
	マレーシア	910,241,080	0.50
	イスラエル	733,266,497	0.40
	小計	183,766,006,325	100.29
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	△526,143,965	△0.29
合計（純資産総額）		183,239,862,360	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	―	187,306,269,140	△102.22

(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	13,317.50	839,002,752	14,156.92	891,886,343	3.000	2048/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,750,000	10,888.95	843,894,090	10,893.85	844,273,618	1.625	2022/12/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	11,054.98	840,179,201	11,103.13	843,838,097	1.500	2024/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,537.39	812,423,268	12,663.36	820,586,110	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,560,000	10,879.47	822,488,204	10,823.27	818,239,239	2.000	2022/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,500.57	768,642,350	10,447.10	764,727,902	0.625	2030/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,770,000	11,042.49	747,577,012	11,061.56	748,867,962	1.375	2025/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	12,143.23	712,807,707	12,416.42	728,844,347	2.875	2028/8/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,130,000	22,838.96	714,859,644	23,032.65	720,922,050	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	14,532.97	733,915,078	14,202.61	717,231,814	3.000	2048/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,270.72	710,055,379	11,319.61	713,135,745	1.500	2030/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,337.43	692,717,451	11,434.44	698,644,317	2.375	2024/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,331.95	695,522,222	12,275.05	692,313,178	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,590,000	11,669.90	652,347,518	12,376.71	691,858,254	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,330.43	661,697,465	11,434.44	667,771,327	2.500	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,445.02	635,198,752	11,804.02	655,123,298	2.250	2027/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,230,000	15,427.81	652,596,513	15,396.49	651,271,906	2.750	2027/10/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	19,151.86	658,824,063	18,880.88	649,502,572	5.500	2029/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,297.35	629,262,822	11,594.53	645,815,778	2.250	2025/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,299.03	619,187,023	11,405.63	625,028,574	2.750	2023/11/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,940,000	15,814.82	623,104,242	15,834.08	623,862,873	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,664.13	611,200,524	11,830.36	619,911,042	2.250	2027/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	10,955.03	613,481,779	10,900.43	610,424,536	2.375	2022/3/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,112.91	588,984,504	11,429.50	605,763,567	2.000	2025/8/15	0.33

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,010,000	11,029.08	552,557,148	12,086.76	605,547,051	2.375	2029/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,732.31	574,178,863	11,265.49	602,703,912	2.125	2024/3/31	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,090,000	14,600.77	597,171,642	14,710.78	601,670,916	1.500	2031/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,714.96	568,175,926	12,243.36	593,803,259	2.750	2028/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,530,000	10,526.26	582,102,294	10,535.58	582,618,018	0.125	2022/4/30	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,770,000	15,493.79	584,116,243	15,413.59	581,092,691	3.500	2026/4/25	0.32

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	100.29
合　　計	100.29

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	783,576,000.00	81,700,534,764	82,549,731,600	△45.05
	カナダドル	売建	44,592,000.00	3,466,641,941	3,586,980,480	△1.96
	メキシコペソ	売建	293,087,000.00	1,381,790,506	1,415,610,210	△0.77
	ユーロ	売建	615,823,000.00	76,332,430,475	77,267,311,810	△42.17
	英ポンド	売建	89,426,000.00	12,246,444,425	12,575,084,120	△6.86
	スウェーデンクローナ	売建	45,286,000.00	545,086,053	553,394,920	△0.30
	ノルウェークローネ	売建	34,571,000.00	398,501,709	414,852,000	△0.23
	デンマーククローネ	売建	58,693,000.00	978,219,190	989,563,980	△0.54
	ポーランドズロチ	売建	39,429,000.00	1,110,517,344	1,127,275,110	△0.62
	オーストラリアドル	売建	57,238,000.00	4,300,508,488	4,435,372,620	△2.42
	シンガポールドル	売建	10,625,000.00	809,526,439	824,181,250	△0.45
	マレーシアリンギット	売建	32,880,000.00	820,493,202	831,864,000	△0.45
	イスラエルシュケル	売建	23,439,000.00	717,976,777	735,047,040	△0.40

(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 8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	29,304,098,049	98.31
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	503,396,094	1.69
合計（純資産総額）		29,807,494,143	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	484,800,000	1.63

(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	144,200	7,219.94	1,041,115,610	7,006.00	1,010,265,200	3.39
日本	株式	ソニー	電気機器	81,000	7,574.00	613,494,622	8,309.00	673,029,000	2.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	100,700	4,983.16	501,804,240	6,598.00	664,418,600	2.23
日本	株式	キーエンス	電気機器	11,700	40,096.28	469,126,556	43,680.00	511,056,000	1.71
日本	株式	任天堂	その他製品	7,900	43,840.72	346,341,736	56,740.00	448,246,000	1.50
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	107,600	4,028.91	433,510,956	3,959.00	425,988,400	1.43
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	169,600	2,653.74	450,074,513	2,411.50	408,990,400	1.37
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	872,200	496.06	432,665,357	442.50	385,948,500	1.29
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	88,500	3,933.50	348,115,045	4,026.00	356,301,000	1.20
日本	株式	第一三共	医薬品	37,000	7,827.29	289,610,001	9,447.00	349,539,000	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,500	16,073.21	265,207,998	19,965.00	329,422,500	1.11
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	92,500	3,245.05	300,167,475	3,078.00	284,715,000	0.96
日本	株式	信越化学工業	化学	21,700	12,279.48	266,464,820	12,885.00	279,604,500	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	101,800	2,780.43	283,048,294	2,729.00	277,812,200	0.93
日本	株式	日本電産	電気機器	31,100	7,070.73	219,899,822	8,911.00	277,132,100	0.93
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	88,200	3,419.48	301,598,701	3,118.00	275,007,600	0.92
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	90,700	3,067.56	278,227,706	2,959.00	268,381,300	0.90
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	25,600	10,563.79	270,433,147	10,415.00	266,624,000	0.89
日本	株式	花王	化学	31,000	8,765.46	271,729,294	8,069.00	250,139,000	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,732,600	146.08	253,106,477	143.80	249,147,880	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	89,100	2,456.25	218,851,953	2,723.50	242,663,850	0.81
日本	株式	ＳＭＣ	機械	4,100	50,764.52	208,134,547	58,250.00	238,825,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	38,000	6,353.60	241,436,803	6,280.00	238,640,000	0.80

日本	株式	ファナック	電気機器	12,200	19,128.72	233,370,431	18,605.00	226,981,000	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,200	24,997.64	204,980,692	27,150.00	222,630,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	45,100	5,391.37	243,150,862	4,890.00	220,539,000	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	62,100	3,884.68	241,238,675	3,530.00	219,213,000	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	110,200	1,782.68	196,451,837	1,914.00	210,922,800	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	83,500	2,587.37	216,045,620	2,512.50	209,793,750	0.70
日本	株式	中外製薬	医薬品	40,400	4,217.72	170,395,999	4,721.00	190,728,400	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	2.49
		食料品	3.71
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21
		化学	7.05
		医薬品	6.46
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.55
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.57
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.55
		機械	5.37
		電気機器	14.80
		輸送用機器	7.16
		精密機器	2.56
		その他製品	2.65
		電気・ガス業	1.41
		陸運業	3.78
		海運業	0.14
		空運業	0.35
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	10.00
		卸売業	4.69
		小売業	4.90
		銀行業	4.89
		証券、商品先物取引業	0.82
		保険業	1.96
		その他金融業	1.10
		不動産業	1.96

		サービス業	5.42
合　　計			98.31

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	30	日本円	483,576,500	484,800,000	1.63

(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 8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	32,747,100,161	46.65
	カナダ	1,667,694,220	2.38
	パナマ	6,716,262	0.01
	ドイツ	1,499,363,499	2.14
	イタリア	293,295,277	0.42
	フランス	1,607,249,151	2.29
	オランダ	899,939,776	1.28
	スペイン	366,652,568	0.52
	ベルギー	147,014,027	0.21
	オーストリア	28,657,282	0.04
	ルクセンブルク	34,926,737	0.05
	フィンランド	199,089,813	0.28
	アイルランド	871,723,957	1.24
	ポルトガル	25,176,312	0.04
	イギリス	2,454,625,266	3.50
	スイス	1,734,587,530	2.47
	スウェーデン	487,567,769	0.69
	ノルウェー	86,068,696	0.12
	デンマーク	388,534,813	0.55
	ケイマン	95,492,873	0.14
	リベリア	11,584,138	0.02

	オーストラリア	1,001,489,412	1.43
	バミューダ	141,174,608	0.20
	ニュージーランド	51,852,961	0.07
	パプアニューギニア	3,577,732	0.01
	香港	398,294,583	0.57
	シンガポール	139,819,485	0.20
	イスラエル	98,941,974	0.14
	キュラソー	30,848,917	0.04
	ジャージー	173,819,447	0.25
	マン島	7,860,078	0.01
	小計	47,700,739,324	67.95
投資証券	アメリカ	966,570,908	1.38
	カナダ	7,731,615	0.01
	フランス	21,127,870	0.03
	イギリス	26,925,136	0.04
	オーストラリア	68,051,618	0.10
	香港	20,558,712	0.03
	シンガポール	27,605,912	0.04
	小計	1,138,571,771	1.62
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	21,364,027,265	30.43
合計（純資産総額）		70,203,338,360	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	16,965,823,669	24.17
	買建	ドイツ	4,361,261,904	6.21

(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(%)
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	34,864.91	1,624,182,256	52,598.87	2,450,318,489	3.49
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	76,921	18,605.96	1,431,189,221	24,117.95	1,855,177,417	2.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	4,506	228,839.99	1,031,153,022	358,413.64	1,615,011,898	2.30
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	25,641	23,589.87	604,868,046	30,940.01	793,332,991	1.13

アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	3,272	154,729.47	506,274,851	173,255.03	566,890,483	0.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,198	154,882.63	495,314,677	172,730.34	552,391,643	0.79
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	15,526.33	435,932,868	16,187.51	454,496,730	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	18,183	21,277.34	386,885,899	22,727.20	413,248,779	0.59
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	31,738	12,563.76	398,748,773	12,693.07	402,852,846	0.57
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	26,285	13,036.45	342,663,294	14,620.80	384,307,917	0.55
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	9,541	33,341.30	318,109,400	38,574.40	368,038,381	0.52
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,574	81,523.47	128,317,944	233,203.82	367,062,819	0.52
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,520	31,334.79	204,302,842	55,409.87	361,272,402	0.51
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	32,764	12,816.63	419,924,376	10,827.84	354,763,586	0.51
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	11,640	25,003.84	291,044,713	30,163.51	351,103,308	0.50
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	14,800	22,289.44	329,883,739	23,026.42	340,791,134	0.49
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	10,112	31,112.41	314,608,727	33,122.02	334,929,899	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	5,143	39,672.93	204,037,920	54,412.11	279,841,525	0.40
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	44,223	6,213.14	274,763,989	6,243.63	276,112,209	0.39
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	19,296	13,980.99	269,777,340	14,280.49	275,556,420	0.39
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	37,987.75	284,794,175	36,554.10	274,046,088	0.39
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	4,689	41,204.87	193,209,660	55,197.05	258,818,969	0.37
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	8,995	19,457.19	175,017,441	28,563.09	256,925,049	0.37
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	11,889	14,143.76	168,155,246	21,544.01	256,136,768	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	8,828.34	238,903,970	9,024.08	244,200,737	0.35
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	76,714	3,805.57	291,940,567	3,165.01	242,800,915	0.35
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	45,561	6,948.35	316,574,220	5,313.30	242,079,480	0.34
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	4,048.44	239,089,249	3,994.19	235,885,328	0.34
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	83,806	3,260.56	273,254,881	2,770.96	232,223,744	0.33

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	43,505	5,678.49	247,042,734	5,250.08	228,405,113	0.33

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	2.14
		素材	3.05
		資本財	4.27
		商業・専門サービス	0.85
		運輸	1.39
		自動車・自動車部品	1.06
		耐久消費財・アパレル	1.22
		消費者サービス	1.08
		メディア・娯楽	4.77
		小売	4.44
		食品・生活必需品小売り	1.06
		食品・飲料・タバコ	3.10
		家庭用品・パーソナル用品	1.54
		ヘルスケア機器・サービス	3.61
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.79
		銀行	3.63
		各種金融	2.95
		保険	2.16
		不動産	0.29
		ソフトウェア・サービス	8.68
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.49
		電気通信サービス	1.42
		公益事業	2.26
		半導体・半導体製造装置	2.71
投資証券	―	―	1.62
合　　計			69.57

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（%）
	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2009	買建	919	米ドル	144,264,160	15,199,671,897	161,027,180	16,965,823,669	24.17

株価指数先物取引	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002009	買建	1,885	ユーロ	33,931,223	4,257,350,550	34,759,400	4,361,261,904	6.21

(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新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 8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	25,715,199	0.26
	アルゼンチン	1,784,693	0.02
	メキシコ	110,729,616	1.10
	ブラジル	345,323,570	3.43
	チリ	37,259,303	0.37
	コロンビア	12,974,667	0.13
	ペルー	3,045,399	0.03
	オランダ	5,614,592	0.06
	ルクセンブルク	9,681,007	0.10
	ギリシャ	8,992,389	0.09
	トルコ	24,126,193	0.24
	チェコ	6,364,299	0.06
	ハンガリー	13,995,154	0.14
	ポーランド	49,199,674	0.49
	ロシア	223,543,789	2.22
	ケイマン	1,890,098,690	18.75
	バミューダ	55,529,327	0.55
	香港	167,628,704	1.66
	シンガポール	1,742,840	0.02
	マレーシア	141,605,845	1.41
	タイ	133,099,285	1.32
	フィリピン	59,330,519	0.59
	インドネシア	98,572,723	0.98
	韓国	801,544,309	7.95
	台湾	839,312,082	8.33
	中国	817,343,123	8.11
	インド	587,492,770	5.83
	カタール	53,744,776	0.53
	エジプト	8,537,060	0.08
	南アフリカ	245,504,065	2.44

	ジャージー	8,698,528	0.09
	アラブ首長国連邦	34,513,197	0.34
	マン島	2,135,355	0.02
	サウジアラビア	176,193,696	1.75
	小計	7,000,976,438	69.47
投資証券	メキシコ	2,868,464	0.03
	南アフリカ	2,596,116	0.03
	小計	5,464,580	0.05
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	3,071,793,142	30.48
合計（純資産総額）		10,078,234,160	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	3,052,690,088	30.29

(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	―	16,102	0.00
	売建	―	16,872,171	△0.17

(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	22,800.89	431,620,936	30,449.03	576,400,327	5.72
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	57,700	5,549.59	320,211,714	7,350.80	424,141,160	4.21
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	248,000	1,178.87	292,359,776	1,557.30	386,210,400	3.83
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	5,270.78	253,424,664	4,947.22	237,867,285	2.36
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	35,900	1,957.02	70,257,120	3,606.72	129,481,248	1.28
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,489	16,538.89	74,243,078	19,968.61	89,639,132	0.89
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,830	2,239.40	64,562,006	3,068.41	88,462,477	0.88
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	971,000	87.12	84,599,158	76.84	74,611,640	0.74
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	8,620	4,918.96	42,401,461	8,424.58	72,619,928	0.72
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	60,000	1,232.17	73,930,478	1,132.88	67,972,800	0.67

香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	62,000	899.75	55,784,796	758.88	47,050,560	0.47
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	34,508	1,115.74	38,502,274	1,356.11	46,796,730	0.46
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	16,605	3,303.77	54,859,234	2,730.71	45,343,481	0.45
ブラジル	株式	VALE SA	素材	37,400	1,050.11	39,274,361	1,194.50	44,674,487	0.44
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	32,945	1,590.45	52,397,456	1,272.22	41,913,353	0.42
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	782	37,130.12	29,035,760	53,119.35	41,539,333	0.41
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	5,510	8,458.76	46,607,800	6,947.53	38,280,945	0.38
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	615,000	75.01	46,136,832	61.20	37,638,000	0.37
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	2,750	13,426.09	36,921,770	13,591.44	37,376,460	0.37
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	72,632	691.89	50,253,802	512.68	37,237,101	0.37
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,247	17,556.44	21,892,892	29,736.89	37,081,914	0.37
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	5,076	9,789.81	49,693,105	7,206.62	36,580,823	0.36
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	4,247.33	35,376,066	4,304.26	35,850,182	0.36
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	319.55	40,200,035	277.45	34,903,210	0.35
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	107,200	180.31	19,330,282	306.00	32,803,200	0.33
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	469	33,823.88	15,863,403	67,778.69	31,788,210	0.32
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	3,900	5,508.51	21,483,213	8,105.34	31,610,845	0.31
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	15,000	1,565.71	23,485,713	2,054.92	30,823,800	0.31
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	51,487	691.76	35,616,864	594.06	30,586,625	0.30
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	9,183	3,141.55	28,848,926	3,245.89	29,807,077	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	4.01
		素材	5.04
		資本財	1.92
		商業・専門サービス	0.22
		運輸	0.96
		自動車・自動車部品	1.61
		耐久消費財・アパレル	0.88
		消費者サービス	1.19
		メディア・娯楽	6.53

		小売	9.89
		食品・生活必需品小売り	0.95
		食品・飲料・タバコ	2.60
		家庭用品・パーソナル用品	0.80
		ヘルスケア機器・サービス	0.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.04
		銀行	8.76
		各種金融	1.41
		保険	2.22
		不動産	1.60
		ソフトウェア・サービス	1.39
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.34
		電気通信サービス	2.43
		公益事業	1.42
		半導体・半導体製造装置	5.30
投資証券	—	—	0.05
合　　計			69.52

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	515	米ドル	25,974,250	2,736,646,975	28,973,900	3,052,690,088	30.29

(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	152.85	15,922	16,102	0.00
	米ドル	売建	160,000.00	17,064,000	16,856,000	△0.17
	ブラジルレアル	売建	689.44	13,202	13,478	△0.00
	オフショア人民元	売建	175.50	2,720	2,693	△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新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 8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	1,508,385,654	29.78
	アイルランド	3,514,180,592	69.38
	小計	5,022,566,246	99.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	42,595,298	0.84
合計（純資産総額）		5,065,161,544	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	594,705	6,095.11	3,624,794,260	5,909.11	3,514,180,592	69.38
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	452,767	3,486.86	1,578,735,406	3,331.48	1,508,385,654	29.78

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.16
合　　計	99.16

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年 8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	18,906,550,660	97.65
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	454,589,137	2.35
合計（純資産総額）		19,361,139,797	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（%）
不動産投信指数先物取引	買建	日本	449,107,500	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	2,006	801,632.18	1,608,074,163	639,000	1,281,834,000	6.62
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,072	729,318.22	1,511,147,364	594,000	1,230,768,000	6.36
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,135	301,372.59	944,803,097	347,000	1,087,845,000	5.62
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	5,958	142,572.04	849,444,244	163,600	974,728,800	5.03
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,700	171,140.63	1,146,642,273	135,900	910,530,000	4.70
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,956	277,535.55	820,395,089	277,000	818,812,000	4.23
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,128	208,033.66	858,762,981	157,700	650,985,600	3.36
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,916	203,436.49	796,657,309	159,900	626,168,400	3.23
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,968	337,584.56	664,366,420	314,000	617,952,000	3.19
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,929	169,408.06	496,196,217	185,200	542,450,800	2.80
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,431	172,425.09	764,015,606	118,000	522,858,000	2.70
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	6,094	85,058.95	518,349,280	74,900	456,440,600	2.36
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	689	681,074.83	469,260,560	653,000	449,917,000	2.32
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,038	508,898.14	528,236,270	399,500	414,681,000	2.14
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,290	439,678.74	567,185,585	320,500	413,445,000	2.14
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	641	782,048.93	501,293,369	629,000	403,189,000	2.08
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,354	285,713.12	386,855,566	285,000	385,890,000	1.99
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,937	165,545.33	320,661,308	178,000	344,786,000	1.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,675	63,557.78	424,248,248	49,200	328,410,000	1.70
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,434	170,853.97	415,858,564	132,100	321,531,400	1.66
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	594	516,174.07	306,607,398	530,000	314,820,000	1.63
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	904	346,606.44	313,332,226	327,000	295,608,000	1.53
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	2,614	102,975.83	269,178,836	105,800	276,561,200	1.43
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,664	46,716.03	404,747,732	31,700	274,648,800	1.42
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	441	787,453.83	347,267,142	614,000	270,774,000	1.40
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	1,352	204,683.03	276,731,468	189,000	255,528,000	1.32

日本	投資証券	日本リート投資法人	673	454,376.51	305,795,392	372,000	250,356,000	1.29
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	688	413,944.02	284,793,490	354,000	243,552,000	1.26
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,102	138,804.17	291,766,384	115,700	243,201,400	1.26
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,923	174,216.7	335,018,726	125,700	241,721,100	1.25

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	257	日本円	436,455,970	449,107,500	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 8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	15,954,795,922	74.29
	カナダ	404,478,447	1.88
	ドイツ	59,828,064	0.28
	イタリア	1,894,666	0.01
	フランス	444,210,756	2.07
	オランダ	38,716,495	0.18
	スペイン	110,315,616	0.51
	ベルギー	280,035,903	1.30
	アイルランド	31,813,025	0.15
	イギリス	1,134,542,603	5.28
	オーストラリア	1,473,006,191	6.86
	ニュージーランド	101,429,741	0.47
	香港	355,165,428	1.65
	シンガポール	912,862,357	4.25

	韓国	9,458,834	0.04
	イスラエル	12,573,180	0.06
	ガーンジー	50,608,243	0.24
	マン島	5,793,140	0.03
	小計	21,381,528,611	99.56
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	—	94,478,150	0.44
合計（純資産総額）		21,476,006,761	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	130,609	9,929.57	1,296,891,626	10,798.34	1,410,361,225	6.57
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,654	68,268.49	1,068,675,021	82,920.42	1,298,036,367	6.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,502	14,404.78	684,256,026	16,255.99	772,192,246	3.60
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,558	22,071.27	586,168,954	22,488.03	597,237,324	2.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	73,759	7,241.74	534,143,969	6,263.65	462,000,708	2.15
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,882	19,883.04	494,730,046	16,817.56	418,454,608	1.95
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	288,753	1,172.05	338,434,970	1,425.22	411,537,994	1.92
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	60,924	7,076.21	431,111,244	6,684.03	407,218,355	1.90
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,383	17,075.27	382,195,800	17,880.64	400,222,490	1.86
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	54,251	11,107.03	602,568,006	7,358.34	399,197,434	1.86
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	61,906	7,496.19	464,059,445	6,008.68	371,973,394	1.73
香港	投資証券	LINK REIT	365,700	990.42	362,198,004	835.72	305,622,804	1.42
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	65,946	4,941.13	325,848,311	4,500.97	296,821,574	1.38
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	95,586	3,053.24	291,847,089	3,019.61	288,633,168	1.34
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	95,145	3,291.34	313,155,276	2,998.54	285,296,621	1.33
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	209,516	1,274.35	266,997,780	1,339.92	280,735,231	1.31
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,287	15,532.22	268,505,570	15,711.28	271,600,953	1.26
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,516	28,639.18	329,808,850	23,246.63	267,708,196	1.25
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	64,778	3,742.21	242,413,032	4,075.32	263,991,390	1.23
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	22,725	10,865.61	246,921,020	11,246.12	255,568,222	1.19
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,144	13,214.05	266,183,883	12,343.97	248,657,085	1.16
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	25,454	12,279.32	312,557,812	9,370.71	238,522,266	1.11
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	30,393	7,955.65	241,796,309	7,556.41	229,662,249	1.07
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,104	7,121.42	228,626,124	6,954.81	223,277,336	1.04
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	82,646	2,441.51	201,781,675	2,421.17	200,100,247	0.93
アメリカ	投資証券	UDR INC	52,422	4,503.70	236,093,199	3,697.08	193,808,454	0.90
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	93,238	2,138.65	199,404,067	1,956.53	182,423,429	0.85
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	20,556	7,189.63	147,790,164	8,697.46	178,785,152	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,340	10,610.58	183,987,510	9,596.18	166,397,914	0.77
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	50,884	3,085.65	157,010,405	3,196.62	162,656,934	0.76

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	99.56
合　　計	99.56

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。

≪参考情報≫

運用実績

2020年8月31日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,223円	純資産総額	3.3億円

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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2020年5月15日	0円
2020年8月17日	20円
－	－
－	－
－	－
設定来累計	20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	15.5
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	61.5
RAM国内株式マザーファンド	2.3
RAM先進国株式マザーファンド	15.0
RAM新興国株式マザーファンド	2.3
RAM新興国債券マザーファンド	0.6
RAM国内リートマザーファンド	0.6
RAM先進国リートマザーファンド	2.3
現金等	0.1
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※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	79.8
米ドル	13.8
ユーロ	2.1
英ポンド	0.7
香港ドル	0.5
その他	3.0
合計	100.0

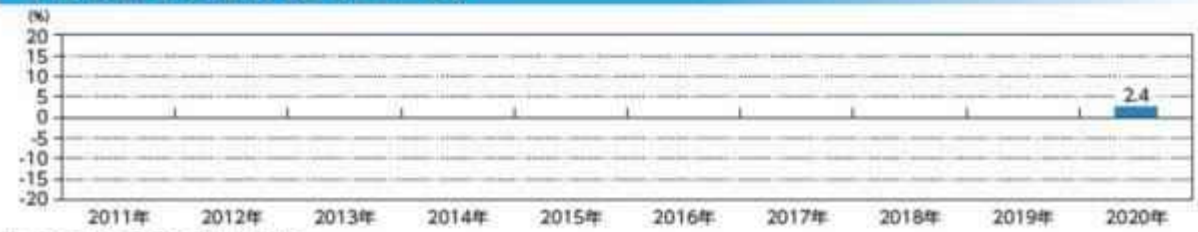
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

■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	1.5
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.2
	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.2
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2024/11/30	0.5
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.4
	日本	ソニー	—	2.3
	日本	ソフトバンクグループ	—	2.2
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	3.5
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	2.6
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.3
新興国株式	中国	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	5.7
	中国	TENCENT HOLDINGS LTD	—	4.2
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	3.8
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	69.4
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	—	29.8
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.6
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	—	6.4
	日本	日本プロロジスリート投資法人	—	5.6
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	6.6
	アメリカ	EQUINIX INC	—	6.0
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	—	3.6

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2020年3月31日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は3月31日から8月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法
販売会社所定の方法でお申し込みください。
（２）コースの選択
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞と＜分配金受取りコース（一般コース）＞の２通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。
＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞
収益分配金を自動的に再投資するコースです。
＜分配金受取りコース（一般コース）＞
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
（３）申込みの受付
販売会社の営業日に受け付けます。
（４）取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
（５）取得申込不可日
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日
（６）申込金額
取得申込受付日の翌営業日の基準価額（当初申込期間中は１口当たり１円）に取得申込口数を乗じて得た額に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
（７）申込単位
最低単位を1円または1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
（８）申込代金の支払い
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
（９）受付の中止および取消
委託会社は、金融商品取引所※における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。
※金融商品取引法第２条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第２条第８項第３号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

２【換金（解約）手続等】

（１）解約の受付
販売会社の営業日に受け付けます。
（２）取扱時間
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
（３）解約請求不可日
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日
（４）解約制限
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせくださ

い。

（５）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

（６）手取額

１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。

※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（７）解約単位

最低単位を1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（８）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

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

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

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

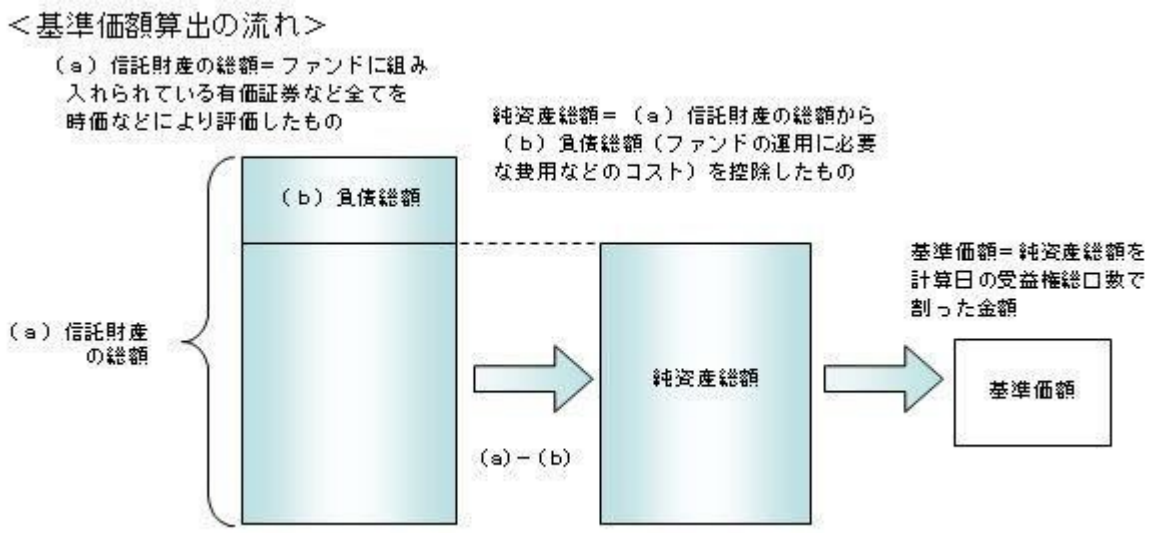
3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

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】

2030年2月15日までとします（2020年3月31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2月16日から5月15日、5月16日から8月15日、8月16日から11月15日および11月16日から翌年2月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。
※ただし、第１計算期間は2020年3月31日から2020年5月15日までとします。

（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）受益者の解約によりファンドの純資産総額が20億円を下回ることとなった場合
ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
ハ）やむを得ない事情が発生したとき

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

３）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
イ）基準価額が『確保ライン』まで下落した場合
ロ）基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して 50円未満となった場合
ハ）保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき
ニ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
ホ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
ヘ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
ト）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

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（保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。）すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

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

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

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。

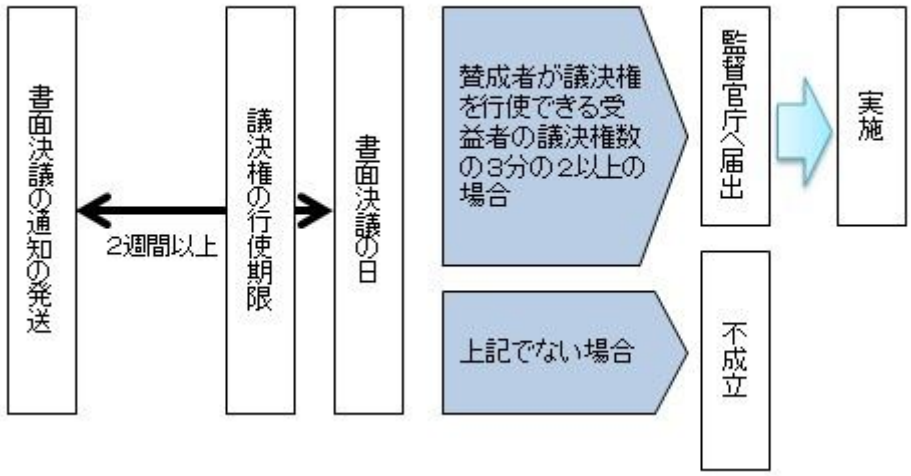
３）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

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、年２回（２月、８月）および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

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

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

⑦　関係法人との契約について

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

⑧　他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

４【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

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

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

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

（２）　当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。

（３）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1特定期間(2020年 3月31日から2020年 8月17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】

【リスクコントロール・オープン】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1特定期間 2020年 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,317,883
親投資信託受益証券	326,421,167
未収入金	13,792,000
流動資産合計	341,531,050
資産合計	341,531,050
負債の部	
流動負債	
未払収益分配金	646,025
未払解約金	10,257,000
未払受託者報酬	26,181
未払委託者報酬	857,721
未払利息	3
その他未払費用	205,035
流動負債合計	11,991,965
負債合計	11,991,965
純資産の部	
元本等	
元本	323,012,717
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,526,368
（分配準備積立金）	5,909,643
元本等合計	329,539,085
純資産合計	329,539,085
負債純資産合計	341,531,050

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1特定期間 自　2020年 3月31日 至　2020年 8月17日
営業収益	
有価証券売買等損益	8,336,646
営業収益合計	8,336,646
営業費用	
支払利息	8,988
受託者報酬	36,037
委託者報酬	1,199,529
その他費用	289,244
営業費用合計	1,533,798
営業利益又は営業損失（△）	6,802,848
経常利益又は経常損失（△）	6,802,848
当期純利益又は当期純損失（△）	6,802,848
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（△）	246,533
期首剰余金又は期首欠損金（△）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	636,238
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	636,238
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,160
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,160
分配金	646,025
期末剰余金又は期末欠損金（△）	6,526,368

（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	当ファンドの第1特定期間は、信託約款の規定により、設定日（2020年 3月31日）から2020年 8月17日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第1特定期間 2020年 8月17日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	210,830,933円
期中追加設定元本額	122,676,344円
期中一部解約元本額	10,494,560円
２． 特定期間の末日における受益権の総数	
	323,012,717口
３． 特定期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0202円
(10,000口当たり純資産額)	(10,202円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日	
分配金の計算過程	
第1期	
2020年 3月31日	
2020年 5月15日	
A 費用控除後の配当等収益額	10,119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	10,382円
C 収益調整金額	16,993円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	37,494円
F 当ファンドの期末残存口数	263,870,386口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1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

	第2期	
	2020年 5月16日	
	2020年 8月17日	
A	費用控除後の配当等収益額	1,078,414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	5,457,400円
C	収益調整金額	616,725円
D	分配準備積立金額	19,854円
E	当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	7,172,393円
F	当ファンドの期末残存口数	323,012,717口
G	10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	222円
H	10,000口当たり分配金額	20円
I	収益分配金金額(I=F×H/10,000)	646,025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1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、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。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第1特定期間 2020年 8月17日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日
	最終の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	6,974,654
合計	6,974,654

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	49,023,617	51,460,090	
	ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	192,424,240	205,258,936	
	ＲＡＭ国内株式マザーファンド	6,080,312	6,941,892	
	ＲＡＭ先進国株式マザーファンド	32,523,146	45,447,844	
	ＲＡＭ新興国株式マザーファンド	5,218,762	6,949,825	
	ＲＡＭ新興国債券マザーファンド	1,669,251	1,735,854	
	ＲＡＭ国内リートマザーファンド	1,493,805	1,743,419	
	ＲＡＭ先進国リートマザーファンド	7,151,488	6,883,307	
合計		295,584,621	326,421,167	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「ＲＡＭ国内債券マザーファンド」、「ＲＡＭ先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「ＲＡＭ国内株式マザーファンド」、「ＲＡＭ先進国株式マザーファンド」、「ＲＡＭ新興国株式マザーファンド」、「ＲＡＭ新興国債券マザーファンド」、「ＲＡＭ国内リートマザーファンド」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 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	523,076
コール・ローン	717,274,722
国債証券	72,372,779,130
地方債証券	4,460,560,200
特殊債券	5,408,809,677
社債券	3,601,749,000
未収利息	174,043,537
前払費用	15,918,008
流動資産合計	86,751,657,350
資産合計	86,751,657,350
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	16,978,000
未払利息	1,945
流動負債合計	116,979,945
負債合計	116,979,945
純資産の部	
元本等	
元本	82,535,308,236
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,099,369,169
元本等合計	86,634,677,405
純資産合計	86,634,677,405
負債純資産合計	86,751,657,350

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 8月17日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	61,425,296,985円
期中追加設定元本額	34,172,673,197円
期中一部解約元本額	13,062,661,946円
期末元本額	82,535,308,236円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	6,048,448,464円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	3,036,152,700円

りそなラップ型ファンド（成長型）	367,230,544円
ＤＣりそな　グローバルバランス	405,839,164円
つみたてバランスファンド	1,531,273,361円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,121,663,701円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	225,313,289円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	53,138,676円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,672,351円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	4,744,020円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	503,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	155,547円
リスクコントロール・オープン	49,023,617円
ＦＷりそな円建債券アクティブファンド	958,395,484円
ＦＷりそな国内債券インデックスファンド	46,600,991,852円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	801,476,648円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	354,419,400円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	245,974,402円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	89,125,229円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	3,235,607,713円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	2,882,677,336円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	1,807,607,985円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	1,065,693,534円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	2,989,628,776円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	488,952,580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）	9,536,252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	
	82,535,308,236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	1.0497円
(10,000口当たり純資産額)	(10,497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 8月17日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△1,121,896,790
地方債証券	△27,464,800
特殊債券	△38,246,847

社債券	△32,768,000
合計	△1,220,376,437

(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４０４回利付国債（２年）	420,000,000	421,003,800	
	第４０５回利付国債（２年）	150,000,000	150,394,500	
	第４０６回利付国債（２年）	250,000,000	250,707,500	
	第４０７回利付国債（２年）	330,000,000	330,999,900	
	第４０８回利付国債（２年）	610,000,000	611,970,300	
	第４０９回利付国債（２年）	180,000,000	180,617,400	
	第４１０回利付国債（２年）	410,000,000	411,480,100	
	第４１１回利付国債（２年）	440,000,000	441,856,800	
	第４１２回利付国債（２年）	330,000,000	331,432,200	
	第４１３回利付国債（２年）	550,000,000	552,359,500	
	第４１４回利付国債（２年）	570,000,000	572,451,000	
	第１２９回利付国債（５年）	450,000,000	451,129,500	
	第１３０回利付国債（５年）	240,000,000	240,739,200	
	第１３１回利付国債（５年）	360,000,000	361,314,000	
	第１３２回利付国債（５年）	40,000,000	40,169,200	
	第１３３回利付国債（５年）	1,280,000,000	1,286,028,800	
	第１３４回利付国債（５年）	1,060,000,000	1,065,586,200	
	第１３５回利付国債（５年）	860,000,000	865,013,800	
	第１３６回利付国債（５年）	850,000,000	855,440,000	
	第１３７回利付国債（５年）	650,000,000	654,433,000	

第１３８回利付国債（５年）	720,000,000	725,306,400	
第１３９回利付国債（５年）	890,000,000	896,888,600	
第１４０回利付国債（５年）	1,070,000,000	1,078,859,600	
第１４１回利付国債（５年）	620,000,000	625,344,400	
第１４２回利付国債（５年）	680,000,000	685,922,800	
第１４３回利付国債（５年）	450,000,000	453,937,500	
第１４４回利付国債（５年）	310,000,000	312,709,400	
第１回利付国債（４０年）	40,000,000	58,637,200	
第２回利付国債（４０年）	100,000,000	142,341,000	
第３回利付国債（４０年）	110,000,000	157,587,100	
第４回利付国債（４０年）	150,000,000	216,214,500	
第５回利付国債（４０年）	150,000,000	209,376,000	
第６回利付国債（４０年）	170,000,000	234,064,500	
第７回利付国債（４０年）	170,000,000	225,421,700	
第８回利付国債（４０年）	200,000,000	248,316,000	
第９回利付国債（４０年）	310,000,000	288,014,800	
第１０回利付国債（４０年）	300,000,000	327,000,000	
第１１回利付国債（４０年）	240,000,000	253,941,600	
第１２回利付国債（４０年）	250,000,000	239,167,500	
第１３回利付国債（４０年）	50,000,000	47,789,000	
第３１７回利付国債（１０年）	40,000,000	40,537,200	
第３１８回利付国債（１０年）	366,000,000	370,512,780	
第３１９回利付国債（１０年）	240,000,000	243,960,000	
第３２０回利付国債（１０年）	202,000,000	205,062,320	
第３２１回利付国債（１０年）	241,000,000	245,328,360	
第３２２回利付国債（１０年）	220,000,000	223,601,400	
第３２３回利付国債（１０年）	340,000,000	346,453,200	
第３２４回利付国債（１０年）	183,000,000	186,134,790	
第３２５回利付国債（１０年）	330,000,000	336,395,400	
第３２６回利付国債（１０年）	280,000,000	285,418,000	
第３２７回利付国債（１０年）	387,000,000	395,397,900	
第３２８回利付国債（１０年）	411,000,000	418,730,910	
第３２９回利付国債（１０年）	297,000,000	304,781,400	
第３３０回利付国債（１０年）	257,000,000	264,332,210	
第３３１回利付国債（１０年）	90,000,000	92,009,700	
第３３２回利付国債（１０年）	532,000,000	544,842,480	
第３３３回利付国債（１０年）	225,000,000	230,791,500	
第３３４回利付国債（１０年）	261,000,000	268,193,160	
第３３５回利付国債（１０年）	345,000,000	353,645,700	
第３３６回利付国債（１０年）	210,000,000	215,491,500	
第３３７回利付国債（１０年）	170,000,000	172,963,100	
第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	645,235,360	

第３３９回利付国債（１０年）	385,000,000	393,974,350	
第３４０回利付国債（１０年）	814,000,000	834,179,060	
第３４１回利付国債（１０年）	520,000,000	530,738,000	
第３４２回利付国債（１０年）	190,000,000	191,919,000	
第３４３回利付国債（１０年）	680,000,000	687,174,000	
第３４４回利付国債（１０年）	690,000,000	697,596,900	
第３４５回利付国債（１０年）	640,000,000	647,334,400	
第３４６回利付国債（１０年）	870,000,000	880,361,700	
第３４７回利付国債（１０年）	200,000,000	202,404,000	
第３４８回利付国債（１０年）	470,000,000	475,522,500	
第３４９回利付国債（１０年）	390,000,000	394,598,100	
第３５０回利付国債（１０年）	730,000,000	738,614,000	
第３５１回利付国債（１０年）	470,000,000	475,358,000	
第３５２回利付国債（１０年）	790,000,000	798,650,500	
第３５３回利付国債（１０年）	590,000,000	596,159,600	
第３５４回利付国債（１０年）	640,000,000	646,048,000	
第３５５回利付国債（１０年）	640,000,000	645,651,200	
第３５６回利付国債（１０年）	910,000,000	917,434,700	
第３５７回利付国債（１０年）	760,000,000	765,662,000	
第３５８回利付国債（１０年）	720,000,000	724,816,800	
第３５９回利付国債（１０年）	270,000,000	271,584,900	
第１回利付国債（３０年）	60,000,000	75,135,000	
第７回利付国債（３０年）	40,000,000	50,077,200	
第１１回利付国債（３０年）	50,000,000	59,574,000	
第１２回利付国債（３０年）	40,000,000	49,822,000	
第１３回利付国債（３０年）	90,000,000	111,193,200	
第１４回利付国債（３０年）	60,000,000	77,510,400	
第１５回利付国債（３０年）	160,000,000	209,411,200	
第１６回利付国債（３０年）	100,000,000	131,249,000	
第１７回利付国債（３０年）	50,000,000	65,152,000	
第１８回利付国債（３０年）	60,000,000	77,527,800	
第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	129,515,000	
第２０回利付国債（３０年）	100,000,000	132,815,000	
第２１回利付国債（３０年）	90,000,000	117,169,200	
第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	66,776,500	
第２３回利付国債（３０年）	160,000,000	214,193,600	
第２４回利付国債（３０年）	100,000,000	134,284,000	
第２５回利付国債（３０年）	100,000,000	131,356,000	
第２６回利付国債（３０年）	145,000,000	193,263,250	
第２７回利付国債（３０年）	215,000,000	291,656,100	
第２８回利付国債（３０年）	110,000,000	150,049,900	
第２９回利付国債（３０年）	70,000,000	94,735,900	
第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	254,877,400	

第３１回利付国債（３０年）	130,000,000	172,881,800	
第３２回利付国債（３０年）	215,000,000	291,045,500	
第３３回利付国債（３０年）	230,000,000	299,266,800	
第３４回利付国債（３０年）	255,000,000	342,952,050	
第３５回利付国債（３０年）	316,000,000	413,931,560	
第３６回利付国債（３０年）	285,000,000	374,492,850	
第３７回利付国債（３０年）	320,000,000	415,315,200	
第３８回利付国債（３０年）	220,000,000	281,758,400	
第３９回利付国債（３０年）	180,000,000	234,781,200	
第４０回利付国債（３０年）	155,000,000	199,184,300	
第４１回利付国債（３０年）	195,000,000	246,743,250	
第４２回利付国債（３０年）	190,000,000	240,640,700	
第４３回利付国債（３０年）	100,000,000	126,774,000	
第４４回利付国債（３０年）	180,000,000	228,405,600	
第４５回利付国債（３０年）	220,000,000	269,491,200	
第４６回利付国債（３０年）	220,000,000	269,643,000	
第４７回利付国債（３０年）	230,000,000	287,486,200	
第４８回利付国債（３０年）	253,000,000	304,781,510	
第４９回利付国債（３０年）	230,000,000	277,177,600	
第５０回利付国債（３０年）	250,000,000	265,505,000	
第５１回利付国債（３０年）	230,000,000	216,501,300	
第５２回利付国債（３０年）	230,000,000	227,375,700	
第５３回利付国債（３０年）	220,000,000	222,530,000	
第５４回利付国債（３０年）	230,000,000	243,901,200	
第５５回利付国債（３０年）	170,000,000	180,149,000	
第５６回利付国債（３０年）	220,000,000	232,966,800	
第５７回利付国債（３０年）	230,000,000	243,374,500	
第５８回利付国債（３０年）	350,000,000	370,069,000	
第５９回利付国債（３０年）	220,000,000	226,870,600	
第６０回利付国債（３０年）	190,000,000	205,429,900	
第６１回利付国債（３０年）	220,000,000	226,424,000	
第６２回利付国債（３０年）	220,000,000	214,629,800	
第６３回利付国債（３０年）	210,000,000	199,182,900	
第６４回利付国債（３０年）	180,000,000	170,449,200	
第６５回利付国債（３０年）	150,000,000	141,807,000	
第６６回利付国債（３０年）	230,000,000	217,347,700	
第６７回利付国債（３０年）	100,000,000	99,621,000	
第５２回利付国債（２０年）	190,000,000	194,637,900	
第５３回利付国債（２０年）	20,000,000	20,597,000	
第５４回利付国債（２０年）	180,000,000	185,616,000	
第５５回利付国債（２０年）	100,000,000	103,391,000	
第５６回利付国債（２０年）	10,000,000	10,391,500	

第５７回利付国債（２０年）	110,000,000	114,104,100	
第５８回利付国債（２０年）	100,000,000	104,244,000	
第５９回利付国債（２０年）	40,000,000	41,712,800	
第６０回利付国債（２０年）	30,000,000	31,073,400	
第６１回利付国債（２０年）	50,000,000	51,459,500	
第６２回利付国債（２０年）	80,000,000	82,096,000	
第６３回利付国債（２０年）	60,000,000	63,280,800	
第６４回利付国債（２０年）	120,000,000	127,498,800	
第６５回利付国債（２０年）	380,000,000	405,669,000	
第６７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,447,400	
第６８回利付国債（２０年）	90,000,000	97,485,300	
第６９回利付国債（２０年）	60,000,000	64,774,200	
第７０回利付国債（２０年）	110,000,000	120,642,500	
第７１回利付国債（２０年）	100,000,000	108,904,000	
第７２回利付国債（２０年）	210,000,000	229,021,800	
第７３回利付国債（２０年）	180,000,000	196,475,400	
第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	110,085,000	
第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	109,164,000	
第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,925,000	
第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	54,795,000	
第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	22,015,200	
第８０回利付国債（２０年）	90,000,000	99,504,900	
第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	33,189,300	
第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	188,941,400	
第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	11,169,000	
第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	133,384,800	
第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	168,301,500	
第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	113,323,000	
第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	101,485,800	
第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	210,764,950	
第８９回利付国債（２０年）	120,000,000	136,008,000	
第９０回利付国債（２０年）	170,000,000	193,662,300	
第９１回利付国債（２０年）	80,000,000	91,624,800	
第９２回利付国債（２０年）	255,000,000	290,327,700	
第９３回利付国債（２０年）	80,000,000	90,987,200	
第９４回利付国債（２０年）	140,000,000	160,154,400	
第９５回利付国債（２０年）	185,000,000	215,125,400	
第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	80,437,000	
第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	150,919,600	
第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	80,766,000	
第９９回利付国債（２０年）	85,000,000	98,498,850	
第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	176,872,340	
第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	23,731,400	

第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	172,818,250	
第１０３回利付国債（２０年）	100,000,000	118,399,000	
第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	11,682,600	
第１０５回利付国債（２０年）	12,000,000	14,078,640	
第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	47,253,200	
第１０７回利付国債（２０年）	80,000,000	94,206,400	
第１０８回利付国債（２０年）	220,000,000	255,391,400	
第１０９回利付国債（２０年）	80,000,000	93,130,400	
第１１０回利付国債（２０年）	195,000,000	230,357,400	
第１１１回利付国債（２０年）	50,000,000	59,722,000	
第１１２回利付国債（２０年）	205,000,000	243,048,000	
第１１３回利付国債（２０年）	85,000,000	101,133,850	
第１１４回利付国債（２０年）	160,000,000	191,024,000	
第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	120,322,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	169,038,800	
第１１７回利付国債（２０年）	225,000,000	269,518,500	
第１１８回利付国債（２０年）	131,000,000	156,161,170	
第１１９回利付国債（２０年）	150,000,000	175,870,500	
第１２０回利付国債（２０年）	200,000,000	230,574,000	
第１２１回利付国債（２０年）	205,000,000	243,074,650	
第１２２回利付国債（２０年）	190,000,000	223,381,100	
第１２３回利付国債（２０年）	265,000,000	320,385,000	
第１２４回利付国債（２０年）	140,000,000	167,822,200	
第１２５回利付国債（２０年）	120,000,000	146,781,600	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	120,218,000	
第１２７回利付国債（２０年）	70,000,000	83,416,900	
第１２８回利付国債（２０年）	225,000,000	268,710,750	
第１２９回利付国債（２０年）	180,000,000	213,037,200	
第１３０回利付国債（２０年）	180,000,000	213,562,800	
第１３１回利付国債（２０年）	170,000,000	199,835,000	
第１３２回利付国債（２０年）	170,000,000	200,273,600	
第１３３回利付国債（２０年）	245,000,000	291,373,600	
第１３４回利付国債（２０年）	205,000,000	244,355,900	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	47,222,000	
第１３６回利付国債（２０年）	110,000,000	128,603,200	
第１３７回利付国債（２０年）	170,000,000	201,116,800	
第１３８回利付国債（２０年）	90,000,000	104,374,800	
第１３９回利付国債（２０年）	180,000,000	210,848,400	
第１４０回利付国債（２０年）	380,000,000	450,478,600	
第１４１回利付国債（２０年）	185,000,000	219,739,300	
第１４２回利付国債（２０年）	150,000,000	179,985,000	
第１４３回利付国債（２０年）	245,000,000	288,347,850	

	第１４４回利付国債（２０年）	230,000,000	267,858,000	
	第１４５回利付国債（２０年）	405,000,000	482,549,400	
	第１４６回利付国債（２０年）	380,000,000	453,579,400	
	第１４７回利付国債（２０年）	375,000,000	443,501,250	
	第１４８回利付国債（２０年）	405,000,000	474,323,850	
	第１４９回利付国債（２０年）	380,000,000	445,618,400	
	第１５０回利付国債（２０年）	400,000,000	464,188,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	445,000,000	504,567,700	
	第１５２回利付国債（２０年）	440,000,000	499,175,600	
	第１５３回利付国債（２０年）	290,000,000	333,326,000	
	第１５４回利付国債（２０年）	208,000,000	236,217,280	
	第１５５回利付国債（２０年）	350,000,000	387,348,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	430,000,000	436,725,200	
	第１５７回利付国債（２０年）	240,000,000	236,013,600	
	第１５８回利付国債（２０年）	260,000,000	267,568,600	
	第１５９回利付国債（２０年）	330,000,000	344,345,100	
	第１６０回利付国債（２０年）	350,000,000	370,653,500	
	第１６１回利付国債（２０年）	270,000,000	281,402,100	
	第１６２回利付国債（２０年）	280,000,000	291,757,200	
	第１６３回利付国債（２０年）	300,000,000	312,258,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	490,000,000	501,760,000	
	第１６５回利付国債（２０年）	290,000,000	296,554,000	
	第１６６回利付国債（２０年）	490,000,000	517,415,500	
	第１６７回利付国債（２０年）	290,000,000	295,710,100	
	第１６８回利付国債（２０年）	350,000,000	350,301,000	
	第１６９回利付国債（２０年）	280,000,000	274,853,600	
	第１７０回利付国債（２０年）	370,000,000	362,792,400	
	第１７１回利付国債（２０年）	270,000,000	264,440,700	
	第１７２回利付国債（２０年）	330,000,000	328,805,400	
	第１７３回利付国債（２０年）	180,000,000	179,011,800	
	国債証券合計	67,233,000,000	72,372,779,130	
地方債証券	第１４回東京都公募公債	100,000,000	116,797,000	
	第７０５回東京都公募公債	100,000,000	101,646,000	
	第７２３回東京都公募公債	100,000,000	102,303,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	102,341,000	
	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	100,030,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	99,815,000	
	平成２９年度第６回北海道公募公債	100,000,000	99,945,000	
	第２１１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,837,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,055,000	
	第１６４回大阪府公募公債	100,000,000	99,885,000	
	第３７６回大阪府公募公債	110,000,000	112,701,600	

	第４５１回大阪府公募公債	100,000,000	99,106,000	
	平成２７年度第１３回京都府公募公債	100,000,000	100,222,000	
	平成２９年度第４回京都府公募公債	100,000,000	100,782,000	
	平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	100,685,000	
	平成２６年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	102,216,000	
	平成３０年度第１４回静岡県公募公債	100,000,000	100,339,000	
	平成２４年度第５回愛知県公募公債	100,000,000	101,613,000	
	平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	99,970,000	
	平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	101,037,000	
	平成２９年度第３回広島県公募公債	100,000,000	100,530,000	
	平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	100,809,000	
	第８回埼玉県公募公債	100,000,000	118,562,000	
	第１６回埼玉県公募公債	100,000,000	112,253,000	
	平成２６年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	102,213,000	
	平成２７年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,734,000	
	第１９回千葉県公募公債	100,000,000	111,585,000	
	平成２９年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,182,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,654,000	
	第１２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,435,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,484,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,167,000	
	第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,864,000	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,159,000	
	第１７回名古屋市公募公債	100,000,000	111,908,000	
	第２６回横浜市公募公債	100,000,000	118,316,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	100,000,000	102,198,000	
	平成２９年度第２回福岡市公募公債	100,000,000	99,982,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,129,000	
	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	121,185,600	
	平成２９年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,011,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	100,763,000	
	平成２９年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	101,111,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,460,560,200	
特殊債券	第２８回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,056,000	
	第４９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,158,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,240,000	
	第１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,354,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	108,548,000	
	第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,835,180	
	第２２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	129,846,070	

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	102,030,000	
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	102,351,000	
第２５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,851,040	
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	135,320,850	
第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,723,000	
第３３０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,871,000	
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	101,126,000	
第３４５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,536,000	
第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	126,511,000	
第１３回公営企業債券	100,000,000	110,322,000	
第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,801,620	
第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,016,000	
Ｆ８２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,772,000	
第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,235,400	
第９７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,700,000	
第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,293,850	
Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,276,000	
Ｆ２２８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,910,000	
Ｆ３０５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,013,000	
第６６回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,031,000	
第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	114,358,000	
第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	93,017,000	92,616,096	
第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	98,650,000	98,529,647	
第１８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,534,000	
第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,453,000	
第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,372,000	
第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,530,000	88,476,199	
第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,587,000	88,286,820	
第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,830,000	89,396,735	
第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,398,000	89,091,040	
第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,647,000	92,128,146	
第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,576,000	93,623,034	
第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,051,000	96,105,723	
第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,702,000	98,473,011	
第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	65,862,000	65,756,620	
第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	68,587,000	68,524,585	
第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	72,676,000	72,660,011	
第３２７回信金中金債	100,000,000	100,068,000	

	第３４０回信金中金債	100,000,000	100,221,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	102,384,000	
	第３９回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,013,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,146,000	
	第５２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,850,000	
	第１１６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,015,000	
	特殊債券合計	5,193,113,000	5,408,809,677	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	98,556,000	
	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	100,190,000	
	第１回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	98,221,000	
	第７回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,888,000	
	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	99,619,000	
	第１２回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,786,000	
	第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,934,000	
	第１２回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,652,000	
	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	99,640,000	
	第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,112,000	
	第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,772,000	
	第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,835,000	
	第２６回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,189,000	
	第１２回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,472,000	
	第１８回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,833,000	
	第５回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,515,000	
	第１７回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	98,473,000	
	第１４７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	102,206,000	
	第１４回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000	
	第５０回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	98,309,000	
	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	100,065,000	
	第７５回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,831,000	
	第５８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,785,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,081,000	
	第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,261,000	
	第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,323,000	

	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,219,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,144,000	
	第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	99,520,000	
	第５４３回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,715,000	
	第５２１回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,076,000	
	第２８９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,093,000	
	第４６２回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,568,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,363,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,931,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,755,000	
社債券合計		3,600,000,000	3,601,749,000	
合計			85,843,898,007	

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 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,358,734,481
コール・ローン	2,361,833,581
国債証券	185,177,457,302
派生商品評価勘定	906,546
未収利息	936,685,427
前払費用	245,818,913
流動資産合計	191,081,436,250
資産合計	191,081,436,250
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,729,514,247
未払金	2,295,197,361
未払解約金	12,114,000
未払利息	6,406
流動負債合計	6,036,832,014
負債合計	6,036,832,014
純資産の部	
元本等	

	2020年 8月17日現在
元本	173,467,819,943
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	11,576,784,293
元本等合計	185,044,604,236
純資産合計	185,044,604,236
負債純資産合計	191,081,436,250

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 8月17日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	105,384,277,083円
期中追加設定元本額	89,810,958,544円
期中一部解約元本額	21,727,415,684円
期末元本額	173,467,819,943円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	13,970,173,852円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	6,950,138,664円
りそなラップ型ファンド（成長型）	846,343,852円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	1,099,507,001円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	220,890,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	52,088,928円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,432,167円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	4,654,581円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	492,011円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	152,300円
リスクコントロール・オープン	192,424,240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）	85,155,629,161円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	667,875,005円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	346,460,521円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	241,206,245円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	87,398,970円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	12,667,170,331円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	11,272,736,507円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	7,070,666,752円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	4,167,617,441円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	11,726,350,580円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	1,921,451,139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）	7,284,066,437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）	9,343,108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	
	173,467,819,943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	1.0667円
(10,000口当たり純資産額)	(10,667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 8月17日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	3,166,152,716
合計	3,166,152,716

(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 8月17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	184,263,566,119	－	187,992,173,820	△3,728,607,701
	米ドル	81,454,890,420	－	83,220,880,400	△1,765,989,980
	カナダドル	3,455,146,243	－	3,570,143,680	△114,997,437
	メキシコペソ	1,381,790,506	－	1,415,610,210	△33,819,704
	ユーロ	76,094,721,642	－	77,485,493,610	△1,390,771,968
	英ポンド	12,209,593,088	－	12,440,773,860	△231,180,772
	スウェーデンクローナ	545,086,053	－	555,659,220	△10,573,167
	ノルウェークローネ	398,501,709	－	414,160,580	△15,658,871
	デンマーククローネ	978,219,190	－	994,846,350	△16,627,160
	ポーランドズロチ	1,110,517,344	－	1,131,218,010	△20,700,666
	オーストラリアドル	4,287,103,506	－	4,368,172,650	△81,069,144
	シンガポールドル	809,526,439	－	826,093,750	△16,567,311
	マレーシアリンギット	820,493,202	－	835,480,800	△14,987,598
	イスラエルシュケル	717,976,777	－	733,640,700	△15,663,923
合計		184,263,566,119	－	187,992,173,820	△3,728,607,701

（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	2,030,000.00	2,048,832.91	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,045,996.00	
		US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,518,676.29	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,051,640.60	
		US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,232,531.61	
		US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,664,417.94	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,056,171.80	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	3,264,950.86	
		US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,432,666.78	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,060,781.20	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,404,284.95	
		US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,292,910.07	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,369,790.72	
		US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,211,753.71	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,067,773.40	
		US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,398,355.90	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,279,521.61	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,255,687.36	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,478,890.40	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,824,415.62	

US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,550,585.75	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,132,031.20	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,395,990.20	
US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,675,351.79	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,053,437.50	
US TREASURY N/B	7,560,000.00	7,768,490.43	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,233,435.50	
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,793,590.61	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,039.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,796,437.36	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,359,701.10	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,819,470.08	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,265,937.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,104,472.60	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,249,497.70	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,521,825.18	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,527,731.59	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,826,484.37	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,082,211.00	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,879,570.12	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,498,974.50	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,190,577.97	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,420,411.61	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,956,888.66	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,998,593.60	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,267,160.06	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,507,393.94	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,049,620.02	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,999,296.80	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,830,888.50	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,567,578.00	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,422,128.38	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,761,500.24	
US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,516,521.29	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,581,906.31	

US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,803,516.78	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,545,390.40	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,292,743.79	
US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,883,425.18	
US TREASURY N/B	5,080,000.00	5,247,084.24	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,355,608.90	
US TREASURY N/B	7,750,000.00	8,015,194.92	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,645,956.94	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,404,951.20	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,451,726.35	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,633,796.87	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,841,514.60	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,545,175.65	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,377,849.48	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,593,339.75	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,214,398.38	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,493,203.12	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,507,382.55	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,714,646.34	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,427,939.89	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,558,188.37	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,894,591.48	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,143,486.23	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,928,917.80	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,456,872.74	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,268,809.86	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,375,616.67	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,996,718.60	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,166,158.19	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,570,883.56	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,403,466.64	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,295,532.52	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,106,181.42	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,974,191.24	
US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,776,921.60	

US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,933,598.23	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,573,140.50	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,459,057.40	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,052,412.41	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,919,585.87	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,649,898.61	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,571,291.88	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,921,605.30	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,616,396.56	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,718,543.84	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,472,657.62	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,837,060.35	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,337,654.43	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,350,109.96	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,610,592.38	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,117,187.40	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,590,017.13	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,238,593.60	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,629,588.29	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,813,507.66	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,580,556.06	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,714,167.76	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,902,042.84	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,622,627.56	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,367,499.84	
US TREASURY N/B	4,760,000.00	5,161,717.82	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,403,593.75	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	8,004,491.76	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,195,003.81	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,046,034.80	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,879,543.75	
US TREASURY N/B	6,770,000.00	7,102,549.17	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,579,125.95	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,557,177.72	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,803,012.55	

US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,848,222.90	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,670,615.77	
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,293,001.80	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,774,456.39	
US TREASURY N/B	800,000.00	798,781.20	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,372,122.48	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,641,099.43	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,535,248.92	
US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,013,216.77	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,745,841.30	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,120,860.47	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,761,514.44	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,504,003.70	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	6,126,238.02	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,949,411.70	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,906,656.25	
US TREASURY N/B	3,820,000.00	4,290,188.13	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,279,721.33	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,899,683.53	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,949,828.28	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,782,324.00	
US TREASURY N/B	4,710,000.00	5,042,919.28	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,969,261.55	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,931,820.11	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,824,960.84	
US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,863,966.20	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,044,924.92	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,164,335.79	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,704,176.46	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	3,518,962.50	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,737,165.92	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,245,390.40	
US TREASURY N/B	4,470,000.00	4,766,660.93	
US TREASURY N/B	2,730,000.00	3,042,670.17	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,042,421.80	

		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,827,125.00
		US TREASURY N/B	3,150,000.00	3,153,383.73
		US TREASURY N/B	3,120,000.00	3,512,376.50
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,101,452.97
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,500,546.70
		US TREASURY N/B	5,550,000.00	6,218,059.05
		US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,885,072.29
		US TREASURY N/B	4,850,000.00	5,639,166.78
		US TREASURY N/B	5,590,000.00	6,572,289.33
		US TREASURY N/B	220,000.00	305,219.90
		US TREASURY N/B	5,870,000.00	6,923,274.64
		US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,799,287.17
		US TREASURY N/B	530,000.00	735,271.43
		US TREASURY N/B	5,640,000.00	6,580,072.94
		US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,757,096.21
		US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,237,821.90
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,066,675.55
		US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,783,696.99
		US TREASURY N/B	780,000.00	1,193,201.88
		US TREASURY N/B	6,970,000.00	6,927,662.12
		US TREASURY N/B	610,000.00	900,250.38
		US TREASURY N/B	540,000.00	820,873.81
		US TREASURY N/B	130,000.00	211,623.23
		US TREASURY N/B	690,000.00	1,066,386.85
		US TREASURY N/B	520,000.00	815,648.39
		US TREASURY N/B	960,000.00	1,351,631.23
		US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,983,400.15
		US TREASURY N/B	1,340,000.00	2,123,167.15
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,503,593.60
		US TREASURY N/B	780,000.00	1,258,374.54
		US TREASURY N/B	950,000.00	1,494,264.59
		US TREASURY N/B	4,770,000.00	4,710,561.03
		US TREASURY N/B	1,410,000.00	2,092,500.48
		US TREASURY N/B	770,000.00	1,198,282.39
		US TREASURY N/B	900,000.00	1,487,548.80

US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,790,895.41	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,588,401.46	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,407,148.39	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,816,589.76	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	2,062,408.14	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	2,102,242.85	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,382,180.30	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	3,034,456.09	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,134,578.08	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,543,480.91	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,357,556.57	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,714,750.00	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,828,668.75	
US TREASURY N/B	2,850,000.00	3,881,510.47	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,208,359.36	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,900,996.67	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,751,562.35	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,931,207.44	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,789,375.00	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,742,437.04	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,981,292.18	
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,843,632.65	
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,795,439.34	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,901,831.44	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,795,122.12	
US TREASURY N/B	2,370,000.00	3,083,638.28	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,462,684.74	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	8,584,118.55	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,541,067.34	
US TREASURY N/B	5,050,000.00	6,904,888.23	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	5,255,929.44	
US TREASURY N/B	3,780,000.00	5,185,539.70	
US TREASURY N/B	3,570,000.00	4,799,488.36	
US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,792,419.57	
US TREASURY N/B	4,150,000.00	5,091,531.25	

	US TREASURY N/B	3,860,000.00	4,387,281.79	
	US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,436,597.30	
	米ドル 小計	694,020,000.00	767,534,647.70 (81,780,816,712)	
カナダドル	GOV OF CANADA	690,000.00	698,645.70	
	GOV OF CANADA	1,680,000.00	1,689,542.40	
	GOV OF CANADA	830,000.00	840,358.40	
	GOV OF CANADA	610,000.00	621,278.90	
	GOV OF CANADA	1,450,000.00	1,455,901.50	
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,123,529.00	
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,128,211.20	
	GOV OF CANADA	1,930,000.00	1,929,807.00	
	GOV OF CANADA	2,280,000.00	2,314,359.60	
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,877,259.60	
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,209,300.30	
	GOV OF CANADA	1,480,000.00	1,556,042.40	
	GOV OF CANADA	840,000.00	896,876.40	
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,276,028.40	
	GOV OF CANADA	980,000.00	1,025,374.00	
	GOV OF CANADA	1,290,000.00	1,341,329.10	
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,197,537.00	
	GOV OF CANADA	2,390,000.00	2,403,957.60	
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,222,634.00	
	GOV OF CANADA	1,530,000.00	1,586,732.40	
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,114,260.00	
	GOV OF CANADA	350,000.00	505,554.00	
	GOV OF CANADA	1,660,000.00	1,901,214.60	
	GOV OF CANADA	2,290,000.00	2,431,155.60	
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,528,949.00	
	GOV OF CANADA	830,000.00	1,358,568.90	
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,559,070.00	
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,792,744.20	
	GOV OF CANADA	1,280,000.00	1,791,628.80	
	GOV OF CANADA	1,450,000.00	1,791,141.50	
	GOV OF CANADA	370,000.00	581,418.00	

		カナダドル 小計	38,920,000.00	43,750,409.50 (3,514,907,899)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE		19,450,000.00	20,133,414.65
	UNITED MEXICAN STATE		24,320,000.00	25,123,883.00
	UNITED MEXICAN STATE		14,250,000.00	14,983,305.00
	UNITED MEXICAN STATE		20,840,000.00	22,900,867.60
	UNITED MEXICAN STATE		18,480,000.00	20,615,918.40
	UNITED MEXICAN STATE		22,670,000.00	27,118,080.70
	UNITED MEXICAN STATE		15,420,000.00	15,807,658.80
	UNITED MEXICAN STATE		25,110,000.00	27,966,011.40
	UNITED MEXICAN STATE		24,110,000.00	28,701,026.20
	UNITED MEXICAN STATE		12,306,000.00	14,064,896.58
	UNITED MEXICAN STATE		7,560,000.00	8,648,413.20
	UNITED MEXICAN STATE		6,300,000.00	8,591,751.00
	UNITED MEXICAN STATE		15,320,000.00	18,488,022.80
	UNITED MEXICAN STATE		16,750,000.00	18,667,540.00
	UNITED MEXICAN STATE		13,890,000.00	15,850,573.50
		メキシコペソ 小計	256,776,000.00	287,661,362.83 (1,395,157,609)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA		1,360,000.00	1,420,299.68
	GOV OF AUSTRIA		780,000.00	836,076.54
	GOV OF AUSTRIA		720,000.00	729,464.40
	GOV OF AUSTRIA		870,000.00	950,074.45
	GOV OF AUSTRIA		420,000.00	426,680.52
	GOV OF AUSTRIA		830,000.00	844,411.29
	GOV OF AUSTRIA		980,000.00	1,053,571.04
	GOV OF AUSTRIA		690,000.00	705,389.18
	GOV OF AUSTRIA		900,000.00	985,546.80
	GOV OF AUSTRIA		940,000.00	1,026,190.48
	GOV OF AUSTRIA		870,000.00	1,136,384.85
	GOV OF AUSTRIA		1,080,000.00	1,163,939.76
	GOV OF AUSTRIA		820,000.00	873,022.84
	GOV OF AUSTRIA		820,000.00	1,203,753.44
	GOV OF AUSTRIA		840,000.00	912,710.81
	GOV OF AUSTRIA		940,000.00	1,006,615.92

		GOV OF AUSTRIA	670,000.00	685,895.75	
		GOV OF AUSTRIA	700,000.00	937,733.30	
		GOV OF AUSTRIA	1,170,000.00	1,969,595.65	
		GOV OF AUSTRIA	590,000.00	1,002,876.98	
		GOV OF AUSTRIA	640,000.00	846,097.92	
		GOV OF AUSTRIA	350,000.00	395,385.55	
		GOV OF AUSTRIA	390,000.00	900,864.90	
		GOV OF AUSTRIA	500,000.00	996,125.00	
		GOV OF AUSTRIA	200,000.00	307,461.40	
		GOV OF BELGIUM	1,400,000.00	1,475,467.39	
		GOV OF BELGIUM	1,210,000.00	1,301,082.75	
		GOV OF BELGIUM	1,350,000.00	1,490,190.75	
		GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,233,188.16	
		GOV OF BELGIUM	760,000.00	779,269.49	
		GOV OF BELGIUM	1,330,000.00	1,493,676.45	
		GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,221,382.89	
		GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,510,773.50	
		GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,191,618.30	
		GOV OF BELGIUM	1,310,000.00	1,420,929.49	
		GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,263,483.00	
		GOV OF BELGIUM	870,000.00	890,729.49	
		GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	2,201,780.80	
		GOV OF BELGIUM	1,400,000.00	1,522,493.00	
		GOV OF BELGIUM	1,340,000.00	1,474,402.00	
		GOV OF BELGIUM	860,000.00	881,577.82	
		GOV OF BELGIUM	1,120,000.00	1,251,791.52	
		GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,029,710.91	
		GOV OF BELGIUM	720,000.00	834,385.38	
		GOV OF BELGIUM	800,000.00	1,123,439.20	
		GOV OF BELGIUM	1,610,000.00	2,754,799.34	
		GOV OF BELGIUM	490,000.00	589,670.90	
		GOV OF BELGIUM	680,000.00	875,123.28	
		GOV OF BELGIUM	630,000.00	636,280.34	
		GOV OF BELGIUM	1,450,000.00	2,568,950.50	
		GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,383,504.95	

GOV OF BELGIUM	970,000.00	1,236,851.85	
GOV OF BELGIUM	760,000.00	1,002,419.25	
GOV OF BELGIUM	440,000.00	679,684.72	
GOV OF BELGIUM	550,000.00	880,580.18	
GOV OF FINLAND	430,000.00	434,289.36	
GOV OF FINLAND	530,000.00	554,782.27	
GOV OF FINLAND	340,000.00	359,105.96	
GOV OF FINLAND	670,000.00	682,390.31	
GOV OF FINLAND	510,000.00	559,187.46	
GOV OF FINLAND	280,000.00	286,670.16	
GOV OF FINLAND	520,000.00	638,324.96	
GOV OF FINLAND	360,000.00	386,344.44	
GOV OF FINLAND	510,000.00	539,255.64	
GOV OF FINLAND	550,000.00	585,911.15	
GOV OF FINLAND	430,000.00	537,103.84	
GOV OF FINLAND	360,000.00	384,854.76	
GOV OF FINLAND	480,000.00	513,912.00	
GOV OF FINLAND	350,000.00	386,019.55	
GOV OF FINLAND	390,000.00	453,546.21	
GOV OF FINLAND	250,000.00	254,356.75	
GOV OF FINLAND	320,000.00	328,011.52	
GOV OF FINLAND	380,000.00	587,557.97	
GOV OF FINLAND	330,000.00	432,745.50	
GOV OF FRANCE	3,320,000.00	3,472,856.12	
GOV OF FRANCE	2,580,000.00	2,603,872.74	
GOV OF FRANCE	3,980,000.00	4,223,400.88	
GOV OF FRANCE	2,560,000.00	2,586,951.68	
GOV OF FRANCE	3,320,000.00	3,529,339.28	
GOV OF FRANCE	2,000,000.00	2,030,120.00	
GOV OF FRANCE	3,490,000.00	3,543,900.94	
GOV OF FRANCE	3,960,000.00	4,219,189.92	
GOV OF FRANCE	3,830,000.00	4,427,227.22	
GOV OF FRANCE	3,730,000.00	3,805,435.52	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,354,751.45	
GOV OF FRANCE	3,220,000.00	3,539,800.74	

GOV OF FRANCE	3,620,000.00	3,705,621.68	
GOV OF FRANCE	3,050,000.00	3,199,889.20	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,048,698.53	
GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,313,982.11	
GOV OF FRANCE	2,470,000.00	2,531,046.05	
GOV OF FRANCE	3,770,000.00	4,633,249.31	
GOV OF FRANCE	2,880,000.00	3,041,870.40	
GOV OF FRANCE	2,960,000.00	3,086,350.56	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,317,698.50	
GOV OF FRANCE	4,230,000.00	5,194,380.78	
GOV OF FRANCE	3,620,000.00	3,924,420.28	
GOV OF FRANCE	3,350,000.00	3,639,580.70	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,188,462.56	
GOV OF FRANCE	2,620,000.00	2,793,281.56	
GOV OF FRANCE	3,380,000.00	3,443,165.44	
GOV OF FRANCE	3,940,000.00	4,981,980.28	
GOV OF FRANCE	1,540,000.00	1,560,485.08	
GOV OF FRANCE	4,090,000.00	4,805,324.64	
GOV OF FRANCE	2,450,000.00	4,197,065.10	
GOV OF FRANCE	3,120,000.00	3,635,230.56	
GOV OF FRANCE	2,390,000.00	4,038,263.50	
GOV OF FRANCE	3,000,000.00	3,523,020.00	
GOV OF FRANCE	2,160,000.00	3,637,651.68	
GOV OF FRANCE	2,560,000.00	3,284,641.01	
GOV OF FRANCE	590,000.00	613,744.55	
GOV OF FRANCE	3,130,000.00	5,784,840.96	
GOV OF FRANCE	2,170,000.00	3,629,034.22	
GOV OF FRANCE	2,180,000.00	3,055,712.54	
GOV OF FRANCE	2,330,000.00	2,971,956.94	
GOV OF FRANCE	1,290,000.00	1,366,149.34	
GOV OF FRANCE	1,360,000.00	2,838,910.08	
GOV OF FRANCE	1,380,000.00	3,044,773.76	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	1,595,827.20	
GOV OF GERMANY	1,800,000.00	1,855,251.00	
GOV OF GERMANY	1,110,000.00	1,117,823.28	

GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,894,111.28	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,160,157.95	
GOV OF GERMANY	1,830,000.00	1,898,392.59	
GOV OF GERMANY	1,940,000.00	1,959,642.50	
GOV OF GERMANY	1,540,000.00	1,556,555.00	
GOV OF GERMANY	800,000.00	809,552.00	
GOV OF GERMANY	1,910,000.00	1,997,846.43	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,164,025.61	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	1,877,605.70	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	2,026,880.64	
GOV OF GERMANY	1,560,000.00	1,589,072.16	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	1,973,340.96	
GOV OF GERMANY	2,640,000.00	2,856,275.66	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,115,715.95	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,194,837.06	
GOV OF GERMANY	2,010,000.00	2,060,700.24	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,187,132.78	
GOV OF GERMANY	1,340,000.00	1,431,169.58	
GOV OF GERMANY	1,970,000.00	2,025,250.62	
GOV OF GERMANY	3,050,000.00	3,212,665.65	
GOV OF GERMANY	1,590,000.00	1,638,965.64	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,688,364.64	
GOV OF GERMANY	800,000.00	826,560.00	
GOV OF GERMANY	2,600,000.00	2,766,270.00	
GOV OF GERMANY	2,590,000.00	2,689,261.75	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,622,138.72	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,514,177.86	
GOV OF GERMANY	2,380,000.00	2,566,013.66	
GOV OF GERMANY	1,030,000.00	1,072,481.32	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,908,748.00	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,499,249.06	
GOV OF GERMANY	1,190,000.00	1,699,112.94	
GOV OF GERMANY	2,000,000.00	2,130,456.00	
GOV OF GERMANY	2,570,000.00	2,742,413.59	
GOV OF GERMANY	2,560,000.00	2,674,324.48	

GOV OF GERMANY	740,000.00	1,220,817.96	
GOV OF GERMANY	2,410,000.00	2,515,789.36	
GOV OF GERMANY	1,210,000.00	1,262,112.28	
GOV OF GERMANY	1,450,000.00	2,368,479.30	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,861,477.76	
GOV OF GERMANY	850,000.00	878,142.65	
GOV OF GERMANY	2,330,000.00	3,987,944.12	
GOV OF GERMANY	1,640,000.00	3,045,940.84	
GOV OF GERMANY	1,900,000.00	3,800,900.60	
GOV OF GERMANY	1,740,000.00	3,049,379.58	
GOV OF GERMANY	2,330,000.00	3,789,039.01	
GOV OF GERMANY	2,630,000.00	4,377,853.29	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,797,921.71	
GOV OF GERMANY	1,200,000.00	1,194,007.20	
GOV OF IRELAND	560,000.00	572,161.40	
GOV OF IRELAND	440,000.00	445,499.56	
GOV OF IRELAND	680,000.00	759,655.45	
GOV OF IRELAND	680,000.00	776,326.76	
GOV OF IRELAND	970,000.00	1,232,321.95	
GOV OF IRELAND	940,000.00	1,016,113.85	
GOV OF IRELAND	530,000.00	547,925.13	
GOV OF IRELAND	650,000.00	708,543.15	
GOV OF IRELAND	810,000.00	901,289.43	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,035,144.46	
GOV OF IRELAND	510,000.00	524,343.24	
GOV OF IRELAND	410,000.00	471,437.68	
GOV OF IRELAND	420,000.00	487,076.10	
GOV OF IRELAND	390,000.00	403,775.19	
GOV OF IRELAND	490,000.00	609,137.61	
GOV OF IRELAND	760,000.00	1,044,944.52	
GOV OF IRELAND	420,000.00	531,223.16	
GOV OF ITALY	870,000.00	902,797.26	
GOV OF ITALY	2,130,000.00	2,239,520.34	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	1,667,008.34	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,597,012.52	

GOV OF ITALY	2,940,000.00	3,031,107.66	
GOV OF ITALY	690,000.00	744,964.02	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,164,403.98	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,669,693.76	
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,409,115.65	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,559,016.28	
GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,124,845.08	
GOV OF ITALY	1,450,000.00	1,495,329.90	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,637,613.38	
GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,653,458.40	
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,403,630.76	
GOV OF ITALY	1,470,000.00	1,506,295.77	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,570,251.20	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,565,665.64	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,277,676.00	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,268,300.88	
GOV OF ITALY	2,410,000.00	2,587,602.54	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,283,239.44	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,280,815.46	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,485,325.80	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,411,493.30	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,945,732.05	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,615,615.54	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	1,878,586.91	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,769,799.99	
GOV OF ITALY	1,510,000.00	1,823,720.62	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,614,526.76	
GOV OF ITALY	1,430,000.00	1,503,944.15	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,707,614.40	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,589,715.21	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,814,002.68	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,358,264.00	
GOV OF ITALY	2,150,000.00	2,279,038.70	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,653,592.49	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,423,064.86	

GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,731,610.98	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,880,829.00	
GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,430,668.78	
GOV OF ITALY	500,000.00	506,409.00	
GOV OF ITALY	1,780,000.00	2,490,008.35	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	2,297,760.46	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,439,188.73	
GOV OF ITALY	1,850,000.00	2,140,209.50	
GOV OF ITALY	2,250,000.00	2,656,239.75	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,610,552.10	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,064,612.32	
GOV OF ITALY	1,840,000.00	1,906,911.60	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,083,562.80	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,640,964.85	
GOV OF ITALY	2,060,000.00	3,077,998.44	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,656,184.91	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	2,141,492.49	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,079,900.36	
GOV OF ITALY	1,580,000.00	2,310,791.08	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	1,976,240.64	
GOV OF ITALY	810,000.00	816,182.73	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,934,081.18	
GOV OF ITALY	2,380,000.00	3,234,006.83	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,493,682.48	
GOV OF ITALY	2,160,000.00	3,348,093.31	
GOV OF ITALY	910,000.00	1,126,255.13	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,808,223.20	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,524,415.60	
GOV OF ITALY	1,280,000.00	1,643,481.60	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,713,949.48	
GOV OF ITALY	1,310,000.00	1,747,345.85	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,670,948.37	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,565,110.40	
GOV OF ITALY	740,000.00	882,832.49	
GOV OF NETHERLANDS	1,310,000.00	1,320,859.62	

GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,571,875.19	
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,150,567.60	
GOV OF NETHERLANDS	1,580,000.00	1,689,906.38	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,316,597.22	
GOV OF NETHERLANDS	1,380,000.00	1,522,799.64	
GOV OF NETHERLANDS	1,260,000.00	1,312,196.76	
GOV OF NETHERLANDS	1,390,000.00	1,476,188.34	
GOV OF NETHERLANDS	650,000.00	670,584.85	
GOV OF NETHERLANDS	1,430,000.00	1,551,884.62	
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,505,742.16	
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,138,761.52	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,182,140.40	
GOV OF NETHERLANDS	1,260,000.00	1,297,752.12	
GOV OF NETHERLANDS	1,240,000.00	1,664,386.01	
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	2,285,890.43	
GOV OF NETHERLANDS	730,000.00	805,143.77	
GOV OF NETHERLANDS	1,370,000.00	2,482,929.46	
GOV OF NETHERLANDS	1,450,000.00	2,488,878.39	
GOV OF SPAIN	2,250,000.00	2,263,887.00	
GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,256,055.30	
GOV OF SPAIN	2,320,000.00	2,353,563.90	
GOV OF SPAIN	1,870,000.00	1,905,702.04	
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,308,148.96	
GOV OF SPAIN	1,340,000.00	1,352,908.75	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	1,817,303.46	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,052,856.20	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,814,263.22	
GOV OF SPAIN	1,760,000.00	2,029,315.20	
GOV OF SPAIN	1,500,000.00	1,532,277.00	
GOV OF SPAIN	2,250,000.00	2,537,100.00	
GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,312,529.40	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,117,274.90	
GOV OF SPAIN	1,840,000.00	2,283,403.20	
GOV OF SPAIN	2,180,000.00	2,443,718.96	
GOV OF SPAIN	2,010,000.00	2,247,907.62	

		GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,702,188.35	
		GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,398,904.17	
		GOV OF SPAIN	1,700,000.00	1,871,878.50	
		GOV OF SPAIN	1,200,000.00	1,261,984.80	
		GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,109,786.24	
		GOV OF SPAIN	1,900,000.00	2,088,436.30	
		GOV OF SPAIN	2,150,000.00	2,367,154.30	
		GOV OF SPAIN	1,430,000.00	2,011,372.36	
		GOV OF SPAIN	2,040,000.00	3,034,892.27	
		GOV OF SPAIN	1,900,000.00	2,104,190.52	
		GOV OF SPAIN	2,060,000.00	2,127,415.56	
		GOV OF SPAIN	1,730,000.00	1,764,785.97	
		GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,356,022.87	
		GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,123,343.30	
		GOV OF SPAIN	1,820,000.00	2,947,651.98	
		GOV OF SPAIN	1,730,000.00	2,125,194.28	
		GOV OF SPAIN	1,520,000.00	1,779,799.92	
		GOV OF SPAIN	1,760,000.00	2,723,283.20	
		GOV OF SPAIN	1,670,000.00	2,922,545.09	
		GOV OF SPAIN	1,010,000.00	1,066,216.60	
		GOV OF SPAIN	1,910,000.00	3,308,326.28	
		GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,992,651.67	
		GOV OF SPAIN	1,460,000.00	2,081,490.45	
		GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,795,359.53	
		GOV OF SPAIN	980,000.00	948,264.66	
		GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,973,147.00	
		ユーロ 小計	509,910,000.00	606,795,930.32 (76,577,646,406)	
	英ポンド	UK TREASURY	670,000.00	696,776.41	
		UK TREASURY	1,900,000.00	2,018,754.18	
		UK TREASURY	2,070,000.00	2,091,196.80	
		UK TREASURY	2,260,000.00	2,343,163.48	
		UK TREASURY	1,150,000.00	1,154,059.50	
		UK TREASURY	2,260,000.00	2,314,238.19	
		UK TREASURY	1,260,000.00	1,348,707.65	

		UK TREASURY	2,240,000.00	2,327,812.01	
		UK TREASURY	1,840,000.00	2,049,561.08	
		UK TREASURY	780,000.00	958,857.12	
		UK TREASURY	2,100,000.00	2,164,751.40	
		UK TREASURY	1,250,000.00	1,378,795.00	
		UK TREASURY	300,000.00	301,311.00	
		UK TREASURY	1,470,000.00	1,601,233.94	
		UK TREASURY	1,400,000.00	1,514,458.40	
		UK TREASURY	1,180,000.00	1,538,698.76	
		UK TREASURY	300,000.00	299,834.16	
		UK TREASURY	1,320,000.00	1,482,622.94	
		UK TREASURY	950,000.00	1,406,362.90	
		UK TREASURY	1,360,000.00	1,443,368.81	
		UK TREASURY	1,660,000.00	1,673,435.36	
		UK TREASURY	1,550,000.00	2,260,275.10	
		UK TREASURY	1,550,000.00	2,241,943.25	
		UK TREASURY	1,250,000.00	1,927,317.50	
		UK TREASURY	1,630,000.00	2,519,980.00	
		UK TREASURY	2,310,000.00	2,715,030.78	
		UK TREASURY	1,320,000.00	2,255,856.24	
		UK TREASURY	1,080,000.00	1,769,395.32	
		UK TREASURY	1,380,000.00	2,299,129.11	
		UK TREASURY	650,000.00	711,434.10	
		UK TREASURY	1,860,000.00	3,290,343.72	
		UK TREASURY	1,920,000.00	2,929,361.28	
		UK TREASURY	1,810,000.00	2,894,980.97	
		UK TREASURY	1,470,000.00	2,671,375.14	
		UK TREASURY	1,630,000.00	1,905,277.66	
		UK TREASURY	1,060,000.00	1,315,084.76	
		UK TREASURY	1,130,000.00	2,149,354.92	
		UK TREASURY	980,000.00	930,240.78	
		UK TREASURY	1,190,000.00	2,187,209.52	
		UK TREASURY	1,000,000.00	1,249,530.78	
		UK TREASURY	1,470,000.00	3,047,192.40	
		UK TREASURY	1,530,000.00	2,014,973.28	

	UK TREASURY	1,210,000.00	2,554,221.91	
	UK TREASURY	500,000.00	458,255.00	
	UK TREASURY	1,310,000.00	2,191,250.10	
	UK TREASURY	1,330,000.00	2,827,526.80	
	UK TREASURY	780,000.00	1,111,800.30	
英ポンド 小計		64,620,000.00	86,536,339.81 (12,077,011,583)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	8,975,000.00	9,590,722.68	
	GOV OF SWEDEN	7,450,000.00	7,885,698.35	
	GOV OF SWEDEN	5,880,000.00	6,652,338.00	
	GOV OF SWEDEN	5,200,000.00	5,583,952.40	
	GOV OF SWEDEN	3,960,000.00	4,222,359.90	
	GOV OF SWEDEN	4,530,000.00	4,849,772.70	
	GOV OF SWEDEN	3,910,000.00	6,098,739.80	
スウェーデンクローナ 小計		39,905,000.00	44,883,583.83 (550,721,573)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	6,580,000.00	6,890,279.90	
	GOV OF NORWAY	4,970,000.00	5,435,738.70	
	GOV OF NORWAY	3,640,000.00	3,854,596.20	
	GOV OF NORWAY	3,150,000.00	3,318,840.00	
	GOV OF NORWAY	3,300,000.00	3,544,368.62	
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,665,597.40	
	GOV OF NORWAY	3,310,000.00	3,608,148.25	
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,577,459.60	
ノルウェークローネ 小計		31,660,000.00	33,895,028.67 (406,401,393)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,600,000.00	5,850,068.00	
	GOV OF DENMARK	4,150,000.00	4,229,208.55	
	GOV OF DENMARK	5,020,000.00	5,362,630.06	
	GOV OF DENMARK	5,400,000.00	6,048,069.11	
	GOV OF DENMARK	7,000,000.00	7,462,371.00	
	GOV OF DENMARK	7,450,000.00	8,014,635.50	
	GOV OF DENMARK	10,960,000.00	20,567,514.08	
デンマーククローネ 小計		45,580,000.00	57,534,496.30 (975,209,712)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,320,000.00	1,410,063.60	

		GOV OF POLAND	3,410,000.00	3,534,366.43	
		GOV OF POLAND	2,340,000.00	2,334,240.79	
		GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,670,848.90	
		GOV OF POLAND	2,870,000.00	3,033,216.60	
		GOV OF POLAND	2,120,000.00	2,370,011.60	
		GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,134,056.61	
		GOV OF POLAND	2,110,000.00	2,262,991.65	
		GOV OF POLAND	800,000.00	804,806.00	
		GOV OF POLAND	2,610,000.00	2,934,078.48	
		GOV OF POLAND	3,550,000.00	3,883,372.69	
		GOV OF POLAND	2,790,000.00	3,061,907.82	
		GOV OF POLAND	2,620,000.00	2,930,601.00	
		GOV OF POLAND	640,000.00	886,112.00	
		GOV OF POLAND	2,820,000.00	3,196,047.00	
		GOV OF POLAND	500,000.00	498,003.40	
	ポーランドズロチ 小計		35,800,000.00	38,944,724.57 (1,117,713,595)	
	オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,500,000.00	1,535,385.30	
		GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	2,252,723.44	
		GOV OF AUSTRALIA	2,510,000.00	2,622,308.94	
		GOV OF AUSTRALIA	2,720,000.00	3,100,244.28	
		GOV OF AUSTRALIA	2,890,000.00	3,148,969.42	
		GOV OF AUSTRALIA	1,930,000.00	1,920,215.66	
		GOV OF AUSTRALIA	2,810,000.00	3,179,427.89	
		GOV OF AUSTRALIA	1,650,000.00	1,629,782.22	
		GOV OF AUSTRALIA	2,750,000.00	3,322,843.41	
		GOV OF AUSTRALIA	2,560,000.00	3,249,864.18	
		GOV OF AUSTRALIA	2,410,000.00	2,759,701.84	
		GOV OF AUSTRALIA	2,530,000.00	2,813,519.89	
		GOV OF AUSTRALIA	2,130,000.00	2,458,133.09	
		GOV OF AUSTRALIA	2,940,000.00	3,526,863.10	
		GOV OF AUSTRALIA	2,540,000.00	2,956,295.32	
		GOV OF AUSTRALIA	3,160,000.00	3,621,089.48	
		GOV OF AUSTRALIA	1,860,000.00	1,863,827.68	
		GOV OF AUSTRALIA	1,960,000.00	2,059,288.70	

		GOV OF AUSTRALIA	1,290,000.00	1,317,757.05	
		GOV OF AUSTRALIA	1,080,000.00	1,516,353.58	
		GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	974,926.85	
		GOV OF AUSTRALIA	970,000.00	1,312,230.15	
		GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	910,264.37	
		GOV OF AUSTRALIA	730,000.00	874,912.59	
		GOV OF AUSTRALIA	1,130,000.00	1,429,185.32	
	オーストラリアドル 小計		49,610,000.00	56,356,113.75 (4,315,187,629)	
	シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	580,000.00	586,496.00	
		GOV OF SINGAPORE	500,000.00	512,262.50	
		GOV OF SINGAPORE	500,000.00	528,850.00	
		GOV OF SINGAPORE	610,000.00	631,533.00	
		GOV OF SINGAPORE	720,000.00	769,032.00	
		GOV OF SINGAPORE	290,000.00	305,979.00	
		GOV OF SINGAPORE	610,000.00	673,135.00	
		GOV OF SINGAPORE	540,000.00	588,459.60	
		GOV OF SINGAPORE	540,000.00	587,520.00	
		GOV OF SINGAPORE	550,000.00	649,440.00	
		GOV OF SINGAPORE	350,000.00	399,175.00	
		GOV OF SINGAPORE	630,000.00	740,754.00	
		GOV OF SINGAPORE	320,000.00	380,544.00	
		GOV OF SINGAPORE	570,000.00	730,170.00	
		GOV OF SINGAPORE	540,000.00	626,367.60	
		GOV OF SINGAPORE	170,000.00	203,167.85	
		GOV OF SINGAPORE	350,000.00	453,250.00	
		GOV OF SINGAPORE	550,000.00	739,750.00	
		GOV OF SINGAPORE	300,000.00	360,187.50	
	シンガポールドル 小計		9,220,000.00	10,466,073.05 (813,946,501)	
	マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	882,146.54	
		GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,207,876.67	
		GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,239,253.07	
		GOV OF MALAYSIA	810,000.00	835,377.21	
		GOV OF MALAYSIA	950,000.00	988,785.93	
		GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,675,151.06	

		GOV OF MALAYSIA	610,000.00	639,854.25	
		GOV OF MALAYSIA	830,000.00	875,238.23	
		GOV OF MALAYSIA	760,000.00	800,296.18	
		GOV OF MALAYSIA	830,000.00	896,405.64	
		GOV OF MALAYSIA	670,000.00	723,694.53	
		GOV OF MALAYSIA	730,000.00	786,664.64	
		GOV OF MALAYSIA	2,250,000.00	2,453,431.50	
		GOV OF MALAYSIA	810,000.00	904,871.73	
		GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,301,181.10	
		GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,108,102.71	
		GOV OF MALAYSIA	490,000.00	529,844.54	
		GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,493,257.00	
		GOV OF MALAYSIA	1,310,000.00	1,431,916.19	
		GOV OF MALAYSIA	1,300,000.00	1,445,888.21	
		GOV OF MALAYSIA	1,630,000.00	1,898,747.55	
		GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,354,658.62	
		GOV OF MALAYSIA	1,060,000.00	1,165,456.43	
		GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,301,157.55	
		GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,326,498.24	
		GOV OF MALAYSIA	270,000.00	307,551.81	
		GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,112,170.07	
		GOV OF MALAYSIA	890,000.00	1,090,547.97	
		GOV OF MALAYSIA	1,110,000.00	1,189,866.16	
		GOV OF MALAYSIA	540,000.00	650,556.36	
		GOV OF MALAYSIA	750,000.00	886,041.81	
		GOV OF MALAYSIA	640,000.00	768,778.04	
		GOV OF MALAYSIA	820,000.00	896,483.69	
	マレーシアリンギット 小計		32,880,000.00	36,167,751.23 (920,107,591)	
	イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,570,000.00	1,741,444.00	
		GOV OF ISRAEL	1,280,000.00	1,296,896.00	
		GOV OF ISRAEL	1,000,000.00	1,035,150.00	
		GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	1,809,237.50	
		GOV OF ISRAEL	1,660,000.00	1,748,976.00	
		GOV OF ISRAEL	1,450,000.00	1,654,740.00	

		GOV OF ISRAEL	700,000.00	707,595.00	
		GOV OF ISRAEL	1,650,000.00	1,795,777.50	
		GOV OF ISRAEL	1,360,000.00	1,916,308.00	
		GOV OF ISRAEL	1,600,000.00	1,768,080.00	
		GOV OF ISRAEL	1,440,000.00	1,664,856.00	
		GOV OF ISRAEL	910,000.00	943,988.50	
		GOV OF ISRAEL	1,660,000.00	2,995,636.00	
		GOV OF ISRAEL	1,570,000.00	2,327,996.00	
	イスラエルシュケル 小計		19,460,000.00	23,406,680.50 (732,629,099)	
合計				185,177,457,302 (185,177,457,302)	

(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	232銘柄	100.0%	44.2%
カナダドル	国債証券	31銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	322銘柄	100.0%	41.4%
英ポンド	国債証券	47銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	25銘柄	100.0%	2.3%
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	33銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.4%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＡＭ国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	549,699,818
株式	28,615,564,695
派生商品評価勘定	2,586,150
未収配当金	28,587,398
差入委託証拠金	19,305,000
流動資産合計	29,215,743,061
資産合計	29,215,743,061
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,914,300
前受金	4,135,000
未払金	64,021,316
未払解約金	23,356,000
未払利息	1,490
流動負債合計	95,428,106
負債合計	95,428,106
純資産の部	
元本等	
元本	25,505,356,354
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,614,958,601
元本等合計	29,120,314,955
純資産合計	29,120,314,955
負債純資産合計	29,215,743,061

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	先物取引

法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段で評価しております。
３.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

2020年 8月17日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	17,018,260,162円
期中追加設定元本額	10,588,889,507円
期中一部解約元本額	2,101,793,315円
期末元本額	25,505,356,354円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,818,623,871円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,271,689,678円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,160,002,769円
ＤＣりそな　グローバルバランス	34,271,446円
つみたてバランスファンド	2,183,777,159円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	720,401,133円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	355,077,012円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	214,439,375円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	14,178,914円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	11,524,192円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	4,312,404円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	6,849,210円
リスクコントロール・オープン	6,080,312円
ＦＷりそな国内株式アクティブファンド	302,384,638円
ＦＷりそな国内株式インデックスファンド	11,294,090,263円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	959,099,444円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	95,047,000円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	282,699,059円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	307,517,518円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	408,744,667円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	362,206,580円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	226,843,213円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	133,879,905円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	369,207,471円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	59,995,302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）	2,019,263円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	531,808,232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	
	25,505,356,354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	1.1417円
(10,000口当たり純資産額)	(11,417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 8月17日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	22,137,189
合計	22,137,189

(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 8月17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	532,298,150	－	530,970,000	△1,328,150
合計		532,298,150	－	530,970,000	△1,328,150

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	600	2,685.00	1,611,000	
日本水産	17,200	483.00	8,307,600	
マルハニチロ	2,500	2,308.00	5,770,000	
カネコ種苗	500	1,487.00	743,500	
サカタのタネ	2,100	3,515.00	7,381,500	
ホクト	1,300	2,150.00	2,795,000	
ホクリヨウ	300	649.00	194,700	
住石ホールディングス	3,500	117.00	409,500	
日鉄鉱業	400	4,375.00	1,750,000	
三井松島ホールディングス	700	756.00	529,200	
国際石油開発帝石	63,400	678.10	42,991,540	
石油資源開発	2,300	1,847.00	4,248,100	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	800	1,564.00	1,251,200	
ヒノキヤグループ	400	1,772.00	708,800	
ショーボンドホールディングス	2,700	5,000.00	13,500,000	
ミライト・ホールディングス	5,100	1,515.00	7,726,500	
タマホーム	900	1,253.00	1,127,700	
サンヨーホームズ	100	611.00	61,100	
日本アクア	700	618.00	432,600	
ファーストコーポレーション	500	604.00	302,000	
ベステラ	300	1,001.00	300,300	
ＴＡＴＥＲＵ	3,100	162.00	502,200	
キャンディル	300	656.00	196,800	
スペースバリューホールディングス	2,100	351.00	737,100	

ダイセキ環境ソリューション	300	709.00	212,700	
第一カッター興業	200	2,307.00	461,400	
明豊ファシリティワークス	600	571.00	342,600	
安藤・間	10,300	655.00	6,746,500	
東急建設	5,000	491.00	2,455,000	
コムシスホールディングス	6,100	3,135.00	19,123,500	
ビーアールホールディングス	1,900	656.00	1,246,400	
高松コンストラクショングループ	1,100	2,277.00	2,504,700	
東建コーポレーション	500	6,680.00	3,340,000	
ソネック	200	819.00	163,800	
ヤマウラ	700	826.00	578,200	
大成建設	13,300	3,515.00	46,749,500	
大林組	39,800	1,012.00	40,277,600	
清水建設	40,400	796.00	32,158,400	
飛島建設	1,100	1,093.00	1,202,300	
長谷工コーポレーション	15,400	1,372.00	21,128,800	
松井建設	1,600	716.00	1,145,600	
錢高組	200	3,845.00	769,000	
鹿島建設	31,200	1,311.00	40,903,200	
不動テトラ	1,000	1,400.00	1,400,000	
大末建設	500	850.00	425,000	
鉄建建設	900	2,046.00	1,841,400	
西松建設	3,100	1,986.00	6,156,600	
三井住友建設	9,600	437.00	4,195,200	
大豊建設	900	2,521.00	2,268,900	
前田建設工業	10,000	756.00	7,560,000	
佐田建設	900	411.00	369,900	
ナカノフドー建設	1,100	373.00	410,300	
奥村組	1,900	2,500.00	4,750,000	
東鉄工業	1,700	2,604.00	4,426,800	
イチケン	300	1,577.00	473,100	
富士ピー・エス	600	581.00	348,600	
淺沼組	400	4,015.00	1,606,000	
戸田建設	16,500	683.00	11,269,500	
熊谷組	1,800	2,632.00	4,737,600	
北野建設	200	2,519.00	503,800	

植木組	200	2,546.00	509,200	
矢作建設工業	1,800	878.00	1,580,400	
ピーエス三菱	1,300	554.00	720,200	
日本ハウスホールディングス	2,700	259.00	699,300	
大東建託	4,300	8,514.00	36,610,200	
新日本建設	1,700	826.00	1,404,200	
ＮＩＰＰＯ	3,300	2,827.00	9,329,100	
東亜道路工業	200	3,365.00	673,000	
前田道路	3,500	1,940.00	6,790,000	
日本道路	400	7,560.00	3,024,000	
東亜建設工業	1,200	1,559.00	1,870,800	
日本国土開発	3,900	574.00	2,238,600	
若築建設	700	1,170.00	819,000	
東洋建設	4,500	394.00	1,773,000	
五洋建設	15,800	640.00	10,112,000	
世紀東急工業	1,900	775.00	1,472,500	
福田組	500	4,925.00	2,462,500	
住友林業	10,100	1,524.00	15,392,400	
日本基礎技術	1,300	401.00	521,300	
巴コーポレーション	1,800	355.00	639,000	
大和ハウス工業	39,400	2,645.50	104,232,700	
ライト工業	2,300	1,540.00	3,542,000	
積水ハウス	43,100	2,097.00	90,380,700	
日特建設	1,000	775.00	775,000	
北陸電気工事	700	987.00	690,900	
ユアテック	2,300	625.00	1,437,500	
日本リーテック	800	2,963.00	2,370,400	
四電工	200	2,339.00	467,800	
中電工	1,600	2,284.00	3,654,400	
関電工	5,700	876.00	4,993,200	
きんでん	9,500	1,718.00	16,321,000	
東京エネシス	1,300	766.00	995,800	
トーエネック	400	3,680.00	1,472,000	
住友電設	1,100	2,346.00	2,580,600	
日本電設工業	2,200	2,130.00	4,686,000	
協和エクシオ	6,000	2,723.00	16,338,000	

新日本空調	1,100	2,097.00	2,306,700	
九電工	2,800	3,005.00	8,414,000	
三機工業	2,900	1,168.00	3,387,200	
日揮ホールディングス	12,200	1,220.00	14,884,000	
中外炉工業	400	1,462.00	584,800	
ヤマト	1,300	639.00	830,700	
太平電業	1,000	2,216.00	2,216,000	
高砂熱学工業	3,300	1,443.00	4,761,900	
三晃金属工業	200	2,081.00	416,200	
朝日工業社	300	2,925.00	877,500	
明星工業	2,600	817.00	2,124,200	
大氣社	1,900	3,005.00	5,709,500	
ダイダン	1,000	2,655.00	2,655,000	
日比谷総合設備	1,300	1,796.00	2,334,800	
フィル・カンパニー	200	1,723.00	344,600	
ＯＳＪＢホールディングス	6,200	228.00	1,413,600	
東洋エンジニアリング	1,700	328.00	557,600	
レイズネクスト	2,100	1,274.00	2,675,400	
日本製粉	3,700	1,673.00	6,190,100	
日清製粉グループ本社	14,400	1,751.00	25,214,400	
日東富士製粉	100	6,130.00	613,000	
昭和産業	1,200	3,485.00	4,182,000	
鳥越製粉	1,100	927.00	1,019,700	
中部飼料	1,600	1,597.00	2,555,200	
フィード・ワン	8,500	200.00	1,700,000	
東洋精糖	200	1,220.00	244,000	
日本甜菜製糖	700	1,780.00	1,246,000	
三井製糖	1,100	1,972.00	2,169,200	
塩水港精糖	1,300	236.00	306,800	
日新製糖	600	1,800.00	1,080,000	
森永製菓	3,000	4,030.00	12,090,000	
中村屋	300	4,180.00	1,254,000	
江崎グリコ	3,500	4,795.00	16,782,500	
名糖産業	600	1,451.00	870,600	
井村屋グループ	700	2,438.00	1,706,600	
不二家	800	2,171.00	1,736,800	

山崎製パン	9,500	1,730.00	16,435,000	
第一屋製パン	200	985.00	197,000	
モロゾフ	200	5,390.00	1,078,000	
亀田製菓	700	5,400.00	3,780,000	
寿スピリッツ	1,200	4,125.00	4,950,000	
カルビー	5,800	3,330.00	19,314,000	
森永乳業	2,400	4,995.00	11,988,000	
六甲バター	800	1,690.00	1,352,000	
ヤクルト本社	8,800	6,000.00	52,800,000	
明治ホールディングス	8,400	8,520.00	71,568,000	
雪印メグミルク	3,100	2,400.00	7,440,000	
プリマハム	2,000	3,020.00	6,040,000	
日本ハム	4,900	4,805.00	23,544,500	
林兼産業	400	561.00	224,400	
丸大食品	1,400	1,820.00	2,548,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,000	3,005.00	3,005,000	
柿安本店	400	2,480.00	992,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,200	670.00	5,494,000	
サッポロホールディングス	4,300	1,892.00	8,135,600	
アサヒグループホールディングス	26,700	3,658.00	97,668,600	
キリンホールディングス	54,000	2,102.00	113,508,000	
宝ホールディングス	9,400	1,012.00	9,512,800	
オエノンホールディングス	3,600	425.00	1,530,000	
養命酒製造	400	1,802.00	720,800	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	9,700	1,708.00	16,567,600	
サントリー食品インターナショナル	8,500	3,895.00	33,107,500	
ダイドーグループホールディングス	700	4,735.00	3,314,500	
伊藤園	3,900	6,120.00	23,868,000	
キーコーヒー	1,300	2,114.00	2,748,200	
ユニカフェ	400	945.00	378,000	
ジャパンフーズ	200	1,213.00	242,600	
日清オイリオグループ	1,600	3,245.00	5,192,000	
不二製油グループ本社	3,100	3,005.00	9,315,500	
かどや製油	100	3,760.00	376,000	
Ｊ－オイルミルズ	700	3,805.00	2,663,500	

キッコーマン	9,200	5,750.00	52,900,000	
味の素	28,100	1,896.50	53,291,650	
キユーピー	7,100	1,991.00	14,136,100	
ハウス食品グループ本社	4,800	3,550.00	17,040,000	
カゴメ	5,200	3,230.00	16,796,000	
焼津水産化学工業	600	919.00	551,400	
アリアケジャパン	1,200	7,260.00	8,712,000	
ピエトロ	200	1,663.00	332,600	
エバラ食品工業	300	2,212.00	663,600	
やまみ	100	2,129.00	212,900	
ニチレイ	6,100	2,966.00	18,092,600	
東洋水産	6,600	6,230.00	41,118,000	
イートアンド	400	1,804.00	721,600	
大冷	200	2,137.00	427,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	929.00	650,300	
日清食品ホールディングス	5,400	10,620.00	57,348,000	
永谷園ホールディングス	600	2,205.00	1,323,000	
一正蒲鉾	500	1,021.00	510,500	
フジッコ	1,400	2,009.00	2,812,600	
ロック・フィールド	1,400	1,289.00	1,804,600	
日本たばこ産業	68,300	1,990.00	135,917,000	
ケンコーマヨネーズ	700	1,750.00	1,225,000	
わらべや日洋ホールディングス	800	1,535.00	1,228,000	
なとり	700	1,920.00	1,344,000	
イフジ産業	200	848.00	169,600	
ピックルスコーポレーション	300	2,816.00	844,800	
北の達人コーポレーション	4,400	502.00	2,208,800	
ユーグレナ	5,500	716.00	3,938,000	
ミヨシ油脂	400	1,138.00	455,200	
理研ビタミン	1,200	2,226.00	2,671,200	
片倉工業	1,700	1,156.00	1,965,200	
グンゼ	900	3,865.00	3,478,500	
東洋紡	4,900	1,510.00	7,399,000	
ユニチカ	3,600	371.00	1,335,600	
富士紡ホールディングス	600	3,460.00	2,076,000	
倉敷紡績	1,200	2,014.00	2,416,800	

シキボウ	700	973.00	681,100	
日本毛織	4,100	967.00	3,964,700	
ダイトウボウ	1,900	110.00	209,000	
トーア紡コーポレーション	500	460.00	230,000	
ダイドーリミテッド	1,600	197.00	315,200	
帝国繊維	1,400	2,534.00	3,547,600	
帝人	10,100	1,680.00	16,968,000	
東レ	90,000	504.60	45,414,000	
サカイオーベックス	300	2,157.00	647,100	
住江織物	300	1,803.00	540,900	
日本フエルト	700	458.00	320,600	
イチカワ	200	1,344.00	268,800	
日東製網	100	1,410.00	141,000	
アツギ	1,000	496.00	496,000	
ダイニック	500	777.00	388,500	
セーレン	3,100	1,220.00	3,782,000	
ソトー	500	947.00	473,500	
東海染工	200	1,125.00	225,000	
小松マテーレ	2,000	771.00	1,542,000	
ワコールホールディングス	3,100	1,846.00	5,722,600	
ホギメディカル	1,400	3,260.00	4,564,000	
クラウディアホールディングス	300	311.00	93,300	
ＴＳＩホールディングス	3,800	338.00	1,284,400	
マツオカコーポレーション	400	1,991.00	796,400	
ワールド	1,800	1,573.00	2,831,400	
三陽商会	600	603.00	361,800	
ナイガイ	400	355.00	142,000	
オンワードホールディングス	7,400	294.00	2,175,600	
ルックホールディングス	400	737.00	294,800	
キムラタン	6,200	25.00	155,000	
ゴールドウイン	2,300	6,840.00	15,732,000	
デサント	2,400	1,899.00	4,557,600	
キング	600	563.00	337,800	
ヤマトインターナショナル	1,100	368.00	404,800	
特種東海製紙	800	4,665.00	3,732,000	
王子ホールディングス	51,900	467.00	24,237,300	

日本製紙	5,500	1,364.00	7,502,000	
三菱製紙	1,400	342.00	478,800	
北越コーポレーション	7,400	362.00	2,678,800	
中越パルプ工業	500	1,568.00	784,000	
巴川製紙所	400	851.00	340,400	
大王製紙	5,500	1,452.00	7,986,000	
阿波製紙	300	492.00	147,600	
レンゴー	11,700	806.00	9,430,200	
トーモク	800	1,650.00	1,320,000	
ザ・パック	900	2,657.00	2,391,300	
クラレ	19,600	1,115.00	21,854,000	
旭化成	82,400	900.70	74,217,680	
共和レザー	700	553.00	387,100	
昭和電工	9,400	2,251.00	21,159,400	
住友化学	91,300	353.00	32,228,900	
住友精化	600	3,550.00	2,130,000	
日産化学	6,900	5,560.00	38,364,000	
ラサ工業	400	1,698.00	679,200	
クレハ	1,100	4,685.00	5,153,500	
多木化学	500	5,990.00	2,995,000	
テイカ	900	1,362.00	1,225,800	
石原産業	2,200	729.00	1,603,800	
片倉コープアグリ	300	1,237.00	371,100	
日本曹達	1,800	2,993.00	5,387,400	
東ソー	19,200	1,490.00	28,608,000	
トクヤマ	3,600	2,656.00	9,561,600	
セントラル硝子	2,500	2,076.00	5,190,000	
東亜合成	7,800	1,055.00	8,229,000	
大阪ソーダ	1,300	2,497.00	3,246,100	
関東電化工業	2,900	778.00	2,256,200	
デンカ	4,500	2,877.00	12,946,500	
信越化学工業	21,300	12,800.00	272,640,000	
日本カーバイド工業	400	1,182.00	472,800	
堺化学工業	800	1,965.00	1,572,000	
第一稀元素化学工業	1,300	737.00	958,100	
エア・ウォーター	11,600	1,479.00	17,156,400	

大陽日酸	11,900	1,911.00	22,740,900	
日本化学工業	400	2,303.00	921,200	
東邦アセチレン	200	1,263.00	252,600	
日本パーカライジング	6,300	1,060.00	6,678,000	
高圧ガス工業	2,000	789.00	1,578,000	
チタン工業	200	1,716.00	343,200	
四国化成工業	1,800	1,147.00	2,064,600	
戸田工業	300	2,239.00	671,700	
ステラ　ケミファ	700	2,648.00	1,853,600	
保土谷化学工業	500	5,030.00	2,515,000	
日本触媒	1,900	5,480.00	10,412,000	
大日精化工業	1,100	2,239.00	2,462,900	
カネカ	3,200	2,744.00	8,780,800	
三菱瓦斯化学	11,600	1,842.00	21,367,200	
三井化学	11,535	2,420.00	27,914,845	
ＪＳＲ	11,600	2,343.00	27,178,800	
東京応化工業	2,100	5,490.00	11,529,000	
大阪有機化学工業	1,100	2,575.00	2,832,500	
三菱ケミカルホールディングス	83,100	616.90	51,264,390	
ＫＨネオケム	2,000	2,165.00	4,330,000	
ダイセル	16,200	712.00	11,534,400	
住友ベークライト	2,000	2,789.00	5,578,000	
積水化学工業	26,300	1,641.00	43,158,300	
日本ゼオン	11,200	1,112.00	12,454,400	
アイカ工業	3,700	3,635.00	13,449,500	
宇部興産	6,300	1,888.00	11,894,400	
積水樹脂	2,200	2,143.00	4,714,600	
タキロンシーアイ	2,700	705.00	1,903,500	
旭有機材	700	1,314.00	919,800	
ニチバン	700	1,523.00	1,066,100	
リケンテクノス	3,100	396.00	1,227,600	
大倉工業	600	1,488.00	892,800	
積水化成品工業	1,700	547.00	929,900	
群栄化学工業	300	2,393.00	717,900	
タイガースポリマー	700	438.00	306,600	
ミライアル	400	1,026.00	410,400	

ダイキアクシス	400	904.00	361,600	
ダイキョーニシカワ	2,600	527.00	1,370,200	
竹本容器	400	955.00	382,000	
森六ホールディングス	700	1,745.00	1,221,500	
日本化薬	7,700	1,091.00	8,400,700	
カーリットホールディングス	1,300	492.00	639,600	
日本精化	1,000	1,515.00	1,515,000	
扶桑化学工業	1,300	3,735.00	4,855,500	
トリケミカル研究所	300	10,310.00	3,093,000	
ＡＤＥＫＡ	5,700	1,512.00	8,618,400	
日油	4,700	4,205.00	19,763,500	
新日本理化	2,000	160.00	320,000	
ハリマ化成グループ	1,000	963.00	963,000	
花王	30,400	8,041.00	244,446,400	
第一工業製薬	500	4,495.00	2,247,500	
石原ケミカル	300	2,011.00	603,300	
日華化学	400	894.00	357,600	
ニイタカ	300	3,105.00	931,500	
三洋化成工業	700	4,785.00	3,349,500	
有機合成薬品工業	900	345.00	310,500	
大日本塗料	1,400	920.00	1,288,000	
日本ペイントホールディングス	10,300	8,010.00	82,503,000	
関西ペイント	14,000	2,414.00	33,796,000	
神東塗料	900	160.00	144,000	
中国塗料	3,500	966.00	3,381,000	
日本特殊塗料	900	953.00	857,700	
藤倉化成	1,700	524.00	890,800	
太陽ホールディングス	900	5,490.00	4,941,000	
ＤＩＣ	5,200	2,548.00	13,249,600	
サカタインクス	2,700	996.00	2,689,200	
東洋インキＳＣホールディングス	2,600	1,928.00	5,012,800	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,000	751.00	751,000	
富士フイルムホールディングス	24,300	5,071.00	123,225,300	
資生堂	25,200	5,662.00	142,682,400	
ライオン	16,500	2,300.00	37,950,000	
高砂香料工業	800	2,013.00	1,610,400	

マンダム	2,900	1,685.00	4,886,500	
ミルボン	1,700	5,590.00	9,503,000	
ファンケル	5,100	3,125.00	15,937,500	
コーセー	2,400	11,960.00	28,704,000	
コタ	700	1,205.00	843,500	
シーボン	200	1,838.00	367,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	5,400	1,881.00	10,157,400	
ノエビアホールディングス	1,100	4,710.00	5,181,000	
アジュバンコスメジャパン	300	959.00	287,700	
エステー	800	2,067.00	1,653,600	
アグロ　カネショウ	500	1,505.00	752,500	
コニシ	2,100	1,474.00	3,095,400	
長谷川香料	2,200	2,183.00	4,802,600	
星光ＰＭＣ	700	661.00	462,700	
小林製薬	3,600	9,260.00	33,336,000	
荒川化学工業	1,100	1,249.00	1,373,900	
メック	900	1,830.00	1,647,000	
日本高純度化学	300	2,679.00	803,700	
タカラバイオ	3,300	2,997.00	9,890,100	
ＪＣＵ	1,500	3,525.00	5,287,500	
新田ゼラチン	800	672.00	537,600	
ＯＡＴアグリオ	200	1,093.00	218,600	
デクセリアルズ	3,300	1,005.00	3,316,500	
アース製薬	900	7,650.00	6,885,000	
北興化学工業	1,200	646.00	775,200	
大成ラミック	400	2,805.00	1,122,000	
クミアイ化学工業	5,200	1,092.00	5,678,400	
日本農薬	2,300	529.00	1,216,700	
アキレス	900	1,861.00	1,674,900	
有沢製作所	2,000	854.00	1,708,000	
日東電工	8,800	6,210.00	54,648,000	
レック	1,400	1,696.00	2,374,400	
三光合成	1,400	266.00	372,400	
きもと	2,100	152.00	319,200	
藤森工業	1,100	3,885.00	4,273,500	
前澤化成工業	800	1,000.00	800,000	

未来工業	700	1,956.00	1,369,200	
ウェーブロックホールディングス	400	794.00	317,600	
ＪＳＰ	700	1,603.00	1,122,100	
エフピコ	1,400	8,230.00	11,522,000	
天馬	800	1,788.00	1,430,400	
信越ポリマー	2,300	871.00	2,003,300	
東リ	3,100	251.00	778,100	
ニフコ	4,700	2,554.00	12,003,800	
バルカー	1,000	1,885.00	1,885,000	
ユニ・チャーム	26,900	4,648.00	125,031,200	
ショーエイコーポレーション	200	1,180.00	236,000	
協和キリン	12,800	2,718.00	34,790,400	
武田薬品工業	105,600	3,975.00	419,760,000	
アステラス製薬	110,000	1,761.00	193,710,000	
大日本住友製薬	9,400	1,402.00	13,178,800	
塩野義製薬	16,000	6,111.00	97,776,000	
わかもと製薬	1,500	273.00	409,500	
あすか製薬	1,400	1,198.00	1,677,200	
日本新薬	3,300	8,870.00	29,271,000	
ビオフェルミン製薬	200	2,399.00	479,800	
中外製薬	39,700	4,810.00	190,957,000	
科研製薬	2,200	4,980.00	10,956,000	
エーザイ	15,200	9,611.00	146,087,200	
ロート製薬	6,500	3,475.00	22,587,500	
小野薬品工業	29,100	3,233.00	94,080,300	
久光製薬	3,400	4,970.00	16,898,000	
持田製薬	1,800	3,990.00	7,182,000	
参天製薬	23,600	2,016.00	47,577,600	
扶桑薬品工業	400	2,661.00	1,064,400	
日本ケミファ	200	2,392.00	478,400	
ツムラ	3,900	2,881.00	11,235,900	
日医工	3,600	1,219.00	4,388,400	
キッセイ薬品工業	2,200	2,406.00	5,293,200	
生化学工業	2,500	1,047.00	2,617,500	
栄研化学	2,200	1,887.00	4,151,400	
日水製薬	500	1,118.00	559,000	

鳥居薬品	800	2,988.00	2,390,400	
ＪＣＲファーマ	900	12,320.00	11,088,000	
東和薬品	1,600	2,134.00	3,414,400	
富士製薬工業	900	1,156.00	1,040,400	
沢井製薬	2,600	5,300.00	13,780,000	
ゼリア新薬工業	2,300	1,970.00	4,531,000	
第一三共	36,300	9,617.00	349,097,100	
キョーリン製薬ホールディングス	2,800	2,010.00	5,628,000	
大幸薬品	1,500	2,700.00	4,050,000	
ダイト	800	3,555.00	2,844,000	
大塚ホールディングス	26,400	4,727.00	124,792,800	
大正製薬ホールディングス	2,700	6,550.00	17,685,000	
ペプチドリーム	6,400	4,500.00	28,800,000	
日本コークス工業	10,700	64.00	684,800	
ニチレキ	1,500	1,652.00	2,478,000	
ユシロ化学工業	700	1,321.00	924,700	
ビーピー・カストロール	500	1,125.00	562,500	
富士石油	3,300	192.00	633,600	
ＭＯＲＥＳＣＯ	500	1,001.00	500,500	
出光興産	14,100	2,357.00	33,233,700	
ＥＮＥＯＳホールディングス	190,800	417.10	79,582,680	
コスモエネルギーホールディングス	3,700	1,682.00	6,223,400	
横浜ゴム	7,300	1,618.00	11,811,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	6,700	1,693.00	11,343,100	
ブリヂストン	33,700	3,293.00	110,974,100	
住友ゴム工業	11,400	995.00	11,343,000	
藤倉コンポジット	1,100	354.00	389,400	
オカモト	800	4,330.00	3,464,000	
フコク	600	641.00	384,600	
ニッタ	1,400	2,392.00	3,348,800	
住友理工	2,500	550.00	1,375,000	
三ツ星ベルト	1,700	1,709.00	2,905,300	
バンドー化学	2,200	645.00	1,419,000	
日東紡績	1,900	4,130.00	7,847,000	
ＡＧＣ	11,600	3,080.00	35,728,000	
日本板硝子	6,100	403.00	2,458,300	

石塚硝子	200	1,917.00	383,400	
日本山村硝子	500	852.00	426,000	
日本電気硝子	4,700	1,893.00	8,897,100	
オハラ	500	1,024.00	512,000	
住友大阪セメント	2,400	3,650.00	8,760,000	
太平洋セメント	8,000	2,546.00	20,368,000	
日本ヒューム	1,300	764.00	993,200	
日本コンクリート工業	2,700	286.00	772,200	
三谷セキサン	600	6,490.00	3,894,000	
アジアパイルホールディングス	1,800	467.00	840,600	
東海カーボン	12,400	972.00	12,052,800	
日本カーボン	700	3,455.00	2,418,500	
東洋炭素	700	1,750.00	1,225,000	
ノリタケカンパニーリミテド	700	3,265.00	2,285,500	
ＴＯＴＯ	9,100	4,430.00	40,313,000	
日本碍子	15,200	1,540.00	23,408,000	
日本特殊陶業	9,700	1,804.00	17,498,800	
ダントーホールディングス	900	183.00	164,700	
ＭＡＲＵＷＡ	500	9,000.00	4,500,000	
品川リフラクトリーズ	300	2,277.00	683,100	
黒崎播磨	300	3,260.00	978,000	
ヨータイ	1,000	740.00	740,000	
イソライト工業	700	427.00	298,900	
東京窯業	1,600	312.00	499,200	
ニッカトー	600	682.00	409,200	
フジミインコーポレーテッド	1,100	3,795.00	4,174,500	
クニミネ工業	500	990.00	495,000	
エーアンドエーマテリアル	200	1,021.00	204,200	
ニチアス	3,500	2,458.00	8,603,000	
ニチハ	1,800	2,453.00	4,415,400	
日本製鉄	56,100	1,020.00	57,222,000	
神戸製鋼所	23,000	395.00	9,085,000	
中山製鋼所	1,700	356.00	605,200	
合同製鐵	700	1,916.00	1,341,200	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	33,900	787.00	26,679,300	
東京製鐵	6,100	688.00	4,196,800	

共英製鋼	1,400	1,285.00	1,799,000	
大和工業	2,700	2,559.00	6,909,300	
東京鐵鋼	500	1,555.00	777,500	
大阪製鐵	700	1,096.00	767,200	
淀川製鋼所	1,700	1,885.00	3,204,500	
丸一鋼管	4,100	2,822.00	11,570,200	
モリ工業	400	2,240.00	896,000	
大同特殊鋼	2,100	3,405.00	7,150,500	
日本高周波鋼業	500	334.00	167,000	
日本冶金工業	1,000	1,539.00	1,539,000	
山陽特殊製鋼	900	889.00	800,100	
愛知製鋼	700	2,680.00	1,876,000	
日立金属	13,500	1,509.00	20,371,500	
日本金属	300	556.00	166,800	
大平洋金属	800	1,676.00	1,340,800	
新日本電工	8,000	195.00	1,560,000	
栗本鐵工所	600	1,895.00	1,137,000	
虹技	200	1,209.00	241,800	
日本鋳鉄管	100	1,248.00	124,800	
三菱製鋼	900	567.00	510,300	
日亜鋼業	1,800	274.00	493,200	
日本精線	200	3,220.00	644,000	
エンビプロ・ホールディングス	500	534.00	267,000	
シンニッタン	1,900	218.00	414,200	
新家工業	300	1,023.00	306,900	
大紀アルミニウム工業所	2,100	544.00	1,142,400	
日本軽金属ホールディングス	31,700	186.00	5,896,200	
三井金属鉱業	3,400	2,558.00	8,697,200	
東邦亜鉛	600	1,764.00	1,058,400	
三菱マテリアル	8,300	2,233.00	18,533,900	
住友金属鉱山	16,000	3,274.00	52,384,000	
ＤＯＷＡホールディングス	3,200	3,255.00	10,416,000	
古河機械金属	2,200	1,062.00	2,336,400	
エス・サイエンス	5,300	46.00	243,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	888.00	1,154,400	
東邦チタニウム	2,200	677.00	1,489,400	

ＵＡＣＪ	1,900	1,930.00	3,667,000	
ＣＫサンエツ	300	3,110.00	933,000	
古河電気工業	3,900	2,426.00	9,461,400	
住友電気工業	46,900	1,293.00	60,641,700	
フジクラ	15,100	311.00	4,696,100	
昭和電線ホールディングス	1,500	1,110.00	1,665,000	
東京特殊電線	200	2,250.00	450,000	
タツタ電線	2,500	598.00	1,495,000	
カナレ電気	200	1,596.00	319,200	
平河ヒューテック	600	975.00	585,000	
リョービ	1,500	1,169.00	1,753,500	
アーレスティ	1,600	327.00	523,200	
アサヒホールディングス	2,200	3,475.00	7,645,000	
稲葉製作所	700	1,308.00	915,600	
宮地エンジニアリンググループ	400	1,640.00	656,000	
トーカロ	3,500	1,170.00	4,095,000	
アルファＣｏ	400	931.00	372,400	
ＳＵＭＣＯ	16,100	1,545.00	24,874,500	
川田テクノロジーズ	300	4,550.00	1,365,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	400	3,750.00	1,500,000	
信和	700	695.00	486,500	
東洋製罐グループホールディングス	8,000	1,192.00	9,536,000	
ホッカンホールディングス	700	1,578.00	1,104,600	
コロナ	700	996.00	697,200	
横河ブリッジホールディングス	2,300	1,890.00	4,347,000	
駒井ハルテック	200	1,347.00	269,400	
高田機工	100	2,335.00	233,500	
三和ホールディングス	11,800	974.00	11,493,200	
文化シヤッター	3,700	738.00	2,730,600	
三協立山	1,600	906.00	1,449,600	
アルインコ	900	902.00	811,800	
東洋シヤッター	300	713.00	213,900	
ＬＩＸＩＬグループ	18,500	1,715.00	31,727,500	
日本フイルコン	900	541.00	486,900	
ノーリツ	2,600	1,342.00	3,489,200	
長府製作所	1,300	2,144.00	2,787,200	

リンナイ	2,400	9,420.00	22,608,000	
ダイニチ工業	700	667.00	466,900	
日東精工	1,600	458.00	732,800	
三洋工業	200	1,886.00	377,200	
岡部	2,500	794.00	1,985,000	
ジーテクト	1,600	998.00	1,596,800	
東プレ	2,300	1,103.00	2,536,900	
高周波熱錬	2,400	506.00	1,214,400	
東京製綱	900	536.00	482,400	
サンコール	900	395.00	355,500	
モリテック　スチール	1,000	294.00	294,000	
パイオラックス	1,900	1,621.00	3,079,900	
エイチワン	1,200	538.00	645,600	
日本発條	13,500	660.00	8,910,000	
中央発條	200	2,553.00	510,600	
アドバネクス	200	1,370.00	274,000	
立川ブラインド工業	600	1,208.00	724,800	
三益半導体工業	1,000	2,166.00	2,166,000	
日本ドライケミカル	300	1,548.00	464,400	
日本製鋼所	3,800	1,613.00	6,129,400	
三浦工業	5,400	4,270.00	23,058,000	
タクマ	4,200	1,657.00	6,959,400	
ツガミ	2,600	1,087.00	2,826,200	
オークマ	1,500	4,765.00	7,147,500	
芝浦機械	1,400	2,068.00	2,895,200	
アマダ	15,600	854.00	13,322,400	
アイダエンジニアリング	3,300	693.00	2,286,900	
滝澤鉄工所	400	1,021.00	408,400	
ＦＵＪＩ	5,400	2,065.00	11,151,000	
牧野フライス製作所	1,500	3,585.00	5,377,500	
オーエスジー	6,200	1,566.00	9,709,200	
ダイジェット工業	100	1,345.00	134,500	
旭ダイヤモンド工業	3,300	490.00	1,617,000	
ＤＭＧ森精機	7,900	1,301.00	10,277,900	
ソディック	2,700	841.00	2,270,700	
ディスコ	1,700	25,770.00	43,809,000	

日東工器	700	1,978.00	1,384,600	
日進工具	500	2,511.00	1,255,500	
パンチ工業	1,100	402.00	442,200	
冨士ダイス	600	671.00	402,600	
豊和工業	700	825.00	577,500	
ＯＫＫ	500	350.00	175,000	
石川製作所	300	1,797.00	539,100	
東洋機械金属	900	412.00	370,800	
津田駒工業	200	775.00	155,000	
エンシュウ	300	902.00	270,600	
島精機製作所	2,000	1,445.00	2,890,000	
オプトラン	1,600	2,314.00	3,702,400	
ＮＣホールディングス	400	595.00	238,000	
イワキポンプ	800	987.00	789,600	
フリュー	1,200	939.00	1,126,800	
ヤマシンフィルタ	2,700	1,160.00	3,132,000	
日阪製作所	1,500	789.00	1,183,500	
やまびこ	2,400	1,049.00	2,517,600	
平田機工	600	6,140.00	3,684,000	
ペガサスミシン製造	1,300	276.00	358,800	
マルマエ	500	1,006.00	503,000	
タツモ	500	1,516.00	758,000	
ナブテスコ	7,400	3,295.00	24,383,000	
三井海洋開発	1,300	1,768.00	2,298,400	
レオン自動機	1,200	1,072.00	1,286,400	
ＳＭＣ	4,000	59,520.00	238,080,000	
ホソカワミクロン	400	5,660.00	2,264,000	
ユニオンツール	500	2,848.00	1,424,000	
オイレス工業	1,600	1,423.00	2,276,800	
日精エー・エス・ビー機械	400	3,735.00	1,494,000	
サトーホールディングス	1,800	2,107.00	3,792,600	
技研製作所	1,100	3,960.00	4,356,000	
日本エアーテック	400	1,383.00	553,200	
カワタ	400	772.00	308,800	
日精樹脂工業	1,100	849.00	933,900	
オカダアイヨン	400	994.00	397,600	

ワイエイシイホールディングス	500	656.00	328,000	
小松製作所	57,500	2,237.50	128,656,250	
住友重機械工業	7,300	2,516.00	18,366,800	
日立建機	5,100	3,505.00	17,875,500	
日工	1,700	667.00	1,133,900	
巴工業	500	1,894.00	947,000	
井関農機	1,300	1,208.00	1,570,400	
ＴＯＷＡ	1,300	1,227.00	1,595,100	
丸山製作所	300	1,263.00	378,900	
北川鉄工所	600	1,441.00	864,600	
ローツェ	600	5,450.00	3,270,000	
タカキタ	400	629.00	251,600	
クボタ	67,300	1,719.00	115,688,700	
荏原実業	300	2,991.00	897,300	
三菱化工機	400	1,823.00	729,200	
月島機械	2,300	1,252.00	2,879,600	
帝国電機製作所	1,000	1,161.00	1,161,000	
東京機械製作所	500	283.00	141,500	
新東工業	3,000	735.00	2,205,000	
澁谷工業	1,100	2,868.00	3,154,800	
アイチ　コーポレーション	2,200	820.00	1,804,000	
小森コーポレーション	3,200	758.00	2,425,600	
鶴見製作所	1,000	1,857.00	1,857,000	
住友精密工業	200	2,145.00	429,000	
日本ギア工業	500	280.00	140,000	
酒井重工業	200	2,371.00	474,200	
荏原製作所	5,300	2,819.00	14,940,700	
石井鐵工所	200	2,571.00	514,200	
酉島製作所	1,300	865.00	1,124,500	
北越工業	1,300	1,101.00	1,431,300	
ダイキン工業	16,200	19,685.00	318,897,000	
オルガノ	500	5,710.00	2,855,000	
トーヨーカネツ	600	2,274.00	1,364,400	
栗田工業	6,900	3,220.00	22,218,000	
椿本チエイン	1,800	2,552.00	4,593,600	
大同工業	600	583.00	349,800	

木村化工機	1,100	422.00	464,200	
アネスト岩田	2,000	820.00	1,640,000	
ダイフク	6,500	9,720.00	63,180,000	
サムコ	300	2,798.00	839,400	
加藤製作所	700	1,128.00	789,600	
油研工業	200	1,473.00	294,600	
タダノ	6,100	892.00	5,441,200	
フジテック	4,600	1,893.00	8,707,800	
ＣＫＤ	3,500	1,810.00	6,335,000	
キトー	1,000	1,195.00	1,195,000	
平和	3,500	1,799.00	6,296,500	
理想科学工業	1,100	1,280.00	1,408,000	
ＳＡＮＫＹＯ	2,800	2,855.00	7,994,000	
日本金銭機械	1,400	568.00	795,200	
マースグループホールディングス	800	1,656.00	1,324,800	
フクシマガリレイ	800	3,485.00	2,788,000	
オーイズミ	500	359.00	179,500	
ダイコク電機	600	1,078.00	646,800	
竹内製作所	2,100	1,984.00	4,166,400	
アマノ	3,300	2,237.00	7,382,100	
ＪＵＫＩ	1,800	475.00	855,000	
サンデンホールディングス	1,600	283.00	452,800	
蛇の目ミシン工業	1,200	609.00	730,800	
マックス	1,900	1,609.00	3,057,100	
グローリー	3,300	2,341.00	7,725,300	
新晃工業	1,200	1,370.00	1,644,000	
大和冷機工業	2,000	899.00	1,798,000	
セガサミーホールディングス	12,600	1,267.00	15,964,200	
日本ピストンリング	500	1,092.00	546,000	
リケン	600	2,692.00	1,615,200	
ＴＰＲ	1,700	1,368.00	2,325,600	
ツバキ・ナカシマ	2,400	800.00	1,920,000	
ホシザキ	4,000	7,950.00	31,800,000	
大豊工業	1,000	528.00	528,000	
日本精工	23,900	835.00	19,956,500	
ＮＴＮ	29,300	207.00	6,065,100	

ジェイテクト	12,200	847.00	10,333,400	
不二越	1,200	3,300.00	3,960,000	
日本トムソン	3,800	340.00	1,292,000	
ＴＨＫ	7,900	2,505.00	19,789,500	
ユーシン精機	1,000	685.00	685,000	
前澤給装工業	500	2,088.00	1,044,000	
イーグル工業	1,600	745.00	1,192,000	
前澤工業	800	433.00	346,400	
日本ピラー工業	1,300	1,500.00	1,950,000	
キッツ	5,100	653.00	3,330,300	
マキタ	16,500	4,815.00	79,447,500	
日立造船	10,100	406.00	4,100,600	
三菱重工業	21,300	2,674.00	56,956,200	
ＩＨＩ	9,100	1,554.00	14,141,400	
スター精密	2,000	1,333.00	2,666,000	
日清紡ホールディングス	7,800	729.00	5,686,200	
イビデン	7,800	3,645.00	28,431,000	
コニカミノルタ	27,700	342.00	9,473,400	
ブラザー工業	15,500	1,819.00	28,194,500	
ミネベアミツミ	23,600	1,888.00	44,556,800	
日立製作所	61,000	3,591.00	219,051,000	
三菱電機	126,900	1,447.50	183,687,750	
富士電機	7,600	3,175.00	24,130,000	
東洋電機製造	500	1,094.00	547,000	
安川電機	13,700	3,815.00	52,265,500	
シンフォニアテクノロジー	1,600	1,071.00	1,713,600	
明電舎	2,300	1,699.00	3,907,700	
オリジン	300	1,216.00	364,800	
山洋電気	600	5,150.00	3,090,000	
デンヨー	1,100	2,098.00	2,307,800	
東芝テック	1,600	4,430.00	7,088,000	
芝浦メカトロニクス	200	2,952.00	590,400	
マブチモーター	3,500	3,780.00	13,230,000	
日本電産	30,500	9,043.00	275,811,500	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	401.00	320,800	
トレックス・セミコンダクター	700	1,219.00	853,300	

東光高岳	700	990.00	693,000	
ダブル・スコープ	2,000	890.00	1,780,000	
宮越ホールディングス	500	672.00	336,000	
ダイヘン	1,400	3,970.00	5,558,000	
ヤーマン	2,100	1,180.00	2,478,000	
ＪＶＣケンウッド	10,300	155.00	1,596,500	
ミマキエンジニアリング	1,100	398.00	437,800	
Ｉ－ＰＥＸ	600	2,076.00	1,245,600	
日新電機	3,000	1,067.00	3,201,000	
大崎電気工業	2,500	530.00	1,325,000	
オムロン	11,400	7,830.00	89,262,000	
日東工業	1,900	1,900.00	3,610,000	
ＩＤＥＣ	1,800	1,742.00	3,135,600	
正興電機製作所	300	1,007.00	302,100	
不二電機工業	200	1,327.00	265,400	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	4,200	1,773.00	7,446,600	
サクサホールディングス	300	1,428.00	428,400	
メルコホールディングス	400	2,668.00	1,067,200	
テクノメディカ	300	1,774.00	532,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	594.00	178,200	
日本電気	15,400	5,430.00	83,622,000	
富士通	12,200	14,030.00	171,166,000	
沖電気工業	5,200	1,017.00	5,288,400	
岩崎通信機	600	843.00	505,800	
電気興業	600	2,429.00	1,457,400	
サンケン電気	1,400	2,358.00	3,301,200	
ナカヨ	200	1,342.00	268,400	
アイホン	700	1,434.00	1,003,800	
ルネサスエレクトロニクス	54,200	684.00	37,072,800	
セイコーエプソン	15,700	1,243.00	19,515,100	
ワコム	8,500	675.00	5,737,500	
アルバック	2,300	3,775.00	8,682,500	
アクセル	500	906.00	453,000	
ＥＩＺＯ	1,000	3,940.00	3,940,000	
ジャパンディスプレイ	36,700	49.00	1,798,300	

日本信号	3,200	1,054.00	3,372,800	
京三製作所	3,000	511.00	1,533,000	
能美防災	1,700	2,099.00	3,568,300	
ホーチキ	900	1,193.00	1,073,700	
星和電機	600	558.00	334,800	
エレコム	1,400	5,230.00	7,322,000	
パナソニック	144,900	932.00	135,046,800	
シャープ	14,700	1,257.00	18,477,900	
アンリツ	8,200	2,383.00	19,540,600	
富士通ゼネラル	3,400	2,721.00	9,251,400	
ソニー	79,500	8,826.00	701,667,000	
ＴＤＫ	6,100	11,720.00	71,492,000	
帝国通信工業	600	1,181.00	708,600	
タムラ製作所	4,200	495.00	2,079,000	
アルプスアルパイン	11,200	1,575.00	17,640,000	
池上通信機	400	802.00	320,800	
日本電波工業	1,100	323.00	355,300	
鈴木	600	695.00	417,000	
日本トリム	200	3,715.00	743,000	
ローランド　ディー．ジー．	700	1,203.00	842,100	
フォスター電機	1,300	1,110.00	1,443,000	
ＳＭＫ	300	2,451.00	735,300	
ヨコオ	800	2,696.00	2,156,800	
ティアック	900	110.00	99,000	
ホシデン	3,500	927.00	3,244,500	
ヒロセ電機	2,000	12,630.00	25,260,000	
日本航空電子工業	2,900	1,363.00	3,952,700	
ＴＯＡ	1,400	717.00	1,003,800	
マクセルホールディングス	2,700	1,008.00	2,721,600	
古野電気	1,600	972.00	1,555,200	
ユニデンホールディングス	300	1,612.00	483,600	
スミダコーポレーション	1,100	642.00	706,200	
アイコム	700	2,854.00	1,997,800	
リオン	500	2,230.00	1,115,000	
本多通信工業	1,100	415.00	456,500	
船井電機	1,300	524.00	681,200	

横河電機	11,600	1,706.00	19,789,600	
新電元工業	400	1,986.00	794,400	
アズビル	8,000	3,450.00	27,600,000	
東亜ディーケーケー	600	850.00	510,000	
日本光電工業	5,200	3,720.00	19,344,000	
チノー	400	1,379.00	551,600	
共和電業	1,300	414.00	538,200	
日本電子材料	500	1,690.00	845,000	
堀場製作所	2,500	6,220.00	15,550,000	
アドバンテスト	9,400	5,550.00	52,170,000	
小野測器	500	495.00	247,500	
エスペック	1,100	1,782.00	1,960,200	
キーエンス	11,500	45,730.00	525,895,000	
日置電機	600	3,410.00	2,046,000	
シスメックス	9,100	8,442.00	76,822,200	
日本マイクロニクス	2,200	1,195.00	2,629,000	
メガチップス	1,200	2,173.00	2,607,600	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	700	3,590.00	2,513,000	
澤藤電機	200	1,668.00	333,600	
原田工業	600	889.00	533,400	
コーセル	1,700	886.00	1,506,200	
イリソ電子工業	1,100	3,580.00	3,938,000	
オプテックスグループ	2,100	1,289.00	2,706,900	
千代田インテグレ	500	1,643.00	821,500	
アイ・オー・データ機器	400	1,086.00	434,400	
レーザーテック	5,600	8,690.00	48,664,000	
スタンレー電気	8,900	2,971.00	26,441,900	
岩崎電気	500	1,485.00	742,500	
ウシオ電機	7,000	1,346.00	9,422,000	
岡谷電機産業	1,000	300.00	300,000	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,200	297.00	356,400	
エノモト	400	1,007.00	402,800	
日本セラミック	1,300	2,294.00	2,982,200	
遠藤照明	600	642.00	385,200	
古河電池	900	1,158.00	1,042,200	
双信電機	600	395.00	237,000	

山一電機	900	1,367.00	1,230,300	
図研	800	2,806.00	2,244,800	
日本電子	2,500	3,325.00	8,312,500	
カシオ計算機	11,200	1,596.00	17,875,200	
ファナック	11,900	19,360.00	230,384,000	
日本シイエムケイ	3,000	431.00	1,293,000	
エンプラス	600	2,234.00	1,340,400	
大真空	500	1,830.00	915,000	
ローム	5,300	7,220.00	38,266,000	
浜松ホトニクス	9,100	4,870.00	44,317,000	
三井ハイテック	1,400	1,670.00	2,338,000	
新光電気工業	4,300	1,728.00	7,430,400	
京セラ	17,800	6,315.00	112,407,000	
太陽誘電	5,600	3,145.00	17,612,000	
村田製作所	37,300	6,739.00	251,364,700	
双葉電子工業	2,000	922.00	1,844,000	
北陸電気工業	500	878.00	439,000	
ニチコン	4,300	751.00	3,229,300	
日本ケミコン	1,000	1,748.00	1,748,000	
ＫＯＡ	1,900	995.00	1,890,500	
市光工業	1,900	482.00	915,800	
小糸製作所	7,600	4,980.00	37,848,000	
ミツバ	2,300	392.00	901,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,200	5,580.00	12,276,000	
キヤノン電子	1,200	1,499.00	1,798,800	
キヤノン	63,000	1,884.00	118,692,000	
リコー	32,300	792.00	25,581,600	
象印マホービン	3,400	1,514.00	5,147,600	
ＭＵＴＯＨホールディングス	200	1,499.00	299,800	
東京エレクトロン	8,000	28,650.00	229,200,000	
トヨタ紡織	3,700	1,375.00	5,087,500	
芦森工業	300	898.00	269,400	
ユニプレス	2,500	877.00	2,192,500	
豊田自動織機	10,300	6,130.00	63,139,000	
モリタホールディングス	2,200	1,908.00	4,197,600	
三櫻工業	1,600	657.00	1,051,200	

デンソー	27,900	4,355.00	121,504,500	
東海理化電機製作所	3,300	1,435.00	4,735,500	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	4,600	466.00	2,143,600	
川崎重工業	9,900	1,510.00	14,949,000	
名村造船所	4,000	155.00	620,000	
サノヤスホールディングス	1,500	157.00	235,500	
日本車輌製造	500	2,505.00	1,252,500	
三菱ロジスネクスト	1,700	999.00	1,698,300	
近畿車輛	200	1,244.00	248,800	
日産自動車	149,600	421.30	63,026,480	
いすゞ自動車	36,800	1,022.50	37,628,000	
トヨタ自動車	141,600	7,156.00	1,013,289,600	
日野自動車	15,800	712.00	11,249,600	
三菱自動車工業	46,900	248.00	11,631,200	
エフテック	900	490.00	441,000	
レシップホールディングス	500	562.00	281,000	
ＧＭＢ	200	630.00	126,000	
ファルテック	200	615.00	123,000	
武蔵精密工業	2,800	891.00	2,494,800	
日産車体	2,500	840.00	2,100,000	
新明和工業	3,400	956.00	3,250,400	
極東開発工業	2,400	1,350.00	3,240,000	
日信工業	1,800	2,234.00	4,021,200	
トピー工業	1,000	1,151.00	1,151,000	
ティラド	500	1,321.00	660,500	
曙ブレーキ工業	6,900	178.00	1,228,200	
タチエス	2,100	885.00	1,858,500	
ＮＯＫ	6,800	1,161.00	7,894,800	
フタバ産業	3,500	502.00	1,757,000	
ＫＹＢ	1,400	2,113.00	2,958,200	
大同メタル工業	2,400	522.00	1,252,800	
プレス工業	6,300	308.00	1,940,400	
ミクニ	1,600	263.00	420,800	
太平洋工業	2,700	882.00	2,381,400	
ケーヒン	2,100	2,581.00	5,420,100	
河西工業	1,700	412.00	700,400	

アイシン精機	10,400	3,640.00	37,856,000	
マツダ	37,300	658.00	24,543,400	
今仙電機製作所	1,200	689.00	826,800	
本田技研工業	99,900	2,741.00	273,825,900	
スズキ	25,100	4,277.00	107,352,700	
ＳＵＢＡＲＵ	39,400	2,236.00	88,098,400	
安永	600	1,001.00	600,600	
ヤマハ発動機	17,900	1,775.00	31,772,500	
ショーワ	2,100	2,282.00	4,792,200	
ＴＢＫ	1,500	434.00	651,000	
エクセディ	1,700	1,399.00	2,378,300	
豊田合成	4,100	2,276.00	9,331,600	
愛三工業	2,000	522.00	1,044,000	
盟和産業	200	890.00	178,000	
日本プラスト	1,000	389.00	389,000	
ヨロズ	1,200	1,007.00	1,208,400	
エフ・シー・シー	2,100	1,825.00	3,832,500	
シマノ	4,700	22,790.00	107,113,000	
テイ・エス　テック	2,900	3,190.00	9,251,000	
ジャムコ	600	712.00	427,200	
テルモ	35,900	4,291.00	154,046,900	
クリエートメディック	400	990.00	396,000	
日機装	4,100	1,050.00	4,305,000	
日本エム・ディ・エム	700	1,994.00	1,395,800	
島津製作所	15,200	3,185.00	48,412,000	
ＪＭＳ	1,100	871.00	958,100	
クボテック	300	344.00	103,200	
長野計器	900	877.00	789,300	
ブイ・テクノロジー	600	3,870.00	2,322,000	
東京計器	800	924.00	739,200	
愛知時計電機	200	4,435.00	887,000	
インターアクション	700	1,800.00	1,260,000	
オーバル	1,100	218.00	239,800	
東京精密	2,300	3,470.00	7,981,000	
マニー	5,100	2,753.00	14,040,300	
ニコン	19,400	835.00	16,199,000	

トプコン	6,400	806.00	5,158,400	
オリンパス	70,200	2,126.00	149,245,200	
理研計器	1,100	2,493.00	2,742,300	
タムロン	1,000	1,760.00	1,760,000	
ＨＯＹＡ	25,200	10,530.00	265,356,000	
シード	500	713.00	356,500	
ノーリツ鋼機	900	1,472.00	1,324,800	
エー・アンド・デイ	1,200	659.00	790,800	
朝日インテック	14,400	3,005.00	43,272,000	
シチズン時計	14,800	319.00	4,721,200	
リズム時計工業	400	615.00	246,000	
大研医器	900	548.00	493,200	
メニコン	1,800	5,940.00	10,692,000	
シンシア	100	395.00	39,500	
松風	600	1,409.00	845,400	
セイコーホールディングス	1,800	1,561.00	2,809,800	
ニプロ	8,800	1,207.00	10,621,600	
中本パックス	300	1,603.00	480,900	
スノーピーク	800	1,369.00	1,095,200	
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,290.00	5,577,000	
トランザクション	700	1,146.00	802,200	
粧美堂	400	355.00	142,000	
ニホンフラッシュ	1,200	1,540.00	1,848,000	
前田工繊	1,400	2,505.00	3,507,000	
永大産業	1,600	299.00	478,400	
アートネイチャー	1,400	611.00	855,400	
バンダイナムコホールディングス	13,100	6,470.00	84,757,000	
アイフィスジャパン	300	718.00	215,400	
共立印刷	2,100	133.00	279,300	
ＳＨＯＥＩ	1,100	3,015.00	3,316,500	
フランスベッドホールディングス	1,800	847.00	1,524,600	
パイロットコーポレーション	2,200	3,305.00	7,271,000	
萩原工業	700	1,454.00	1,017,800	
トッパン・フォームズ	2,700	1,005.00	2,713,500	
フジシールインターナショナル	2,800	1,874.00	5,247,200	
タカラトミー	5,700	890.00	5,073,000	

廣済堂	900	748.00	673,200	
エステールホールディングス	300	645.00	193,500	
タカノ	500	639.00	319,500	
プロネクサス	1,100	1,110.00	1,221,000	
ホクシン	700	116.00	81,200	
ウッドワン	400	1,209.00	483,600	
大建工業	900	1,642.00	1,477,800	
凸版印刷	17,900	1,695.00	30,340,500	
大日本印刷	16,600	2,273.00	37,731,800	
共同印刷	400	2,687.00	1,074,800	
ＮＩＳＳＨＡ	2,600	1,200.00	3,120,000	
光村印刷	100	1,565.00	156,500	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	600	2,251.00	1,350,600	
アシックス	11,200	1,412.00	15,814,400	
ツツミ	400	1,799.00	719,600	
小松ウオール工業	400	1,771.00	708,400	
ヤマハ	7,500	5,100.00	38,250,000	
河合楽器製作所	400	2,807.00	1,122,800	
クリナップ	1,200	519.00	622,800	
ピジョン	8,100	4,655.00	37,705,500	
オリバー	300	2,489.00	746,700	
兼松サステック	100	1,398.00	139,800	
キングジム	1,100	877.00	964,700	
リンテック	3,000	2,503.00	7,509,000	
イトーキ	2,500	353.00	882,500	
任天堂	7,800	51,550.00	402,090,000	
三菱鉛筆	2,100	1,279.00	2,685,900	
タカラスタンダード	2,600	1,400.00	3,640,000	
コクヨ	6,100	1,188.00	7,246,800	
ナカバヤシ	1,200	621.00	745,200	
グローブライド	600	2,423.00	1,453,800	
オカムラ	4,400	735.00	3,234,000	
美津濃	1,200	1,888.00	2,265,600	
東京電力ホールディングス	101,300	315.00	31,909,500	
中部電力	38,800	1,318.00	51,138,400	
関西電力	48,100	1,041.50	50,096,150	

中国電力	18,300	1,324.00	24,229,200	
北陸電力	11,600	724.00	8,398,400	
東北電力	31,700	1,074.00	34,045,800	
四国電力	11,400	777.00	8,857,800	
九州電力	26,100	952.00	24,847,200	
北海道電力	11,900	439.00	5,224,100	
沖縄電力	2,500	1,679.00	4,197,500	
電源開発	10,100	1,602.00	16,180,200	
エフオン	700	678.00	474,600	
イーレックス	1,800	1,335.00	2,403,000	
レノバ	2,100	1,150.00	2,415,000	
東京瓦斯	24,400	2,370.00	57,828,000	
大阪瓦斯	24,600	2,092.00	51,463,200	
東邦瓦斯	6,200	4,790.00	29,698,000	
北海道瓦斯	700	1,595.00	1,116,500	
広島ガス	2,600	363.00	943,800	
西部瓦斯	1,400	2,508.00	3,511,200	
静岡ガス	3,600	884.00	3,182,400	
メタウォーター	600	4,465.00	2,679,000	
ＳＢＳホールディングス	900	2,130.00	1,917,000	
東武鉄道	13,200	3,305.00	43,626,000	
相鉄ホールディングス	4,100	2,836.00	11,627,600	
東急	32,000	1,356.00	43,392,000	
京浜急行電鉄	16,300	1,556.00	25,362,800	
小田急電鉄	18,900	2,517.00	47,571,300	
京王電鉄	6,600	6,090.00	40,194,000	
京成電鉄	8,800	2,997.00	26,373,600	
富士急行	1,700	3,050.00	5,185,000	
新京成電鉄	300	2,212.00	663,600	
東日本旅客鉄道	22,300	6,542.00	145,886,600	
西日本旅客鉄道	11,300	5,120.00	57,856,000	
東海旅客鉄道	10,500	14,745.00	154,822,500	
西武ホールディングス	16,600	1,108.00	18,392,800	
鴻池運輸	2,000	1,085.00	2,170,000	
西日本鉄道	3,500	2,847.00	9,964,500	
ハマキョウレックス	1,000	3,310.00	3,310,000	

サカイ引越センター	700	4,655.00	3,258,500	
近鉄グループホールディングス	12,000	4,525.00	54,300,000	
阪急阪神ホールディングス	16,000	3,370.00	53,920,000	
南海電気鉄道	5,700	2,303.00	13,127,100	
京阪ホールディングス	5,300	4,570.00	24,221,000	
神戸電鉄	300	3,670.00	1,101,000	
名古屋鉄道	9,900	2,914.00	28,848,600	
山陽電気鉄道	900	2,139.00	1,925,100	
日本通運	4,200	5,950.00	24,990,000	
ヤマトホールディングス	21,100	2,757.00	58,172,700	
山九	3,300	4,205.00	13,876,500	
丸運	600	218.00	130,800	
丸全昭和運輸	1,000	3,325.00	3,325,000	
センコーグループホールディングス	6,600	886.00	5,847,600	
トナミホールディングス	300	5,830.00	1,749,000	
ニッコンホールディングス	4,300	2,117.00	9,103,100	
日本石油輸送	100	2,834.00	283,400	
福山通運	1,500	4,705.00	7,057,500	
セイノーホールディングス	9,000	1,550.00	13,950,000	
エスライン	400	924.00	369,600	
神奈川中央交通	300	3,940.00	1,182,000	
日立物流	2,200	3,445.00	7,579,000	
丸和運輸機関	1,300	4,215.00	5,479,500	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1,200	1,871.00	2,245,200	
九州旅客鉄道	10,500	2,303.00	24,181,500	
ＳＧホールディングス	12,600	4,760.00	59,976,000	
日本郵船	10,000	1,632.00	16,320,000	
商船三井	7,600	1,882.00	14,303,200	
川崎汽船	3,700	1,101.00	4,073,700	
ＮＳユナイテッド海運	700	1,438.00	1,006,600	
明治海運	1,300	321.00	417,300	
飯野海運	5,700	353.00	2,012,100	
共栄タンカー	200	771.00	154,200	
乾汽船	700	809.00	566,300	
日本航空	21,200	1,979.00	41,954,800	
ＡＮＡホールディングス	22,000	2,415.00	53,130,000	

パスコ	200	1,351.00	270,200	
トランコム	300	7,430.00	2,229,000	
日新	1,000	1,613.00	1,613,000	
三菱倉庫	3,800	3,040.00	11,552,000	
三井倉庫ホールディングス	1,400	1,669.00	2,336,600	
住友倉庫	4,300	1,321.00	5,680,300	
澁澤倉庫	700	2,003.00	1,402,100	
東陽倉庫	2,200	324.00	712,800	
日本トランスシティ	2,600	515.00	1,339,000	
ケイヒン	200	1,275.00	255,000	
中央倉庫	700	1,010.00	707,000	
川西倉庫	200	1,042.00	208,400	
安田倉庫	1,000	912.00	912,000	
ファイズホールディングス	300	1,069.00	320,700	
東洋埠頭	400	1,430.00	572,000	
宇徳	1,000	476.00	476,000	
上組	6,700	2,132.00	14,284,400	
サンリツ	300	598.00	179,400	
キムラユニティー	300	1,047.00	314,100	
キユーソー流通システム	300	1,463.00	438,900	
近鉄エクスプレス	2,600	2,081.00	5,410,600	
東海運	700	277.00	193,900	
エーアイテイー	800	989.00	791,200	
内外トランスライン	400	1,100.00	440,000	
日本コンセプト	400	1,239.00	495,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	3,500	2,103.00	7,360,500	
クロスキャット	300	1,120.00	336,000	
システナ	4,400	1,765.00	7,766,000	
デジタルアーツ	600	8,480.00	5,088,000	
日鉄ソリューションズ	1,900	3,055.00	5,804,500	
キューブシステム	700	1,074.00	751,800	
エイジア	200	1,815.00	363,000	
コア	500	1,345.00	672,500	
ラクーンホールディングス	600	1,046.00	627,600	
ソリトンシステムズ	600	1,701.00	1,020,600	
ソフトクリエイトホールディングス	500	2,600.00	1,300,000	

ＴＩＳ	12,400	2,207.00	27,366,800	
ネオス	500	600.00	300,000	
電算システム	400	3,790.00	1,516,000	
グリー	7,600	478.00	3,632,800	
コーエーテクモホールディングス	2,500	4,320.00	10,800,000	
三菱総合研究所	500	4,025.00	2,012,500	
ボルテージ	300	586.00	175,800	
電算	100	2,163.00	216,300	
ＡＧＳ	700	828.00	579,600	
ファインデックス	1,000	1,036.00	1,036,000	
ブレインパッド	300	3,900.00	1,170,000	
ＫＬａｂ	2,300	900.00	2,070,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	929.00	1,393,500	
イーブックイニシアティブジャパン	200	3,685.00	737,000	
ネクソン	31,400	2,589.00	81,294,600	
アイスタイル	3,500	315.00	1,102,500	
エムアップホールディングス	400	2,920.00	1,168,000	
エイチーム	900	886.00	797,400	
エニグモ	1,200	1,461.00	1,753,200	
テクノスジャパン	1,000	815.00	815,000	
ｅｎｉｓｈ	600	899.00	539,400	
コロプラ	4,100	991.00	4,063,100	
オルトプラス	800	487.00	389,600	
ブロードリーフ	6,200	526.00	3,261,200	
クロス・マーケティンググループ	500	318.00	159,000	
デジタルハーツホールディングス	700	932.00	652,400	
システム情報	900	1,269.00	1,142,100	
メディアドゥ	400	6,340.00	2,536,000	
じげん	3,100	352.00	1,091,200	
ブイキューブ	700	1,344.00	940,800	
エンカレッジ・テクノロジ	300	743.00	222,900	
サイバーリンクス	200	1,944.00	388,800	
ディー・エル・イー	1,000	549.00	549,000	
フィックスターズ	1,300	1,079.00	1,402,700	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	500	1,258.00	629,000	

オプティム	700	3,385.00	2,369,500	
セレス	400	1,253.00	501,200	
ＳＨＩＦＴ	500	11,670.00	5,835,000	
ティーガイア	1,100	2,130.00	2,343,000	
セック	200	2,987.00	597,400	
日本アジアグループ	1,300	298.00	387,400	
テクマトリックス	1,800	2,112.00	3,801,600	
プロシップ	400	1,420.00	568,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,000	2,116.00	6,348,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,600	11,430.00	29,718,000	
ザッパラス	500	400.00	200,000	
システムリサーチ	300	1,820.00	546,000	
インターネットイニシアティブ	1,800	4,245.00	7,641,000	
さくらインターネット	1,300	566.00	735,800	
ヴィンクス	300	1,168.00	350,400	
GMOクラウド	300	7,910.00	2,373,000	
ＳＲＡホールディングス	700	2,450.00	1,715,000	
システムインテグレータ	400	808.00	323,200	
朝日ネット	900	975.00	877,500	
ｅＢＡＳＥ	1,500	1,295.00	1,942,500	
アバント	1,200	1,094.00	1,312,800	
アドソル日進	400	2,683.00	1,073,200	
フリービット	600	759.00	455,400	
コムチュア	1,400	2,372.00	3,320,800	
サイバーコム	200	1,822.00	364,400	
アステリア	800	614.00	491,200	
アイル	700	1,562.00	1,093,400	
マークラインズ	500	2,004.00	1,002,000	
メディカル・データ・ビジョン	1,400	1,556.00	2,178,400	
ｇｕｍｉ	1,600	982.00	1,571,200	
ショーケース	300	620.00	186,000	
モバイルファクトリー	300	1,156.00	346,800	
テラスカイ	400	4,200.00	1,680,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,280.00	640,000	
ＰＣＩホールディングス	500	1,052.00	526,000	

パイプドＨＤ	200	1,447.00	289,400	
アイビーシー	200	991.00	198,200	
ネオジャパン	200	2,504.00	500,800	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	200	2,120.00	424,000	
ランドコンピュータ	200	1,035.00	207,000	
ダブルスタンダード	200	4,870.00	974,000	
オープンドア	600	1,154.00	692,400	
マイネット	400	1,690.00	676,000	
アカツキ	400	4,085.00	1,634,000	
ベネフィットジャパン	100	1,934.00	193,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	300	1,978.00	593,400	
ＬＩＮＥ	3,200	5,390.00	17,248,000	
カナミックネットワーク	1,100	780.00	858,000	
ノムラシステムコーポレーション	500	430.00	215,000	
チェンジ	400	11,630.00	4,652,000	
シンクロ・フード	500	322.00	161,000	
オークネット	700	1,127.00	788,900	
セグエグループ	300	890.00	267,000	
エイトレッド	200	2,005.00	401,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,300	401.00	521,300	
マクロミル	2,500	787.00	1,967,500	
ビーグリー	200	1,825.00	365,000	
オロ	400	3,110.00	1,244,000	
ユーザーローカル	100	3,710.00	371,000	
テモナ	300	995.00	298,500	
ニーズウェル	200	726.00	145,200	
サインポスト	300	1,361.00	408,300	
ソルクシーズ	500	770.00	385,000	
フェイス	400	926.00	370,400	
プロトコーポレーション	1,100	1,218.00	1,339,800	
ハイマックス	100	2,016.00	201,600	
野村総合研究所	17,600	2,841.00	50,001,600	
サイバネットシステム	900	788.00	709,200	
ＣＥホールディングス	700	500.00	350,000	
日本システム技術	200	1,508.00	301,600	
インテージホールディングス	1,600	917.00	1,467,200	

東邦システムサイエンス	300	974.00	292,200	
ソースネクスト	5,900	266.00	1,569,400	
インフォコム	1,400	3,385.00	4,739,000	
ＨＥＲＯＺ	200	3,670.00	734,000	
ラクスル	1,000	3,145.00	3,145,000	
ＦＩＧ	1,300	236.00	306,800	
システムサポート	300	1,840.00	552,000	
イーソル	700	1,078.00	754,600	
アルテリア・ネットワークス	1,400	1,862.00	2,606,800	
東海ソフト	100	1,236.00	123,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	1,099.00	219,800	
トビラシステムズ	100	1,913.00	191,300	
フォーカスシステムズ	800	791.00	632,800	
クレスコ	800	1,296.00	1,036,800	
フジ・メディア・ホールディングス	12,000	1,047.00	12,564,000	
オービック	4,300	18,420.00	79,206,000	
ジャストシステム	2,000	7,610.00	15,220,000	
ＴＤＣソフト	1,100	972.00	1,069,200	
Ｚホールディングス	171,000	654.00	111,834,000	
トレンドマイクロ	6,600	6,450.00	42,570,000	
ＩＤホールディングス	500	1,436.00	718,000	
日本オラクル	2,500	12,350.00	30,875,000	
アルファシステムズ	400	3,690.00	1,476,000	
フューチャー	1,500	1,776.00	2,664,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	800	1,311.00	1,048,800	
ＳＢテクノロジー	400	3,270.00	1,308,000	
トーセ	300	925.00	277,500	
オービックビジネスコンサルタント	1,300	6,550.00	8,515,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,700	4,005.00	22,828,500	
アイティフォー	1,500	806.00	1,209,000	
東計電算	200	4,240.00	848,000	
エックスネット	200	966.00	193,200	
大塚商会	6,700	5,410.00	36,247,000	
サイボウズ	1,500	3,000.00	4,500,000	
ソフトブレーン	1,000	484.00	484,000	

電通国際情報サービス	800	5,710.00	4,568,000	
ＡＣＣＥＳＳ	1,200	799.00	958,800	
デジタルガレージ	2,200	3,515.00	7,733,000	
ＥＭシステムズ	1,800	860.00	1,548,000	
ウェザーニューズ	400	4,025.00	1,610,000	
ＣＩＪ	800	833.00	666,400	
ビジネスエンジニアリング	100	2,893.00	289,300	
日本エンタープライズ	1,200	300.00	360,000	
WOWOW	600	2,596.00	1,557,600	
スカラ	800	744.00	595,200	
インテリジェント　ウェイブ	700	811.00	567,700	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,100	379.00	416,900	
ネットワンシステムズ	4,700	4,260.00	20,022,000	
システムソフト	2,500	94.00	235,000	
アルゴグラフィックス	1,100	3,400.00	3,740,000	
マーベラス	1,900	785.00	1,491,500	
エイベックス	2,100	903.00	1,896,300	
日本ユニシス	3,900	3,085.00	12,031,500	
兼松エレクトロニクス	700	4,115.00	2,880,500	
都築電気	400	1,608.00	643,200	
東京放送ホールディングス	7,600	1,753.00	13,322,800	
日本テレビホールディングス	10,400	1,247.00	12,968,800	
朝日放送グループホールディングス	1,200	736.00	883,200	
テレビ朝日ホールディングス	3,400	1,638.00	5,569,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	8,200	395.00	3,239,000	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,309.00	2,309,000	
日本ＢＳ放送	400	1,122.00	448,800	
ビジョン	1,500	736.00	1,104,000	
スマートバリュー	300	945.00	283,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	500	1,244.00	622,000	
ワイヤレスゲート	500	746.00	373,000	
コネクシオ	700	1,278.00	894,600	
日本通信	9,700	201.00	1,949,700	
クロップス	200	786.00	157,200	
日本電信電話	166,400	2,609.50	434,220,800	
ＫＤＤＩ	90,800	3,346.00	303,816,800	

ソフトバンク	113,100	1,486.50	168,123,150	
光通信	1,300	24,600.00	31,980,000	
ＮＴＴドコモ	89,000	3,101.00	275,989,000	
エムティーアイ	1,200	713.00	855,600	
GMOインターネット	4,500	3,000.00	13,500,000	
ファイバーゲート	400	2,035.00	814,000	
アイドママーケティングコミュニケーション	400	430.00	172,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	3,400	2,595.00	8,823,000	
学研ホールディングス	1,700	1,507.00	2,561,900	
ゼンリン	2,500	1,156.00	2,890,000	
昭文社ホールディングス	600	457.00	274,200	
インプレスホールディングス	1,000	155.00	155,000	
アイネット	600	1,486.00	891,600	
松竹	800	13,810.00	11,048,000	
東宝	7,300	3,655.00	26,681,500	
東映	500	15,740.00	7,870,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	33,100	1,253.00	41,474,300	
ピー・シー・エー	200	5,010.00	1,002,000	
ビジネスブレイン太田昭和	400	1,303.00	521,200	
ＤＴＳ	2,800	2,167.00	6,067,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,300	6,750.00	35,775,000	
シーイーシー	1,300	1,647.00	2,141,100	
カプコン	5,900	5,050.00	29,795,000	
アイ・エス・ビー	300	2,707.00	812,100	
ジャステック	800	1,280.00	1,024,000	
ＳＣＳＫ	2,900	5,780.00	16,762,000	
日本システムウエア	400	1,948.00	779,200	
アイネス	1,200	1,442.00	1,730,400	
ＴＫＣ	1,100	6,080.00	6,688,000	
富士ソフト	1,300	5,080.00	6,604,000	
ＮＳＤ	4,000	1,970.00	7,880,000	
コナミホールディングス	4,500	3,935.00	17,707,500	
福井コンピュータホールディングス	500	2,724.00	1,362,000	
ＪＢＣＣホールディングス	800	1,620.00	1,296,000	
ミロク情報サービス	1,100	2,166.00	2,382,600	
ソフトバンクグループ	98,800	6,237.00	616,215,600	

ホウスイ	100	879.00	87,900	
高千穂交易	500	919.00	459,500	
カワニシホールディングス	100	1,360.00	136,000	
伊藤忠食品	300	5,220.00	1,566,000	
エレマテック	1,200	901.00	1,081,200	
ＪＡＬＵＸ	400	1,633.00	653,200	
あらた	1,000	4,980.00	4,980,000	
トーメンデバイス	200	3,760.00	752,000	
東京エレクトロン　デバイス	500	3,195.00	1,597,500	
フィールズ	900	341.00	306,900	
双日	69,000	237.00	16,353,000	
アルフレッサ　ホールディングス	13,900	2,124.00	29,523,600	
横浜冷凍	3,300	886.00	2,923,800	
神栄	200	487.00	97,400	
ラサ商事	700	934.00	653,800	
アルコニックス	1,300	1,405.00	1,826,500	
神戸物産	4,300	6,630.00	28,509,000	
ハイパー	200	504.00	100,800	
あい　ホールディングス	1,800	1,496.00	2,692,800	
ディーブイエックス	400	904.00	361,600	
ダイワボウホールディングス	1,100	6,400.00	7,040,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,000	1,694.00	5,082,000	
ラクト・ジャパン	500	3,315.00	1,657,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,400	1,054.00	2,529,600	
八洲電機	1,000	942.00	942,000	
メディアスホールディングス	700	816.00	571,200	
レスターホールディングス	1,300	1,929.00	2,507,700	
ジューテックホールディングス	300	983.00	294,900	
大光	500	677.00	338,500	
ＯＣＨＩホールディングス	400	1,521.00	608,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	6,600	1,001.00	6,606,600	
黒谷	300	541.00	162,300	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	200	698.00	139,600	
三洋貿易	1,300	977.00	1,270,100	
ビューティガレージ	200	1,981.00	396,200	
ウイン・パートナーズ	900	943.00	848,700	

ミタチ産業	400	533.00	213,200	
シップヘルスケアホールディングス	2,000	4,670.00	9,340,000	
明治電機工業	400	1,404.00	561,600	
デリカフーズホールディングス	400	629.00	251,600	
スターティアホールディングス	300	570.00	171,000	
コメダホールディングス	2,700	1,748.00	4,719,600	
ピーバンドットコム	100	929.00	92,900	
アセンテック	300	2,014.00	604,200	
富士興産	400	506.00	202,400	
協栄産業	100	1,353.00	135,300	
小野建	1,100	1,130.00	1,243,000	
南陽	300	1,528.00	458,400	
佐鳥電機	800	845.00	676,000	
エコートレーディング	300	535.00	160,500	
伯東	800	1,072.00	857,600	
コンドーテック	1,000	1,174.00	1,174,000	
中山福	700	468.00	327,600	
ナガイレーベン	1,700	2,722.00	4,627,400	
三菱食品	1,400	2,687.00	3,761,800	
松田産業	900	1,586.00	1,427,400	
第一興商	1,900	3,200.00	6,080,000	
メディパルホールディングス	13,500	2,032.00	27,432,000	
ＳＰＫ	500	1,425.00	712,500	
萩原電気ホールディングス	500	1,910.00	955,000	
アズワン	800	12,520.00	10,016,000	
スズデン	400	1,148.00	459,200	
尾家産業	400	1,530.00	612,000	
シモジマ	800	1,245.00	996,000	
ドウシシャ	1,200	1,901.00	2,281,200	
小津産業	300	1,763.00	528,900	
高速	700	1,374.00	961,800	
たけびし	400	1,466.00	586,400	
リックス	300	1,414.00	424,200	
丸文	1,100	487.00	535,700	
ハピネット	1,000	1,271.00	1,271,000	
橋本総業ホールディングス	300	2,076.00	622,800	

日本ライフライン	3,700	1,422.00	5,261,400	
タカショー	800	525.00	420,000	
マルカ	400	1,987.00	794,800	
ＩＤＯＭ	3,400	512.00	1,740,800	
進和	700	2,051.00	1,435,700	
エスケイジャパン	200	294.00	58,800	
ダイトロン	500	1,474.00	737,000	
シークス	1,600	882.00	1,411,200	
田中商事	400	705.00	282,000	
オーハシテクニカ	600	1,499.00	899,400	
白銅	400	1,249.00	499,600	
ダイコー通産	100	1,229.00	122,900	
伊藤忠商事	87,400	2,570.00	224,618,000	
丸紅	130,100	578.70	75,288,870	
高島	200	1,810.00	362,000	
長瀬産業	7,000	1,320.00	9,240,000	
蝶理	800	1,593.00	1,274,400	
豊田通商	13,900	3,055.00	42,464,500	
三共生興	1,900	424.00	805,600	
兼松	4,700	1,290.00	6,063,000	
ツカモトコーポレーション	200	1,170.00	234,000	
三井物産	108,200	1,772.50	191,784,500	
日本紙パルプ商事	700	3,850.00	2,695,000	
カメイ	1,600	1,013.00	1,620,800	
東都水産	200	3,035.00	607,000	
ＯＵＧホールディングス	200	2,720.00	544,000	
スターゼン	500	4,000.00	2,000,000	
山善	4,900	991.00	4,855,900	
椿本興業	200	3,140.00	628,000	
住友商事	78,800	1,258.50	99,169,800	
内田洋行	500	6,240.00	3,120,000	
三菱商事	81,900	2,311.50	189,311,850	
第一実業	600	3,630.00	2,178,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,100	2,042.00	6,330,200	
西華産業	700	1,283.00	898,100	
佐藤商事	1,000	890.00	890,000	

菱洋エレクトロ	1,300	3,000.00	3,900,000	
東京産業	1,100	516.00	567,600	
ユアサ商事	1,200	3,000.00	3,600,000	
神鋼商事	300	1,815.00	544,500	
トルク	700	299.00	209,300	
阪和興業	2,300	2,065.00	4,749,500	
正栄食品工業	800	3,880.00	3,104,000	
カナデン	1,000	1,367.00	1,367,000	
菱電商事	900	1,441.00	1,296,900	
フルサト工業	700	1,329.00	930,300	
岩谷産業	2,800	3,765.00	10,542,000	
ナイス	500	1,167.00	583,500	
昭光通商	400	578.00	231,200	
ニチモウ	200	1,901.00	380,200	
極東貿易	400	1,320.00	528,000	
イワキ	1,600	481.00	769,600	
三愛石油	3,100	920.00	2,852,000	
稲畑産業	2,800	1,282.00	3,589,600	
ＧＳＩクレオス	300	1,744.00	523,200	
明和産業	1,200	458.00	549,600	
クワザワ	400	535.00	214,000	
ヤマエ久野	900	1,236.00	1,112,400	
ワキタ	2,700	932.00	2,516,400	
東邦ホールディングス	4,000	1,982.00	7,928,000	
サンゲツ	3,400	1,569.00	5,334,600	
ミツウロコグループホールディングス	1,800	1,143.00	2,057,400	
シナネンホールディングス	500	2,931.00	1,465,500	
伊藤忠エネクス	2,800	947.00	2,651,600	
サンリオ	3,500	1,736.00	6,076,000	
サンワテクノス	900	827.00	744,300	
リョーサン	1,400	2,035.00	2,849,000	
新光商事	2,000	821.00	1,642,000	
トーホー	600	1,868.00	1,120,800	
三信電気	700	1,814.00	1,269,800	
東陽テクニカ	1,300	973.00	1,264,900	
モスフードサービス	1,600	2,828.00	4,524,800	

加賀電子	1,200	2,188.00	2,625,600	
ソーダニッカ	1,300	526.00	683,800	
立花エレテック	900	1,686.00	1,517,400	
フォーバル	500	1,102.00	551,000	
ＰＡＬＴＡＣ	2,000	5,900.00	11,800,000	
三谷産業	1,600	335.00	536,000	
太平洋興発	500	627.00	313,500	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	300	1,977.00	593,100	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,529.00	152,900	
コーア商事ホールディングス	100	2,007.00	200,700	
国際紙パルプ商事	2,900	278.00	806,200	
ヤマタネ	600	1,275.00	765,000	
丸紅建材リース	100	1,699.00	169,900	
日鉄物産	900	3,205.00	2,884,500	
泉州電業	400	3,065.00	1,226,000	
トラスコ中山	2,900	2,588.00	7,505,200	
オートバックスセブン	4,600	1,395.00	6,417,000	
モリト	900	592.00	532,800	
加藤産業	1,800	3,710.00	6,678,000	
北恵	300	988.00	296,400	
イノテック	600	1,051.00	630,600	
イエローハット	2,400	1,624.00	3,897,600	
ＪＫホールディングス	1,100	768.00	844,800	
日伝	1,100	2,145.00	2,359,500	
北沢産業	900	258.00	232,200	
杉本商事	700	1,927.00	1,348,900	
因幡電機産業	3,600	2,611.00	9,399,600	
東テク	400	2,335.00	934,000	
ミスミグループ本社	15,700	2,741.00	43,033,700	
アルテック	900	237.00	213,300	
タキヒヨー	400	1,832.00	732,800	
蔵王産業	200	1,404.00	280,800	
スズケン	5,300	3,930.00	20,829,000	
ジェコス	900	911.00	819,900	
グローセル	1,200	409.00	490,800	
ローソン	3,200	5,350.00	17,120,000	

サンエー	1,000	4,150.00	4,150,000	
カワチ薬品	1,000	3,080.00	3,080,000	
エービーシー・マート	2,000	5,620.00	11,240,000	
ハードオフコーポレーション	500	670.00	335,000	
アスクル	1,300	3,145.00	4,088,500	
ゲオホールディングス	2,200	1,571.00	3,456,200	
アダストリア	1,700	1,627.00	2,765,900	
ジーフット	800	521.00	416,800	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	200	433.00	86,600	
くら寿司	700	4,745.00	3,321,500	
キャンドゥ	600	2,235.00	1,341,000	
パルグループホールディングス	1,300	1,164.00	1,513,200	
エディオン	5,700	1,144.00	6,520,800	
サーラコーポレーション	2,500	592.00	1,480,000	
ワッツ	500	1,019.00	509,500	
ハローズ	500	3,740.00	1,870,000	
フジオフードグループ本社	1,100	1,245.00	1,369,500	
あみやき亭	300	2,745.00	823,500	
ひらまつ	2,200	173.00	380,600	
大黒天物産	300	5,850.00	1,755,000	
ハニーズホールディングス	1,100	1,052.00	1,157,200	
ファーマライズホールディングス	300	706.00	211,800	
アルペン	1,000	1,752.00	1,752,000	
ハブ	400	591.00	236,400	
クオールホールディングス	1,800	1,082.00	1,947,600	
ジンズホールディングス	700	7,060.00	4,942,000	
ビックカメラ	7,400	1,129.00	8,354,600	
ＤＣＭホールディングス	7,100	1,294.00	9,187,400	
ペッパーフードサービス	1,100	445.00	489,500	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	8,900	4,265.00	37,958,500	
東京一番フーズ	300	512.00	153,600	
ＤＤホールディングス	500	798.00	399,000	
きちりホールディングス	300	556.00	166,800	
アークランドサービスホールディングス	1,000	1,948.00	1,948,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	14,900	730.00	10,877,000	
ドトール・日レスホールディングス	1,800	1,553.00	2,795,400	

マツモトキヨシホールディングス	5,200	3,675.00	19,110,000	
ブロンコビリー	700	2,144.00	1,500,800	
ＺＯＺＯ	8,600	2,878.00	24,750,800	
トレジャー・ファクトリー	400	763.00	305,200	
物語コーポレーション	300	7,880.00	2,364,000	
ココカラファイン	1,300	5,790.00	7,527,000	
三越伊勢丹ホールディングス	21,800	555.00	12,099,000	
Ｈａｍｅｅ	400	2,095.00	838,000	
ウエルシアホールディングス	3,700	9,430.00	34,891,000	
クリエイトＳＤホールディングス	2,100	3,880.00	8,148,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	1,500	376.00	564,000	
ミサワ	300	712.00	213,600	
ティーライフ	200	1,145.00	229,000	
エー・ピーカンパニー	200	423.00	84,600	
チムニー	400	1,248.00	499,200	
シュッピン	800	748.00	598,400	
オイシックス・ラ・大地	1,200	3,065.00	3,678,000	
ネクステージ	2,100	1,026.00	2,154,600	
ジョイフル本田	3,700	1,468.00	5,431,600	
鳥貴族	400	1,390.00	556,000	
キリン堂ホールディングス	500	2,892.00	1,446,000	
ホットランド	900	1,107.00	996,300	
すかいらーくホールディングス	14,000	1,550.00	21,700,000	
ＳＦＰホールディングス	700	1,366.00	956,200	
綿半ホールディングス	500	2,370.00	1,185,000	
ヨシックス	200	1,671.00	334,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,600	1,287.00	4,633,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	494.00	296,400	
ＢＥＥＮＯＳ	600	1,405.00	843,000	
あさひ	900	1,822.00	1,639,800	
日本調剤	800	1,608.00	1,286,400	
コスモス薬品	1,100	18,660.00	20,526,000	
トーエル	600	740.00	444,000	
オンリー	200	527.00	105,400	
セブン＆アイ・ホールディングス	48,900	3,444.00	168,411,600	

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,700	641.00	4,294,700	
ツルハホールディングス	2,700	14,490.00	39,123,000	
サンマルクホールディングス	1,000	1,556.00	1,556,000	
フェリシモ	300	1,054.00	316,200	
トリドールホールディングス	3,100	1,220.00	3,782,000	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,100	311.00	342,100	
ウイルプラスホールディングス	200	624.00	124,800	
ＪＭホールディングス	900	3,665.00	3,298,500	
サツドラホールディングス	200	1,964.00	392,800	
アレンザホールディングス	600	1,333.00	799,800	
串カツ田中ホールディングス	300	1,404.00	421,200	
バロックジャパンリミテッド	900	630.00	567,000	
クスリのアオキホールディングス	1,100	9,430.00	10,373,000	
力の源ホールディングス	600	638.00	382,800	
スシローグローバルホールディングス	6,900	2,441.00	16,842,900	
ＬＩＸＩＬビバ	900	2,596.00	2,336,400	
メディカルシステムネットワーク	1,200	477.00	572,400	
はるやまホールディングス	600	717.00	430,200	
ノジマ	2,200	2,968.00	6,529,600	
カッパ・クリエイト	1,800	1,405.00	2,529,000	
ライトオン	900	576.00	518,400	
ジーンズメイト	300	213.00	63,900	
良品計画	16,600	1,566.00	25,995,600	
三城ホールディングス	1,300	261.00	339,300	
アドヴァン	1,900	1,276.00	2,424,400	
アルビス	500	2,439.00	1,219,500	
コナカ	1,500	277.00	415,500	
ハウス　オブ　ローゼ	200	1,577.00	315,400	
Ｇ－７ホールディングス	700	2,864.00	2,004,800	
イオン北海道	1,600	787.00	1,259,200	
コジマ	2,100	552.00	1,159,200	
ヒマラヤ	400	825.00	330,000	
コーナン商事	1,800	4,045.00	7,281,000	
エコス	500	2,239.00	1,119,500	
ワタミ	1,500	894.00	1,341,000	

マルシェ	300	532.00	159,600	
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	27,500	2,465.00	67,787,500	
西松屋チェーン	2,700	1,174.00	3,169,800	
ゼンショーホールディングス	6,000	2,192.00	13,152,000	
幸楽苑ホールディングス	800	1,621.00	1,296,800	
ハークスレイ	300	960.00	288,000	
サイゼリヤ	1,900	1,864.00	3,541,600	
ＶＴホールディングス	5,200	339.00	1,762,800	
魚力	300	1,612.00	483,600	
ポプラ	300	403.00	120,900	
フジ・コーポレーション	300	2,038.00	611,400	
ユナイテッドアローズ	1,300	1,497.00	1,946,100	
ハイデイ日高	1,800	1,679.00	3,022,200	
京都きもの友禅	800	237.00	189,600	
コロワイド	4,200	1,392.00	5,846,400	
ピーシーデポコーポレーション	1,700	656.00	1,115,200	
壱番屋	900	5,100.00	4,590,000	
トップカルチャー	400	376.00	150,400	
ＰＬＡＮＴ	300	813.00	243,900	
スギホールディングス	2,500	7,590.00	18,975,000	
薬王堂ホールディングス	500	2,556.00	1,278,000	
ヴィア・ホールディングス	1,500	299.00	448,500	
スクロール	1,900	739.00	1,404,100	
ヨンドシーホールディングス	1,300	1,792.00	2,329,600	
ファミリーマート	8,600	2,301.00	19,788,600	
木曽路	1,600	2,285.00	3,656,000	
ＳＲＳホールディングス	1,500	878.00	1,317,000	
千趣会	2,200	339.00	745,800	
タカキュー	1,000	130.00	130,000	
リテールパートナーズ	1,700	1,997.00	3,394,900	
ケーヨー	2,600	889.00	2,311,400	
上新電機	1,500	2,258.00	3,387,000	
日本瓦斯	2,000	4,610.00	9,220,000	
ロイヤルホールディングス	2,200	1,673.00	3,680,600	
東天紅	100	980.00	98,000	

いなげや	1,500	1,835.00	2,752,500	
島忠	2,300	3,030.00	6,969,000	
チヨダ	1,300	1,025.00	1,332,500	
ライフコーポレーション	900	5,010.00	4,509,000	
リンガーハット	1,500	2,432.00	3,648,000	
ＭｒＭａｘＨＤ	1,700	800.00	1,360,000	
テンアライド	1,100	369.00	405,900	
ＡＯＫＩホールディングス	2,500	575.00	1,437,500	
オークワ	2,000	1,481.00	2,962,000	
コメリ	1,900	3,215.00	6,108,500	
青山商事	2,600	655.00	1,703,000	
しまむら	1,500	7,950.00	11,925,000	
はせがわ	600	303.00	181,800	
高島屋	9,100	830.00	7,553,000	
松屋	2,500	658.00	1,645,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	5,900	724.00	4,271,600	
近鉄百貨店	500	2,840.00	1,420,000	
丸井グループ	11,500	1,810.00	20,815,000	
アクシアル　リテイリング	1,000	4,750.00	4,750,000	
井筒屋	600	168.00	100,800	
イオン	48,100	2,693.00	129,533,300	
イズミ	2,500	4,380.00	10,950,000	
平和堂	2,500	2,142.00	5,355,000	
フジ	1,500	1,914.00	2,871,000	
ヤオコー	1,400	8,380.00	11,732,000	
ゼビオホールディングス	1,500	749.00	1,123,500	
ケーズホールディングス	12,100	1,433.00	17,339,300	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	600	995.00	597,000	
日産東京販売ホールディングス	1,800	252.00	453,600	
シルバーライフ	200	1,980.00	396,000	
一家ダイニングプロジェクト	100	531.00	53,100	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	500	3,460.00	1,730,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	593.00	177,900	
ブックオフグループホールディングス	700	807.00	564,900	
アインホールディングス	1,500	6,600.00	9,900,000	
元気寿司	300	2,126.00	637,800	

ヤマダ電機	38,100	543.00	20,688,300	
アークランドサカモト	2,000	2,132.00	4,264,000	
ニトリホールディングス	5,400	22,290.00	120,366,000	
グルメ杵屋	900	941.00	846,900	
愛眼	1,000	222.00	222,000	
ケーユーホールディングス	700	814.00	569,800	
吉野家ホールディングス	4,100	2,060.00	8,446,000	
松屋フーズホールディングス	600	3,510.00	2,106,000	
サガミホールディングス	1,700	1,227.00	2,085,900	
関西スーパーマーケット	1,000	1,214.00	1,214,000	
王将フードサービス	900	5,790.00	5,211,000	
プレナス	1,400	1,739.00	2,434,600	
ミニストップ	900	1,525.00	1,372,500	
アークス	2,600	2,555.00	6,643,000	
バローホールディングス	2,800	2,536.00	7,100,800	
藤久	100	1,740.00	174,000	
ベルク	600	7,560.00	4,536,000	
大庄	700	1,195.00	836,500	
ファーストリテイリング	1,700	61,020.00	103,734,000	
サンドラッグ	4,700	3,985.00	18,729,500	
サックスバー　ホールディングス	1,100	548.00	602,800	
ヤマザワ	300	1,744.00	523,200	
やまや	300	2,060.00	618,000	
ベルーナ	2,700	920.00	2,484,000	
島根銀行	300	577.00	173,100	
じもとホールディングス	8,400	106.00	890,400	
めぶきフィナンシャルグループ	65,000	262.00	17,030,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,700	1,145.00	1,946,500	
九州フィナンシャルグループ	27,400	481.00	13,179,400	
ゆうちょ銀行	35,400	848.00	30,019,200	
富山第一銀行	3,000	267.00	801,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	71,500	354.00	25,311,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,300	754.00	6,258,200	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,300	445.00	3,248,500	
三十三フィナンシャルグループ	1,200	1,353.00	1,623,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,200	2,066.00	4,545,200	

新生銀行	9,200	1,208.00	11,113,600	
あおぞら銀行	7,500	1,896.00	14,220,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	855,900	432.20	369,919,980	
りそなホールディングス	135,700	382.90	51,959,530	
三井住友トラスト・ホールディングス	23,700	2,998.50	71,064,450	
三井住友フィナンシャルグループ	86,500	3,068.00	265,382,000	
千葉銀行	41,800	541.00	22,613,800	
群馬銀行	24,000	365.00	8,760,000	
武蔵野銀行	1,900	1,605.00	3,049,500	
千葉興業銀行	3,400	234.00	795,600	
筑波銀行	5,100	172.00	877,200	
七十七銀行	4,200	1,597.00	6,707,400	
青森銀行	1,000	2,231.00	2,231,000	
秋田銀行	800	1,497.00	1,197,600	
山形銀行	1,400	1,381.00	1,933,400	
岩手銀行	800	2,580.00	2,064,000	
東邦銀行	11,200	228.00	2,553,600	
東北銀行	600	994.00	596,400	
みちのく銀行	800	1,086.00	868,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,500	1,733.00	18,196,500	
静岡銀行	30,500	742.00	22,631,000	
十六銀行	1,600	2,015.00	3,224,000	
スルガ銀行	12,800	379.00	4,851,200	
八十二銀行	30,200	415.00	12,533,000	
山梨中央銀行	1,500	871.00	1,306,500	
大垣共立銀行	2,500	2,278.00	5,695,000	
福井銀行	1,100	1,792.00	1,971,200	
北國銀行	1,200	3,135.00	3,762,000	
清水銀行	500	1,652.00	826,000	
富山銀行	200	2,331.00	466,200	
滋賀銀行	2,500	2,546.00	6,365,000	
南都銀行	2,100	2,002.00	4,204,200	
百五銀行	11,200	327.00	3,662,400	
京都銀行	4,500	4,350.00	19,575,000	
紀陽銀行	4,400	1,591.00	7,000,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,300	992.00	8,233,600	

広島銀行	18,500	535.00	9,897,500	
山陰合同銀行	7,400	550.00	4,070,000	
中国銀行	10,800	1,018.00	10,994,400	
鳥取銀行	400	1,112.00	444,800	
伊予銀行	17,900	682.00	12,207,800	
百十四銀行	1,300	1,820.00	2,366,000	
四国銀行	1,900	792.00	1,504,800	
阿波銀行	2,000	2,512.00	5,024,000	
大分銀行	700	2,562.00	1,793,400	
宮崎銀行	800	2,484.00	1,987,200	
佐賀銀行	800	1,264.00	1,011,200	
沖縄銀行	1,100	3,005.00	3,305,500	
琉球銀行	2,900	894.00	2,592,600	
セブン銀行	41,800	267.00	11,160,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,700,300	142.80	242,802,840	
高知銀行	500	687.00	343,500	
山口フィナンシャルグループ	15,600	729.00	11,372,400	
長野銀行	400	1,064.00	425,600	
名古屋銀行	900	2,508.00	2,257,200	
北洋銀行	18,800	239.00	4,493,200	
愛知銀行	500	2,909.00	1,454,500	
中京銀行	500	2,012.00	1,006,000	
大光銀行	400	1,255.00	502,000	
愛媛銀行	1,700	1,163.00	1,977,100	
トマト銀行	500	1,015.00	507,500	
京葉銀行	5,300	501.00	2,655,300	
栃木銀行	6,000	165.00	990,000	
北日本銀行	400	1,742.00	696,800	
東和銀行	2,200	690.00	1,518,000	
福島銀行	1,100	156.00	171,600	
大東銀行	700	618.00	432,600	
トモニホールディングス	9,700	353.00	3,424,100	
フィデアホールディングス	12,000	103.00	1,236,000	
池田泉州ホールディングス	14,400	168.00	2,419,200	
ＦＰＧ	3,900	519.00	2,024,100	
マーキュリアインベストメント	500	589.00	294,500	

ＳＢＩホールディングス	14,000	2,344.00	32,816,000	
日本アジア投資	1,000	217.00	217,000	
ジャフコ	1,900	4,090.00	7,771,000	
大和証券グループ本社	100,400	483.60	48,553,440	
野村ホールディングス	220,200	535.40	117,895,080	
岡三証券グループ	10,700	322.00	3,445,400	
丸三証券	3,700	416.00	1,539,200	
東洋証券	4,400	107.00	470,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,300	245.00	3,503,500	
光世証券	300	572.00	171,600	
水戸証券	3,600	200.00	720,000	
いちよし証券	2,300	438.00	1,007,400	
松井証券	7,100	921.00	6,539,100	
マネックスグループ	9,100	257.00	2,338,700	
極東証券	1,700	578.00	982,600	
岩井コスモホールディングス	1,200	1,246.00	1,495,200	
藍澤證券	2,200	704.00	1,548,800	
マネーパートナーズグループ	1,300	203.00	263,900	
スパークス・グループ	5,700	201.00	1,145,700	
小林洋行	300	255.00	76,500	
かんぽ生命保険	4,400	1,584.00	6,969,600	
ＳＯＭＰＯホールディングス	23,500	3,865.00	90,827,500	
アニコム　ホールディングス	1,000	4,580.00	4,580,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	32,700	2,893.00	94,601,100	
第一生命ホールディングス	70,800	1,508.50	106,801,800	
東京海上ホールディングス	44,200	4,804.00	212,336,800	
Ｔ＆Ｄホールディングス	37,400	1,055.00	39,457,000	
アドバンスクリエイト	300	1,991.00	597,300	
全国保証	3,500	3,850.00	13,475,000	
ジェイリース	300	437.00	131,100	
イントラスト	400	886.00	354,400	
日本モーゲージサービス	300	2,440.00	732,000	
Ｃａｓａ	400	1,083.00	433,200	
アルヒ	2,000	1,627.00	3,254,000	
プレミアグループ	700	1,939.00	1,357,300	

クレディセゾン	8,800	1,142.00	10,049,600	
芙蓉総合リース	1,300	6,280.00	8,164,000	
みずほリース	1,900	2,566.00	4,875,400	
東京センチュリー	2,500	6,020.00	15,050,000	
日本証券金融	5,500	509.00	2,799,500	
アイフル	19,100	243.00	4,641,300	
リコーリース	1,000	2,839.00	2,839,000	
イオンフィナンシャルサービス	7,700	920.00	7,084,000	
アコム	25,100	401.00	10,065,100	
ジャックス	1,400	1,713.00	2,398,200	
オリエントコーポレーション	33,700	115.00	3,875,500	
日立キャピタル	2,900	2,617.00	7,589,300	
アプラスフィナンシャル	6,000	71.00	426,000	
オリックス	77,600	1,295.00	100,492,000	
三菱ＵＦＪリース	31,800	504.00	16,027,200	
九州リースサービス	600	585.00	351,000	
日本取引所グループ	35,900	2,602.00	93,411,800	
イー・ギャランティ	1,300	2,356.00	3,062,800	
アサックス	600	718.00	430,800	
ＮＥＣキャピタルソリューション	500	1,852.00	926,000	
いちご	15,900	271.00	4,308,900	
日本駐車場開発	12,400	136.00	1,686,400	
スター・マイカ・ホールディングス	600	1,278.00	766,800	
ＡＤワークスグループ	2,200	162.00	356,400	
ヒューリック	26,500	956.00	25,334,000	
三栄建築設計	500	1,339.00	669,500	
野村不動産ホールディングス	7,600	1,964.00	14,926,400	
三重交通グループホールディングス	2,500	445.00	1,112,500	
サムティ	1,800	1,287.00	2,316,600	
ディア・ライフ	1,800	539.00	970,200	
コーセーアールイー	400	490.00	196,000	
日本商業開発	800	1,615.00	1,292,000	
プレサンスコーポレーション	2,100	1,338.00	2,809,800	
ＴＨＥグローバル社	500	207.00	103,500	
ハウスコム	200	1,284.00	256,800	
日本管理センター	700	1,257.00	879,900	

サンセイランディック	400	705.00	282,000	
エストラスト	200	625.00	125,000	
フージャースホールディングス	2,500	573.00	1,432,500	
オープンハウス	3,900	3,450.00	13,455,000	
東急不動産ホールディングス	34,000	449.00	15,266,000	
飯田グループホールディングス	10,400	2,055.00	21,372,000	
イーグランド	200	701.00	140,200	
ムゲンエステート	800	481.00	384,800	
ビーロット	600	655.00	393,000	
ファーストブラザーズ	200	795.00	159,000	
ハウスドゥ	600	903.00	541,800	
シーアールイー	300	1,377.00	413,100	
プロパティエージェント	200	1,106.00	221,200	
ケイアイスター不動産	400	2,055.00	822,000	
アグレ都市デザイン	200	519.00	103,800	
グッドコムアセット	300	1,741.00	522,300	
ジェイ・エス・ビー	200	2,928.00	585,600	
テンポイノベーション	300	722.00	216,600	
グローバル・リンク・マネジメント	200	602.00	120,400	
パーク２４	6,700	1,662.00	11,135,400	
パラカ	300	1,688.00	506,400	
三井不動産	61,700	1,802.00	111,183,400	
三菱地所	87,700	1,668.50	146,327,450	
平和不動産	2,300	2,703.00	6,216,900	
東京建物	12,400	1,258.00	15,599,200	
ダイビル	3,200	1,093.00	3,497,600	
京阪神ビルディング	2,000	1,370.00	2,740,000	
住友不動産	28,100	3,118.00	87,615,800	
テーオーシー	2,500	688.00	1,720,000	
東京楽天地	200	4,115.00	823,000	
レオパレス２１	16,300	165.00	2,689,500	
スターツコーポレーション	1,700	2,193.00	3,728,100	
フジ住宅	1,500	508.00	762,000	
空港施設	1,300	437.00	568,100	
明和地所	700	462.00	323,400	
ゴールドクレスト	1,000	1,458.00	1,458,000	

エスリード	500	1,294.00	647,000	
日神グループホールディングス	1,800	381.00	685,800	
日本エスコン	2,300	767.00	1,764,100	
タカラレーベン	5,700	343.00	1,955,100	
ＡＶＡＮＴＩＡ	700	893.00	625,100	
イオンモール	6,300	1,380.00	8,694,000	
毎日コムネット	300	768.00	230,400	
ファースト住建	500	981.00	490,500	
ランド	66,200	10.00	662,000	
カチタス	3,100	2,506.00	7,768,600	
トーセイ	1,700	939.00	1,596,300	
穴吹興産	300	1,486.00	445,800	
サンフロンティア不動産	1,700	833.00	1,416,100	
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	820.00	902,000	
インテリックス	400	484.00	193,600	
ランドビジネス	400	357.00	142,800	
サンネクスタグループ	400	1,006.00	402,400	
グランディハウス	1,000	349.00	349,000	
日本空港ビルデング	4,000	4,355.00	17,420,000	
日本工営	800	2,788.00	2,230,400	
ＬＩＦＵＬＬ	4,200	481.00	2,020,200	
ミクシィ	2,300	2,405.00	5,531,500	
ジェイエイシーリクルートメント	800	1,223.00	978,400	
日本M＆Aセンター	9,200	5,340.00	49,128,000	
メンバーズ	400	1,595.00	638,000	
中広	200	517.00	103,400	
ＵＴグループ	1,900	3,025.00	5,747,500	
アイティメディア	500	2,616.00	1,308,000	
タケエイ	1,200	1,155.00	1,386,000	
Ｅ・Ｊホールディングス	200	2,448.00	489,600	
ビーネックスグループ	1,500	1,184.00	1,776,000	
コシダカホールディングス	2,900	427.00	1,238,300	
アルトナー	300	899.00	269,700	
パソナグループ	1,300	1,344.00	1,747,200	
ＣＤＳ	300	1,247.00	374,100	
リンクアンドモチベーション	2,200	305.00	671,000	

ＧＣＡ	1,600	604.00	966,400	
エス・エム・エス	3,800	2,913.00	11,069,400	
サニーサイドアップグループ	400	708.00	283,200	
パーソルホールディングス	12,100	1,682.00	20,352,200	
リニカル	600	824.00	494,400	
クックパッド	3,800	366.00	1,390,800	
エスクリ	400	338.00	135,200	
アイ・ケイ・ケイ	600	535.00	321,000	
学情	400	1,011.00	404,400	
スタジオアリス	600	1,545.00	927,000	
シミックホールディングス	600	1,303.00	781,800	
エプコ	300	1,028.00	308,400	
ＮＪＳ	300	1,743.00	522,900	
綜合警備保障	4,800	5,200.00	24,960,000	
カカクコム	9,000	2,609.00	23,481,000	
アイロムグループ	400	2,150.00	860,000	
セントケア・ホールディング	800	500.00	400,000	
サイネックス	200	666.00	133,200	
ルネサンス	700	855.00	598,500	
ディップ	1,700	2,155.00	3,663,500	
デジタルホールディングス	800	1,218.00	974,400	
新日本科学	1,300	691.00	898,300	
ツクイ	2,900	563.00	1,632,700	
キャリアデザインセンター	300	830.00	249,000	
ベネフィット・ワン	4,400	2,567.00	11,294,800	
エムスリー	26,700	5,930.00	158,331,000	
ツカダ・グローバルホールディング	900	251.00	225,900	
ブラス	200	406.00	81,200	
アウトソーシング	6,900	815.00	5,623,500	
ウェルネット	1,200	611.00	733,200	
ワールドホールディングス	400	1,761.00	704,400	
ディー・エヌ・エー	5,100	1,759.00	8,970,900	
博報堂ＤＹホールディングス	16,900	1,342.00	22,679,800	
ぐるなび	2,100	552.00	1,159,200	
タカミヤ	1,300	544.00	707,200	
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	906.00	906,000	

ファンコミュニケーションズ	3,300	451.00	1,488,300	
ライク	400	1,812.00	724,800	
ビジネス・ブレークスルー	500	382.00	191,000	
エスプール	3,100	703.00	2,179,300	
ＷＤＢホールディングス	600	2,797.00	1,678,200	
手間いらず	100	4,475.00	447,500	
ティア	700	465.00	325,500	
ＣＤＧ	100	1,638.00	163,800	
バリューコマース	800	3,300.00	2,640,000	
インフォマート	12,300	689.00	8,474,700	
ＪＰホールディングス	3,800	289.00	1,098,200	
エコナックホールディングス	2,000	87.00	174,000	
ＥＰＳホールディングス	1,600	1,015.00	1,624,000	
レッグス	300	961.00	288,300	
プレステージ・インターナショナル	4,500	952.00	4,284,000	
アミューズ	700	2,111.00	1,477,700	
ドリームインキュベータ	400	1,380.00	552,000	
クイック	800	1,241.00	992,800	
ＴＡＣ	700	189.00	132,300	
ケネディクス	10,400	476.00	4,950,400	
電通グループ	13,600	2,745.00	37,332,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	501.00	250,500	
ぴあ	300	2,780.00	834,000	
イオンファンタジー	500	1,602.00	801,000	
シーティーエス	1,400	845.00	1,183,000	
ネクシィーズグループ	400	835.00	334,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	3,400	2,329.00	7,918,600	
アルプス技研	1,100	1,929.00	2,121,900	
サニックス	2,100	278.00	583,800	
ダイオーズ	200	941.00	188,200	
日本空調サービス	1,300	723.00	939,900	
オリエンタルランド	12,900	13,875.00	178,987,500	
ダスキン	3,000	2,677.00	8,031,000	
明光ネットワークジャパン	1,500	756.00	1,134,000	
ファルコホールディングス	700	1,412.00	988,400	
秀英予備校	300	430.00	129,000	

田谷	200	535.00	107,000	
ラウンドワン	3,400	772.00	2,624,800	
リゾートトラスト	5,600	1,326.00	7,425,600	
ビー・エム・エル	1,600	2,715.00	4,344,000	
ワタベウェディング	200	255.00	51,000	
りらいあコミュニケーションズ	2,200	1,135.00	2,497,000	
リソー教育	5,500	311.00	1,710,500	
早稲田アカデミー	500	939.00	469,500	
ユー・エス・エス	13,600	1,750.00	23,800,000	
東京個別指導学院	400	528.00	211,200	
サイバーエージェント	7,500	5,830.00	43,725,000	
楽天	56,500	972.00	54,918,000	
クリーク・アンド・リバー社	600	1,229.00	737,400	
テー・オー・ダブリュー	1,900	297.00	564,300	
山田コンサルティンググループ	800	1,173.00	938,400	
セントラルスポーツ	500	2,080.00	1,040,000	
フルキャストホールディングス	1,100	1,526.00	1,678,600	
エン・ジャパン	2,200	3,005.00	6,611,000	
リソルホールディングス	100	3,330.00	333,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,400	5,880.00	14,112,000	
アトラ	200	252.00	50,400	
インターワークス	200	339.00	67,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	500	12,350.00	6,175,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	400	1,763.00	705,200	
ファーストロジック	200	754.00	150,800	
三機サービス	200	1,058.00	211,600	
Ｇｕｎｏｓｙ	800	893.00	714,400	
デザインワン・ジャパン	300	249.00	74,700	
イー・ガーディアン	500	3,235.00	1,617,500	
リブセンス	700	284.00	198,800	
ジャパンマテリアル	3,700	1,555.00	5,753,500	
ベクトル	1,500	841.00	1,261,500	
ウチヤマホールディングス	600	285.00	171,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,000	951.00	951,000	
キャリアリンク	400	772.00	308,800	
ＩＢＪ	1,000	816.00	816,000	

アサンテ	500	1,434.00	717,000	
N・フィールド	800	595.00	476,000	
バリューＨＲ	500	1,400.00	700,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,000	4,000.00	4,000,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	500	2,898.00	1,449,000	
ＥＲＩホールディングス	300	563.00	168,900	
アビスト	200	2,699.00	539,800	
シグマクシス	800	1,459.00	1,167,200	
ウィルグループ	800	760.00	608,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	310.00	558,000	
リクルートホールディングス	86,800	3,756.00	326,020,800	
エラン	800	2,299.00	1,839,200	
土木管理総合試験所	600	369.00	221,400	
ネットマーケティング	500	560.00	280,000	
日本郵政	99,400	773.10	76,846,140	
ベルシステム２４ホールディングス	2,000	1,789.00	3,578,000	
鎌倉新書	900	875.00	787,500	
ＳＭＮ	300	895.00	268,500	
一蔵	100	345.00	34,500	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	400	2,365.00	946,000	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	200	669.00	133,800	
エアトリ	600	1,241.00	744,600	
アトラエ	400	3,245.00	1,298,000	
ストライク	500	4,740.00	2,370,000	
ソラスト	3,300	1,155.00	3,811,500	
セラク	400	1,194.00	477,600	
インソース	500	2,647.00	1,323,500	
ベイカレント・コンサルティング	700	11,500.00	8,050,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	300	1,597.00	479,100	
アイモバイル	400	756.00	302,400	
キャリアインデックス	500	502.00	251,000	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	400	818.00	327,200	
船場	200	896.00	179,200	
グレイステクノロジー	600	5,140.00	3,084,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,300	3,650.00	4,745,000	

フルテック	200	1,284.00	256,800	
グリーンズ	300	429.00	128,700	
ツナググループ・ホールディングス	200	411.00	82,200	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	400	600.00	240,000	
ソウルドアウト	300	1,702.00	510,600	
ＭＳ＆Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	200	576.00	115,200	
ミダック	200	1,732.00	346,400	
日総工産	800	657.00	525,600	
キュービーネットホールディングス	500	1,730.00	865,000	
ＲＰＡホールディングス	900	786.00	707,400	
スプリックス	300	860.00	258,000	
マネジメントソリューションズ	600	1,162.00	697,200	
プロレド・パートナーズ	200	5,010.00	1,002,000	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	100	908.00	90,800	
ギークス	100	1,215.00	121,500	
カーブスホールディングス	3,300	628.00	2,072,400	
フォーラムエンジニアリング	600	818.00	490,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	600	698.00	418,800	
リログループ	6,600	2,078.00	13,714,800	
東祥	800	1,291.00	1,032,800	
エイチ・アイ・エス	1,900	1,604.00	3,047,600	
ラックランド	300	2,181.00	654,300	
共立メンテナンス	2,000	3,425.00	6,850,000	
イチネンホールディングス	1,400	1,145.00	1,603,000	
建設技術研究所	800	1,875.00	1,500,000	
スペース	800	822.00	657,600	
長大	500	1,209.00	604,500	
燦ホールディングス	500	1,204.00	602,000	
スバル興業	100	7,340.00	734,000	
東京テアトル	500	1,240.00	620,000	
タナベ経営	200	1,323.00	264,600	
ナガワ	400	7,770.00	3,108,000	
よみうりランド	300	3,565.00	1,069,500	
東京都競馬	800	4,745.00	3,796,000	
常磐興産	500	1,355.00	677,500	
カナモト	2,100	2,278.00	4,783,800	

東京ドーム	4,900	748.00	3,665,200	
西尾レントオール	1,100	2,196.00	2,415,600	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	7,000	29.00	203,000	
トランス・コスモス	1,200	2,893.00	3,471,600	
乃村工藝社	5,200	737.00	3,832,400	
藤田観光	500	1,446.00	723,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	800	821.00	656,800	
日本管財	1,300	1,958.00	2,545,400	
トーカイ	1,200	2,199.00	2,638,800	
白洋舎	100	2,436.00	243,600	
セコム	12,900	10,175.00	131,257,500	
セントラル警備保障	600	3,605.00	2,163,000	
丹青社	2,300	648.00	1,490,400	
メイテック	1,500	5,200.00	7,800,000	
応用地質	1,400	1,269.00	1,776,600	
船井総研ホールディングス	2,500	2,359.00	5,897,500	
進学会ホールディングス	500	423.00	211,500	
オオバ	900	714.00	642,600	
いであ	300	1,923.00	576,900	
学究社	400	1,114.00	445,600	
ベネッセホールディングス	4,000	2,704.00	10,816,000	
イオンディライト	1,500	3,205.00	4,807,500	
ナック	700	942.00	659,400	
ニチイ学館	1,200	1,698.00	2,037,600	
ダイセキ	2,000	2,345.00	4,690,000	
ステップ	400	1,507.00	602,800	
合　計	14,997,535		28,615,564,695	

(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 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	16,024,675,387
コール・ローン	65,648,577
株式	46,219,640,881
投資証券	1,131,728,662
派生商品評価勘定	1,250,812,061
未収入金	51,948
未収配当金	61,739,195
差入委託証拠金	3,246,875,125
流動資産合計	68,001,171,836
資産合計	68,001,171,836
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,802,271
未払解約金	72,339,000
未払利息	178
流動負債合計	75,141,449
負債合計	75,141,449
純資産の部	
元本等	
元本	48,607,586,553
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	19,318,443,834
元本等合計	67,926,030,387
純資産合計	67,926,030,387
負債純資産合計	68,001,171,836

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 8月17日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	29,751,592,894円
期中追加設定元本額	25,543,249,557円
期中一部解約元本額	6,687,255,898円
期末元本額	48,607,586,553円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,814,675,295円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	5,687,266,519円
りそなラップ型ファンド（成長型）	4,207,312,981円
ＤＣりそな　グローバルバランス	36,146,466円
つみたてバランスファンド	1,166,565,609円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	684,583,342円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	335,594,616円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	202,164,923円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	13,203,661円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	11,002,660円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	3,948,781円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	6,298,954円

リスクコントロール・オープン	32,523,146円
ＦＷりそな先進国株式アクティブファンド	315,363,564円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	192,790,764円
ＦＷりそな先進国株式インデックスファンド	20,810,154,909円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	3,128,542,370円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	96,427,431円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	255,819,900円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	274,615,261円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	1,999,611,491円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	1,771,139,198円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	1,110,307,528円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	654,752,545円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	1,819,513,562円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	294,968,864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）	5,685,180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）	385,632,189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	
	48,607,586,553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	1.3974円
(10,000口当たり純資産額)	(13,974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 8月17日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	646,414,654
投資証券	△118,310,192
合計	528,104,462

(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 8月17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	19,275,944,458	－	20,523,954,248	1,248,009,790
合計		19,275,944,458	－	20,523,954,248	1,248,009,790

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	IAC/INTERACTIVECORP	691	123.41	85,276.31	
	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	17.23	123,797.55	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,861	20.04	57,334.44	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	54.25	136,384.50	
	CHEVRON CORP	20,064	90.35	1,812,782.40	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	51.26	92,114.22	
	CONOCOPHILLIPS	11,641	40.82	475,185.62	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	45.51	75,410.07	
	EOG RESOURCES INC	6,306	47.97	302,498.82	
	EXXON MOBIL CORP	45,166	43.20	1,951,171.20	
	HALLIBURTON CO	7,683	16.63	127,768.29	
	HESS CORP	3,020	53.78	162,415.60	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	25.99	44,364.93	

KINDER MORGAN INC	22,071	14.29	315,394.59	
MARATHON PETROLEUM CORP	7,066	38.35	270,981.10	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	13.12	40,055.36	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,822	14.64	143,794.08	
ONEOK INC	4,830	29.49	142,436.70	
PHILLIPS 66	4,762	63.66	303,148.92	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,821	110.73	201,639.33	
SCHLUMBERGER LTD	15,077	20.07	302,595.39	
VALERO ENERGY CORP	4,460	54.46	242,891.60	
WILLIAMS COS INC	13,196	22.13	292,027.48	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,378	289.82	689,191.96	
ALBEMARLE CORP	1,183	92.39	109,297.37	
AMCOR PLC	17,805	11.20	199,416.00	
AVERY DENNISON CORP	928	116.59	108,195.52	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	23.90	40,295.40	
BALL CORP	3,574	75.50	269,837.00	
CELANESE CORP	1,332	101.48	135,171.36	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	35.10	54,580.50	
CORTEVA INC	8,263	27.87	230,289.81	
CROWN HOLDINGS INC	1,510	76.36	115,303.60	
DOW INC	8,080	44.87	362,549.60	
DUPONT DE NEMOURS INC	8,014	58.16	466,094.24	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	73.29	91,099.47	
ECOLAB INC	2,752	194.71	535,841.92	
FMC CORP	1,444	109.61	158,276.84	
FREEPORT-MCMORAN INC	16,054	13.78	221,224.12	
INTERNATIONAL PAPER CO	4,150	37.27	154,670.50	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	708	123.17	87,204.36	
LINDE PLC	5,713	248.50	1,419,680.50	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,955	69.01	203,924.55	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	693	219.33	151,995.69	
MOSAIC CO/THE	3,288	17.83	58,625.04	
NEWMONT CORP	8,719	63.85	556,708.15	
NUCOR CORP	3,362	46.24	155,458.88	
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	99.67	84,520.16	

PPG INDUSTRIES INC	2,581	118.98	307,087.38	
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	84.25	121,825.50	
SEALED AIR CORP	1,397	41.16	57,500.52	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	897	666.56	597,904.32	
STEEL DYNAMICS INC	2,352	30.95	72,794.40	
VULCAN MATERIALS CO	1,473	129.74	191,107.02	
WESTROCK CO	2,274	30.29	68,879.46	
3M CO	6,170	166.10	1,024,837.00	
AERCAP HOLDINGS NV	853	31.70	27,040.10	
ALLEGION PLC	1,026	101.56	104,200.56	
AMETEK INC	2,517	101.28	254,921.76	
BOEING CO/THE	5,732	178.08	1,020,754.56	
CARRIER GLOBAL CORP	9,015	29.52	266,122.80	
CATERPILLAR INC	5,909	139.96	827,023.64	
CUMMINS INC	1,639	213.51	349,942.89	
DEERE & CO	3,214	191.13	614,291.82	
DOVER CORP	1,600	111.52	178,432.00	
EATON CORP PLC	4,479	100.89	451,886.31	
EMERSON ELECTRIC CO	6,625	69.73	461,961.25	
FASTENAL CO	6,269	47.99	300,849.31	
FORTIVE CORP	3,320	73.58	244,285.60	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	83.06	91,698.24	
GENERAL DYNAMICS CORP	2,668	156.46	417,435.28	
GENERAL ELECTRIC CO	94,041	6.66	626,313.06	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	41.92	63,886.08	
HEICO CORP	242	106.57	25,789.94	
HEICO CORP-CLASS A	819	87.35	71,539.65	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,631	160.28	1,223,096.68	
HOWMET AEROSPACE INC	3,134	17.55	55,001.70	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	166.89	48,231.21	
IDEX CORP	845	176.70	149,311.50	
ILLINOIS TOOL WORKS	3,433	196.13	673,314.29	
INGERSOLL-RAND INC	3,920	35.40	138,768.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	90.00	97,110.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	40.25	112,700.00	

JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	20.21	46,483.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,332	40.86	340,445.52	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,394	182.58	437,096.52	
LENNOX INTERNATIONAL INC	245	277.97	68,102.65	
LOCKHEED MARTIN CORP	2,720	391.42	1,064,662.40	
MASCO CORP	3,079	57.96	178,458.84	
NORDSON CORP	495	206.67	102,301.65	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,718	342.06	587,659.08	
OTIS WORLDWIDE CORP	4,485	64.07	287,353.95	
OWENS CORNING	860	67.33	57,903.80	
PACCAR INC	3,778	88.95	336,053.10	
PARKER HANNIFIN CORP	1,404	209.62	294,306.48	
PENTAIR PLC	1,289	45.08	58,108.12	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	16,242	63.64	1,033,640.88	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,269	232.05	294,471.45	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,147	444.95	510,357.65	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	41.22	69,332.04	
SMITH (A.O.) CORP	1,507	49.76	74,988.32	
SNAP-ON INC	437	153.64	67,140.68	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,689	158.78	268,179.42	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	406	332.18	134,865.08	
TEXTRON INC	1,613	38.49	62,084.37	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,613	118.88	310,633.44	
TRANSDIGM GROUP INC	559	498.79	278,823.61	
UNITED RENTALS INC	621	179.33	111,363.93	
WABTEC CORP	2,019	69.52	140,360.88	
WW GRAINGER INC	506	351.38	177,798.28	
XYLEM INC	1,998	79.62	159,080.76	
CINTAS CORP	955	316.44	302,200.20	
COPART INC	2,291	100.01	229,122.91	
COSTAR GROUP INC	421	830.37	349,585.77	
EQUIFAX INC	1,317	164.74	216,962.58	
IHS MARKIT LTD	4,101	82.75	339,357.75	
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	15.89	43,427.37	
REPUBLIC SERVICES INC	2,433	90.37	219,870.21	

ROBERT HALF INTL INC	673	56.63	38,111.99	
ROLLINS INC	1,190	54.73	65,128.70	
TRANSUNION	2,060	87.71	180,682.60	
VERISK ANALYTICS INC	1,675	189.15	316,826.25	
WASTE CONNECTIONS INC	2,855	99.81	284,957.55	
WASTE MANAGEMENT INC	4,563	111.47	508,637.61	
AMERCO	106	350.70	37,174.20	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	95.08	141,288.88	
CSX CORP	8,321	74.25	617,834.25	
DELTA AIR LINES INC	1,316	28.95	38,098.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,870	86.10	161,007.00	
FEDEX CORP	2,677	208.60	558,422.20	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	137.19	100,697.46	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,059	183.93	194,781.87	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	43.85	45,779.40	
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,778	206.61	573,962.58	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,051	191.56	201,329.56	
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	34.90	31,689.20	
UBER TECHNOLOGIES INC	10,289	29.99	308,567.11	
UNION PACIFIC CORP	7,380	191.92	1,416,369.60	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,523	160.74	1,209,247.02	
XPO LOGISTICS INC	977	82.96	81,051.92	
APTIV PLC	2,927	88.34	258,571.18	
AUTOLIV INC	743	72.25	53,681.75	
BORGWARNER INC	2,199	41.79	91,896.21	
FORD MOTOR CO	42,318	7.04	297,918.72	
GENERAL MOTORS CO	13,900	27.86	387,254.00	
LEAR CORP	352	118.53	41,722.56	
TESLA INC	1,574	1,650.71	2,598,217.54	
DR HORTON INC	3,907	71.39	278,920.73	
GARMIN LTD	1,303	104.27	135,870.32	
HASBRO INC	1,095	79.63	87,194.85	
LENNAR CORP-A	3,110	74.25	230,917.50	
LULULEMON ATHLETICA INC	1,355	349.12	473,057.60	
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	90.26	50,906.64	

NEWELL RUBBERMAID INC	2,767	16.99	47,011.33	
NIKE INC -CL B	13,339	106.43	1,419,669.77	
NVR INC	40	4,044.81	161,792.40	
PULTEGROUP INC	2,237	45.07	100,821.59	
RALPH LAUREN CORP	478	70.66	33,775.48	
VF CORP	3,763	64.24	241,735.12	
WHIRLPOOL CORP	714	180.93	129,184.02	
ARAMARK	2,216	24.99	55,377.84	
CARNIVAL CORP	3,704	15.47	57,300.88	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	290	1,186.53	344,093.70	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	84.07	92,729.21	
DOMINO'S PIZZA INC	438	398.99	174,757.62	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,098	86.00	266,428.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	3,893	48.37	188,304.41	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,056	96.01	293,406.56	
MCDONALD'S CORP	7,991	207.03	1,654,376.73	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	19.49	21,439.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	21.81	100,064.28	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	60.50	94,864.00	
STARBUCKS CORP	12,635	78.37	990,204.95	
VAIL RESORTS INC	293	216.92	63,557.56	
WYNN RESORTS LTD	1,017	84.98	86,424.66	
YUM! BRANDS INC	3,325	92.65	308,061.25	
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,296	80.40	666,998.40	
ALPHABET INC-CL A	3,198	1,504.63	4,811,806.74	
ALPHABET INC-CL C	3,272	1,507.73	4,933,292.56	
ALTICE USA INC- A	2,974	27.22	80,952.28	
CABLE ONE INC	41	1,870.17	76,676.97	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,582	604.99	957,094.18	
COMCAST CORP-CLASS A	48,588	43.77	2,126,696.76	
DISCOVERY INC - A	1,722	22.62	38,951.64	
DISCOVERY INC-C	3,336	20.76	69,255.36	
DISH NETWORK CORP-A	2,183	34.67	75,684.61	
ELECTRONIC ARTS INC	3,153	140.43	442,775.79	
FACEBOOK INC-A	25,641	261.24	6,698,454.84	

FOX CORP - CLASS A	3,877	25.74	99,793.98	
FOX CORP- CLASS B	1,836	25.82	47,405.52	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	18.86	69,574.54	
LIBERTY BROADBAND-A	223	139.04	31,005.92	
LIBERTY BROADBAND-C	1,204	140.59	169,270.36	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	37.52	80,780.56	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	35.95	63,164.15	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	36.04	34,093.84	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	51.48	80,514.72	
MATCH GROUP INC	2,699	118.80	320,641.20	
NETFLIX INC	4,689	482.68	2,263,286.52	
NEWS CORP - CLASS A	2,810	15.33	43,077.30	
OMNICOM GROUP	2,439	54.85	133,779.15	
PINTEREST INC- CLASS A	4,088	34.68	141,771.84	
ROKU INC	1,052	146.85	154,486.20	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.98	62,114.26	
SNAP INC - A	9,678	21.69	209,915.82	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,271	173.41	220,404.11	
TWITTER INC	8,612	37.90	326,394.80	
VIACOMCBS INC - CLASS B	6,314	27.46	173,382.44	
WALT DISNEY CO/THE	19,296	130.53	2,518,706.88	
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	76.64	107,909.12	
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	158.66	93,133.42	
AMAZON.COM INC	4,506	3,148.02	14,184,978.12	
AUTOZONE INC	258	1,196.05	308,580.90	
BEST BUY CO INC	2,568	109.49	281,170.32	
BOOKING HOLDINGS INC	442	1,778.87	786,260.54	
BURLINGTON STORES INC	580	193.80	112,404.00	
CARMAX INC	1,819	104.35	189,812.65	
DOLLAR GENERAL CORP	2,750	198.55	546,012.50	
DOLLAR TREE INC	2,604	98.84	257,379.36	
EBAY INC	8,607	56.29	484,488.03	
EXPEDIA GROUP INC	1,497	86.73	129,834.81	
GENUINE PARTS CO	1,255	94.56	118,672.80	
HOME DEPOT INC	11,640	280.55	3,265,602.00	

LKQ CORP	2,845	31.49	89,589.05	
LOWE'S COS INC	8,214	154.34	1,267,748.76	
MERCADOLIBRE INC	484	1,156.44	559,716.96	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	815	463.55	377,793.25	
ROSS STORES INC	3,908	94.06	367,586.48	
TARGET CORP	5,458	136.53	745,180.74	
TIFFANY & CO	1,214	125.00	151,750.00	
TJX COMPANIES INC	12,956	57.87	749,763.72	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,305	148.60	193,923.00	
ULTA BEAUTY INC	498	225.42	112,259.16	
WAYFAIR INC- CLASS A	567	309.99	175,764.33	
COSTCO WHOLESALE CORP	4,723	336.28	1,588,250.44	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	4.27	427.00	
KROGER CO	8,728	35.39	308,883.92	
SYSCO CORP	5,273	59.54	313,954.42	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,179	41.91	342,781.89	
WALMART INC	15,151	132.60	2,009,022.60	
ALTRIA GROUP INC	19,925	42.54	847,609.50	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,088	44.59	271,463.92	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,379	71.13	240,348.27	
BUNGE LTD	1,423	45.93	65,358.39	
CAMPBELL SOUP CO	1,995	51.63	103,001.85	
COCA-COLA CO/THE	43,505	48.45	2,107,817.25	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,555	42.10	65,465.50	
CONAGRA BRANDS INC	5,346	37.78	201,971.88	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,815	176.03	319,494.45	
GENERAL MILLS INC	6,531	63.27	413,216.37	
HERSHEY CO/THE	1,622	146.07	236,925.54	
HORMEL FOODS CORP	3,241	52.23	169,277.43	
INGREDION INC	744	81.65	60,747.60	
JM SMUCKER CO/THE	1,257	113.97	143,260.29	
KELLOGG CO	2,819	69.10	194,792.90	
KEURIG DR PEPPER INC	3,147	29.89	94,063.83	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,334	35.59	261,017.06	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	64.65	84,045.00	

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,348	201.55	271,689.40	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	37.68	55,125.84	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	15,364	56.12	862,227.68	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,374	83.32	364,441.68	
PEPSICO INC	14,832	137.56	2,040,289.92	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,639	77.71	1,293,016.69	
TYSON FOODS INC-CL A	3,241	63.94	207,229.54	
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,623	94.26	247,243.98	
CLOROX COMPANY	1,334	224.25	299,149.50	
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,654	77.05	666,790.70	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,370	212.09	502,653.30	
KIMBERLY-CLARK CORP	3,642	158.23	576,273.66	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	26,285	135.10	3,551,103.50	
ABBOTT LABORATORIES	18,821	99.99	1,881,911.79	
ABIOMED INC	494	307.35	151,830.90	
ALIGN TECHNOLOGY INC	815	306.96	250,172.40	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,693	103.75	175,648.75	
ANTHEM INC	2,704	283.23	765,853.92	
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,493	83.50	458,665.50	
BECTON DICKINSON AND CO	2,906	258.17	750,242.02	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,005	39.16	587,595.80	
CARDINAL HEALTH INC	3,200	53.68	171,776.00	
CENTENE CORP	6,322	64.64	408,654.08	
CERNER CORP	3,392	72.91	247,310.72	
CIGNA CORP	3,992	183.40	732,132.80	
COOPER COS INC/THE	539	303.82	163,758.98	
CVS HEALTH CORP	13,958	65.67	916,621.86	
DANAHER CORP	6,696	204.86	1,371,742.56	
DAVITA INC	653	82.17	53,657.01	
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	44.52	91,176.96	
DEXCOM INC	987	425.16	419,632.92	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,751	78.07	527,050.57	
HCA HEALTHCARE INC	2,934	134.43	394,417.62	
HENRY SCHEIN INC	1,305	67.23	87,735.15	
HOLOGIC INC	2,888	66.81	192,947.28	

HUMANA INC	1,419	422.02	598,846.38	
IDEXX LABORATORIES INC	923	379.40	350,186.20	
INSULET CORP	689	202.13	139,267.57	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,243	684.52	850,858.36	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,064	189.84	201,989.76	
MASIMO CORP	462	214.09	98,909.58	
MCKESSON CORP	1,755	158.67	278,465.85	
MEDTRONIC PLC	14,324	100.71	1,442,570.04	
MOLINA HEALTHCARE INC	546	193.76	105,792.96	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,464	120.01	175,694.64	
RESMED INC	1,566	176.78	276,837.48	
STERIS PLC	740	158.70	117,438.00	
STRYKER CORP	3,616	188.37	681,145.92	
TELADOC HEALTH INC	632	187.50	118,500.00	
TELEFLEX INC	508	378.47	192,262.76	
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,112	323.70	3,273,254.40	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	114.16	74,546.48	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	994	173.15	172,111.10	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,428	258.34	368,909.52	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	808	272.47	220,155.76	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,240	137.32	307,596.80	
ABBVIE INC	18,852	95.07	1,792,259.64	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,370	97.37	328,136.90	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,406	102.97	247,745.82	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,233	136.14	167,860.62	
AMGEN INC	6,299	239.71	1,509,933.29	
AVANTOR INC	3,867	20.68	79,969.56	
BEIGENE LTD-ADR	500	210.72	105,360.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	506.37	124,567.02	
BIOGEN INC	1,873	289.45	542,139.85	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,957	118.16	231,239.12	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24,116	63.16	1,523,166.56	
CATALENT INC	1,400	87.02	121,828.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,830	25.77	98,699.10	
ELI LILLY & CO	9,193	150.09	1,379,777.37	

EXACT SCIENCES CORP	1,627	85.33	138,831.91	
GILEAD SCIENCES INC	13,520	68.50	926,120.00	
ILLUMINA INC	1,579	347.56	548,797.24	
INCYTE CORP	2,012	94.87	190,878.44	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	958	52.78	50,563.24	
IQVIA HOLDINGS INC	2,091	161.23	337,131.93	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	406	124.26	50,449.56	
JOHNSON & JOHNSON	28,077	148.24	4,162,134.48	
MERCK & CO. INC.	27,061	83.48	2,259,052.28	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	263	961.04	252,753.52	
MODERNA INC	2,441	69.15	168,795.15	
MYLAN NV	4,542	16.19	73,534.98	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	114.39	110,271.96	
PERKINELMER INC	1,224	118.25	144,738.00	
PERRIGO CO PLC	998	53.40	53,293.20	
PFIZER INC	59,057	38.06	2,247,709.42	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,082	612.57	662,800.74	
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	157.00	127,641.00	
SEATTLE GENETICS INC	1,315	157.27	206,810.05	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	11.50	147,418.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,259	413.76	1,762,203.84	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,778	267.29	742,531.62	
WATERS CORP	535	215.40	115,239.00	
ZOETIS INC	5,094	157.05	800,012.70	
BANK OF AMERICA CORP	83,806	26.47	2,218,344.82	
CITIGROUP INC	22,512	52.93	1,191,560.16	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	25.90	93,758.00	
COMERICA INC	1,325	41.82	55,411.50	
EAST WEST BANCORP INC	1,540	38.46	59,228.40	
FIFTH THIRD BANCORP	7,761	20.96	162,670.56	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,868	117.34	219,191.12	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	9.90	89,020.80	
JPMORGAN CHASE & CO	32,764	102.41	3,355,361.24	
KEYCORP	8,597	12.75	109,611.75	
M & T BANK CORP	1,428	109.21	155,951.88	

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	11.36	38,885.28	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,656	111.75	520,308.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	11.77	102,104.75	
SIGNATURE BANK	590	107.43	63,383.70	
SVB FINANCIAL GROUP	416	250.38	104,158.08	
TRUIST FINANCIAL CORP	14,419	39.50	569,550.50	
US BANCORP	14,716	37.78	555,970.48	
WELLS FARGO & CO	41,644	25.30	1,053,593.20	
ZIONS BANCORPORATION	1,197	34.49	41,284.53	
ALLY FINANCIAL INC	3,571	22.64	80,847.44	
AMERICAN EXPRESS CO	7,407	100.41	743,736.87	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,374	159.66	219,372.84	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	47.87	74,437.85	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,766	37.53	328,987.98	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	14,800	210.96	3,122,208.00	
BLACKROCK INC	1,639	588.46	964,485.94	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	7,338	52.74	387,006.12	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,016	69.47	348,461.52	
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	27.14	33,925.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	88.26	109,354.14	
CME GROUP INC	3,868	171.44	663,129.92	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	54.30	152,040.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	54.36	105,621.48	
EQUITABLE HOLDINGS INC	2,938	21.80	64,048.40	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	354.59	121,978.96	
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	21.95	60,099.10	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,540	207.97	736,213.80	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,988	102.49	613,710.12	
INVESCO LTD	2,612	10.68	27,896.16	
KKR & CO INC	5,635	36.63	206,410.05	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	421	496.50	209,026.50	
MOODY'S CORP	1,827	281.05	513,478.35	
MORGAN STANLEY	12,955	52.30	677,546.50	
MSCI INC	928	356.41	330,748.48	
NASDAQ INC	1,296	129.24	167,495.04	

NORTHERN TRUST CORP	2,230	83.42	186,026.60	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	75.98	80,006.94	
S&P GLOBAL INC	2,621	352.27	923,299.67	
SCHWAB (CHARLES) CORP	12,586	35.05	441,139.30	
SEI INVESTMENTS COMPANY	896	53.23	47,694.08	
STATE STREET CORP	3,914	70.53	276,054.42	
SYNCHRONY FINANCIAL	6,195	24.93	154,441.35	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,586	136.94	354,126.84	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,033	37.95	115,102.35	
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	55.28	40,575.52	
VOYA FINANCIAL INC	845	52.16	44,075.20	
AFLAC INC	7,568	38.07	288,113.76	
ALLEGHANY CORP	101	549.70	55,519.70	
ALLSTATE CORP	3,471	96.12	333,632.52	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	67.61	52,465.36	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,607	30.99	297,720.93	
AON PLC	2,512	197.20	495,366.40	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,552	32.25	146,802.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,097	106.99	224,358.03	
ASSURANT INC	506	125.07	63,285.42	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	36.93	46,901.10	
BROWN & BROWN INC	2,686	45.82	123,072.52	
CHUBB LTD	4,881	130.14	635,213.34	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	80.11	138,910.74	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	217.32	31,728.72	
EVEREST RE GROUP LTD	313	225.28	70,512.64	
FNF GROUP	3,124	33.10	103,404.40	
GLOBE LIFE INC	921	85.48	78,727.08	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,020	42.81	172,096.20	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	38.82	79,969.20	
LOEWS CORP	2,906	37.61	109,294.66	
MARKEL CORP	155	1,097.18	170,062.90	
MARSH & MCLENNAN COS	5,447	116.61	635,174.67	
METLIFE INC	8,537	39.61	338,150.57	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	45.22	110,743.78	

PROGRESSIVE CORP	6,345	88.97	564,514.65	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,378	70.59	309,043.02	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	95.38	44,828.60	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	179.02	100,609.24	
TRAVELERS COS INC/THE	2,795	118.60	331,487.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,416	201.51	285,338.16	
WR BERKLEY CORP	1,291	62.28	80,403.48	
CBRE GROUP INC - A	3,058	46.02	140,729.16	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	8,400	3.67	30,828.00	
JONES LANG LASALLE INC	468	100.35	46,963.80	
ACCENTURE PLC-CL A	6,783	230.25	1,561,785.75	
ADOBE INC	5,143	447.60	2,302,006.80	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,773	107.90	191,306.70	
ANSYS INC	933	313.19	292,206.27	
AUTODESK INC	2,364	234.35	554,003.40	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,632	138.96	643,662.72	
AVALARA INC	656	119.27	78,241.12	
BLACK KNIGHT INC	1,644	79.16	130,139.04	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	86.43	133,188.63	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,262	138.88	175,266.56	
CADENCE DESIGN SYS INC	3,037	108.00	327,996.00	
CDK GLOBAL INC	1,236	45.50	56,238.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,222	123.95	151,466.90	
CITRIX SYSTEMS INC	1,273	136.35	173,573.55	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,936	66.93	397,296.48	
COUPA SOFTWARE INC	728	285.89	208,127.92	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	916	101.25	92,745.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	279	108.94	30,394.26	
DATADOG INC - CLASS A	933	81.24	75,796.92	
DOCUSIGN INC	1,842	199.71	367,865.82	
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	19.50	52,552.50	
DYNATRACE INC	1,119	37.31	41,749.89	
EPAM SYSTEMS INC	480	307.97	147,825.60	
FAIR ISAAC CORP	258	429.67	110,854.86	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,599	143.88	949,464.12	

FISERV INC	6,206	99.77	619,172.62	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	930	240.28	223,460.40	
FORTINET INC	1,600	127.60	204,160.00	
GARTNER INC	792	129.49	102,556.08	
GLOBAL PAYMENTS INC	3,221	172.50	555,622.50	
GODADDY INC - CLASS A	1,543	80.72	124,550.96	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	110.63	100,452.04	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9,501	125.27	1,190,190.27	
INTUIT INC	2,790	305.54	852,456.60	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	194.36	163,845.48	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,476	94.72	139,806.72	
MASTERCARD INC-CLASS A	9,541	326.80	3,117,998.80	
MICROSOFT CORP	76,921	208.90	16,068,796.90	
MONGODB INC	444	199.13	88,413.72	
NORTONLIFELOCK INC	6,268	22.92	143,662.56	
OKTA INC	1,233	198.86	245,194.38	
ORACLE CORP	23,992	54.20	1,300,366.40	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,084	259.11	280,875.24	
PAYCHEX INC	3,506	74.31	260,530.86	
PAYCOM SOFTWARE INC	550	303.07	166,688.50	
PAYPAL HOLDINGS INC	11,889	191.46	2,276,267.94	
PTC INC	1,110	87.48	97,102.80	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	788	284.42	224,122.96	
SALESFORCE.COM INC	8,995	193.46	1,740,172.70	
SERVICENOW INC	2,033	435.73	885,839.09	
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	2,725	28.36	77,281.00	
SPLUNK INC	1,688	192.34	324,669.92	
SQUARE INC - A	3,819	141.96	542,145.24	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	61.16	122,381.16	
SYNOPSYS INC	1,626	196.16	318,956.16	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	447	465.60	208,123.20	
TWILIO INC - A	1,283	240.06	307,996.98	
TYLER TECHNOLOGIES INC	433	335.57	145,301.81	
VERISIGN INC	1,141	207.29	236,517.89	
VISA INC-CLASS A SHARES	18,183	196.64	3,575,505.12	

VMWARE INC-CLASS A	730	135.85	99,170.50	
WESTERN UNION CO	2,957	23.64	69,903.48	
WIX.COM LTD	591	277.68	164,108.88	
WORKDAY INC-CLASS A	1,806	181.58	327,933.48	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	1,174	244.91	287,524.34	
AMPHENOL CORP-CL A	3,259	109.78	357,773.02	
APPLE INC	46,585	459.63	21,411,863.55	
ARISTA NETWORKS INC	519	212.67	110,375.73	
ARROW ELECTRONICS INC	902	75.82	68,389.64	
CDW CORP/DE	1,592	113.52	180,723.84	
CISCO SYSTEMS INC	45,313	42.50	1,925,802.50	
COGNEX CORP	1,928	67.49	130,120.72	
CORNING INC	8,440	32.32	272,780.80	
DELL TECHNOLOGIES -C	2,187	59.91	131,023.17	
F5 NETWORKS INC	613	136.05	83,398.65	
FLIR SYSTEMS INC	1,041	37.80	39,349.80	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	14,447	9.67	139,702.49	
HP INC	15,754	18.18	286,407.72	
IPG PHOTONICS CORP	259	158.25	40,986.75	
JUNIPER NETWORKS INC	2,337	24.82	58,004.34	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,082	102.95	214,341.90	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,879	145.37	273,150.23	
NETAPP INC	2,471	41.56	102,694.76	
SEAGATE TECHNOLOGY	2,020	45.07	91,041.40	
TE CONNECTIVITY LTD	3,659	94.76	346,726.84	
TRIMBLE INC	2,244	50.38	113,052.72	
WESTERN DIGITAL CORP	2,541	35.74	90,815.34	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	603	286.03	172,476.09	
AT&T INC	76,714	30.01	2,302,187.14	
CENTURYLINK INC	7,172	11.07	79,394.04	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	22.20	28,993.20	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	21.54	75,454.62	
T-MOBILE US INC	5,997	115.49	692,593.53	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	44,223	58.79	2,599,870.17	
AES CORP	7,346	17.57	129,069.22	

ALLIANT ENERGY CORP	2,711	53.77	145,770.47	
AMEREN CORPORATION	2,709	81.27	220,160.43	
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,339	82.95	442,870.05	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,977	145.31	287,277.87	
ATMOS ENERGY CORP	1,353	104.50	141,388.50	
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	20.54	81,174.08	
CMS ENERGY CORP	3,133	60.88	190,737.04	
CONSOLIDATED EDISON INC	3,643	73.53	267,869.79	
DOMINION ENERGY INC	9,007	78.85	710,201.95	
DTE ENERGY COMPANY	2,108	117.71	248,132.68	
DUKE ENERGY CORP	7,883	82.15	647,588.45	
EDISON INTERNATIONAL	3,980	52.69	209,706.20	
ENTERGY CORP	2,195	100.93	221,541.35	
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	45.35	111,787.75	
EVERGY INC	2,522	53.57	135,103.54	
EVERSOURCE ENERGY	3,590	87.15	312,868.50	
EXELON CORP	10,548	37.93	400,085.64	
FIRSTENERGY CORP	5,919	29.33	173,604.27	
NEXTERA ENERGY INC	5,230	280.50	1,467,015.00	
NISOURCE INC	4,230	24.12	102,027.60	
NRG ENERGY INC	1,800	34.94	62,892.00	
OGE ENERGY CORP	1,432	32.62	46,711.84	
PINNACLE WEST CAPITAL	828	78.00	64,584.00	
PPL CORP	8,432	29.05	244,949.60	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,507	55.17	303,821.19	
SEMPRA ENERGY	3,167	131.89	417,695.63	
SOUTHERN CO/THE	11,345	53.56	607,638.20	
UGI CORP	1,566	34.60	54,183.60	
VISTRA CORP	4,854	19.05	92,468.70	
WEC ENERGY GROUP INC	3,432	91.21	313,032.72	
XCEL ENERGY INC	5,688	70.73	402,312.24	
ADVANCED MICRO DEVICES	12,498	81.30	1,016,087.40	
ANALOG DEVICES INC	3,940	117.18	461,689.20	
APPLIED MATERIALS INC	9,816	67.62	663,757.92	
BROADCOM INC	4,260	327.82	1,396,513.20	

	INTEL CORP	45,561	48.89	2,227,477.29	
	KLA CORP	1,682	211.51	355,759.82	
	LAM RESEARCH CORP	1,557	373.64	581,757.48	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,213	33.57	242,140.41	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,911	68.60	199,694.60	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,575	100.20	258,015.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	11,877	45.60	541,591.20	
	NVIDIA CORP	6,520	462.56	3,015,891.20	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,992	123.04	368,135.68	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	22.04	70,505.96	
	QORVO INC	1,251	131.68	164,731.68	
	QUALCOMM INC	12,193	113.74	1,386,831.82	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,831	146.12	267,545.72	
	TERADYNE INC	1,812	90.06	163,188.72	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	9,960	137.35	1,368,006.00	
	XILINX INC	2,675	105.31	281,704.25	
米ドル 小計		3,097,648		309,765,223.55 (33,005,484,569)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	13.84	34,101.76	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	13,084	27.03	353,660.52	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	6.81	70,394.97	
	ENBRIDGE INC	21,825	43.53	950,042.25	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	22.63	65,106.51	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	13.99	48,559.29	
	KEYERA CORP	2,259	24.35	55,006.65	
	PARKLAND CORP	1,790	40.53	72,548.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,181	35.29	218,127.49	
	SUNCOR ENERGY INC	16,785	22.57	378,837.45	
	TC ENERGY CORP	10,192	64.83	660,747.36	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,708	104.78	283,744.24	
	B2GOLD CORP	10,119	8.90	90,059.10	
	BARRICK GOLD CORP	19,312	35.79	691,176.48	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	50.18	83,951.14	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	12.10	51,872.70	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,082	195.62	407,280.84	

KINROSS GOLD CORP	10,281	11.57	118,951.17	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	66.13	207,714.33	
LUNDIN MINING CORP	7,300	7.70	56,210.00	
NUTRIEN LTD	6,406	50.93	326,257.58	
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	44.47	91,163.50	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,246	15.00	48,690.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,994	67.01	334,647.94	
YAMANA GOLD INC	9,288	7.80	72,446.40	
CAE INC	3,196	21.14	67,563.44	
WSP GLOBAL INC	1,340	86.79	116,298.60	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,068	82.50	88,110.00	
THOMSON REUTERS CORP	1,971	99.64	196,390.44	
AIR CANADA	840	16.85	14,154.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	7,691	135.90	1,045,206.90	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,489	389.28	579,637.92	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,272	69.72	228,123.84	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	26.00	46,800.00	
RESTAURANT BRANDS INTERN	3,265	72.11	235,439.15	
QUEBECOR INC -CL B	1,274	33.12	42,194.88	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	24.79	142,071.49	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	129.19	64,595.00	
DOLLARAMA INC	3,451	49.05	169,271.55	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,538	45.43	433,311.34	
EMPIRE CO LTD 'A'	864	35.77	30,905.28	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	70.79	149,650.06	
METRO INC	2,930	60.33	176,766.90	
WESTON (GEORGE) LTD	817	99.58	81,356.86	
SAPUTO INC	1,654	35.34	58,452.36	
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	23.14	75,829.78	
CANOPY GROWTH CORP	1,137	22.82	25,946.34	
CRONOS GROUP INC	1,000	7.49	7,490.00	
BANK OF MONTREAL	6,950	78.03	542,308.50	
BANK OF NOVA SCOTIA	13,091	57.68	755,088.88	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,853	97.17	471,566.01	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,743	66.41	248,572.63	

	ROYAL BANK OF CANADA	15,266	97.46	1,487,824.36	
	TORONTO-DOMINION BANK	19,449	63.43	1,233,650.07	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	14,601	44.59	651,058.59	
	CI FINANCIAL CORP	775	19.20	14,880.00	
	IGM FINANCIAL INC	81	33.15	2,685.15	
	ONEX CORPORATION	908	65.23	59,228.84	
	TMX GROUP LTD	540	136.50	73,710.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	414.27	135,052.02	
	GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	27.06	49,952.76	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,254	49.17	61,659.18	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,647	142.33	234,417.51	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	21,582	19.98	431,208.36	
	POWER CORP OF CANADA	4,873	26.11	127,234.03	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	6,585	56.71	373,435.35	
	BLACKBERRY LTD	1,407	6.37	8,962.59	
	CGI INC	2,689	91.65	246,446.85	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	221	1,518.58	335,606.18	
	OPEN TEXT CORP	3,074	57.79	177,646.46	
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,120	1,308.36	1,465,363.20	
	BCE INC	1,116	56.76	63,344.16	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,128	55.79	230,301.12	
	TELUS CORP	4,085	24.24	99,020.40	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	4,426	18.06	79,933.56	
	ALTAGAS LTD	2,930	18.00	52,740.00	
	ATCO LTD -CLASS I	863	40.59	35,029.17	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	32.89	32,462.43	
	EMERA INC	2,818	53.35	150,340.30	
	FORTIS INC	5,178	53.38	276,401.64	
	HYDRO ONE LTD	2,283	27.53	62,850.99	
カナダドル 小計		394,066		20,116,845.79 (1,616,187,390)	
ユーロ	ENI SPA	27,906	8.17	228,243.17	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	9.52	70,602.48	
	NESTE OYJ	4,759	41.25	196,308.75	
	OMV AG	1,475	28.66	42,273.50	

REPSOL SA	16,357	6.98	114,302.71	
TENARIS SA	5,062	5.16	26,119.92	
TOTAL SE	26,503	33.50	887,850.50	
VOPAK	762	47.42	36,134.04	
AIR LIQUIDE SA	5,102	139.95	714,024.90	
AKZO NOBEL	2,205	83.42	183,941.10	
ARCELORMITTAL	8,506	10.06	85,587.37	
ARKEMA	822	92.84	76,314.48	
BASF SE	10,010	50.37	504,203.70	
COVESTRO AG	1,223	37.30	45,617.90	
CRH PLC	8,512	33.28	283,279.36	
EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	24.86	44,573.98	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	37.72	2,112.32	
HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	51.64	71,366.48	
KONINKLIJKE DSM NV	1,888	130.55	246,478.40	
LANXESS AG	745	47.91	35,692.95	
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	30.38	69,448.68	
SOLVAY SA	925	73.50	67,987.50	
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	11.38	63,887.32	
SYMRISE AG	1,484	113.40	168,285.60	
THYSSENKRUPP AG	2,040	6.11	12,480.72	
UMICORE	2,388	38.76	92,558.88	
UPM-KYMMENE OYJ	6,116	23.05	140,973.80	
VOESTALPINE AG	712	20.96	14,923.52	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	21.27	61,151.25	
AIRBUS SE	6,372	72.11	459,484.92	
ALSTOM	2,236	47.70	106,657.20	
ANDRITZ AG	1,260	29.16	36,741.60	
BOUYGUES SA	1,779	32.74	58,244.46	
BRENNTAG AG	1,535	53.86	82,675.10	
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	6.52	62,603.52	
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,754	33.82	194,600.28	
DASSAULT AVIATION SA	11	797.00	8,767.00	
EIFFAGE	782	79.22	61,950.04	
FERROVIAL SA	5,381	22.58	121,502.98	

GEA GROUP AG	1,676	30.21	50,631.96	
HOCHTIEF AG	17	75.30	1,280.10	
KINGSPAN GROUP PLC	1,226	64.45	79,015.70	
KION GROUP AG	740	68.96	51,030.40	
KNORR-BREMSE AG	297	99.36	29,509.92	
KONE OYJ-B	3,785	70.58	267,145.30	
LEGRAND SA	2,956	69.90	206,624.40	
LEONARDO SPA	3,148	5.98	18,850.22	
MTU AERO ENGINES AG	622	150.85	93,828.70	
PRYSMIAN SPA	2,867	22.54	64,622.18	
SAFRAN SA	3,499	101.50	355,148.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,966	102.55	611,813.30	
SIEMENS AG-REG	8,245	115.86	955,265.70	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	22.54	51,706.76	
THALES SA	1,244	69.30	86,209.20	
VINCI SA	5,581	80.38	448,600.78	
WARTSILA OYJ ABP	2,705	7.16	19,384.03	
BUREAU VERITAS SA	2,067	19.17	39,634.72	
RANDSTAD NV	825	44.44	36,663.00	
TELEPERFORMANCE	652	259.80	169,389.60	
WOLTERS KLUWER	2,960	69.54	205,838.40	
ADP	314	88.00	27,632.00	
AENA SME SA	754	120.00	90,480.00	
ATLANTIA SPA	3,792	14.22	53,941.20	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	8.61	12,125.52	
DEUTSCHE POST AG-REG	10,833	37.73	408,729.09	
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	36.48	14,044.80	
GETLINK	4,655	13.21	61,492.55	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,692	57.92	213,840.64	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	45.50	28,164.50	
CONTINENTAL AG	1,275	93.00	118,575.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,370	42.16	395,039.20	
FAURECIA	800	36.93	29,544.00	
FERRARI NV	1,388	164.10	227,770.80	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,480	9.69	120,931.20	

MICHELIN (CGDE)	1,878	96.30	180,851.40	
PEUGEOT SA	5,130	15.09	77,437.35	
PIRELLI & C SPA	1,734	3.71	6,448.74	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	52.00	92,300.00	
RENAULT SA	1,817	24.44	44,407.48	
VALEO SA	2,418	25.30	61,175.40	
VOLKSWAGEN AG	194	150.00	29,100.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,047	138.36	283,222.92	
ADIDAS AG	2,090	266.20	556,358.00	
ESSILORLUXOTTICA	3,129	109.95	344,033.55	
HERMES INTERNATIONAL	353	702.00	247,806.00	
KERING	831	496.60	412,674.60	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,986	386.05	1,152,745.30	
MONCLER SPA	2,414	32.88	79,372.32	
PUMA SE	750	69.68	52,260.00	
SEB SA	151	145.20	21,925.20	
ACCOR SA	2,330	24.21	56,409.30	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,706	133.45	227,665.70	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	30.79	24,816.74	
SODEXO	1,088	63.70	69,305.60	
BOLLORE	3,240	3.11	10,076.40	
JC DECAUX SA	60	15.70	942.00	
PUBLICIS GROUPE	1,962	29.53	57,937.86	
SCOUT24 AG	1,002	78.25	78,406.50	
SES	2,232	6.27	14,012.49	
TELENET GROUP HOLDING NV	192	33.90	6,508.80	
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	69.08	75,642.60	
VIVENDI	9,266	23.94	221,828.04	
DELIVERY HERO SE	1,478	99.88	147,622.64	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,861	23.68	280,868.48	
JUST EAT TAKEAWAY	1,360	99.00	134,640.00	
PROSUS NV	5,265	79.36	417,830.40	
ZALANDO SE	1,415	66.06	93,474.90	
CARREFOUR SA	7,042	13.75	96,827.50	
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	24.35	15,218.75	

COLRUYT SA	290	52.04	15,091.60	
JERONIMO MARTINS	2,258	14.14	31,928.12	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	11,963	25.96	310,559.48	
METRO AG	1,970	8.45	16,662.26	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,347	47.77	398,736.19	
DANONE	6,690	56.12	375,442.80	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	3,500	8.57	29,998.50	
HEINEKEN HOLDING NV	1,282	69.40	88,970.80	
HEINEKEN NV	2,819	77.90	219,600.10	
KERRY GROUP PLC-A	1,722	109.10	187,870.20	
PERNOD RICARD SA	2,311	142.85	330,126.35	
REMY COINTREAU	264	134.00	35,376.00	
BEIERSDORF AG	1,128	95.80	108,062.40	
HENKEL AG & CO KGAA	966	74.30	71,773.80	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,965	85.96	168,911.40	
L'OREAL	2,682	278.50	746,937.00	
UNILEVER NV	15,554	49.50	769,923.00	
BIOMERIEUX	402	138.00	55,476.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	92.25	22,601.25	
DIASORIN SPA	256	156.10	39,961.60	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,391	72.76	173,969.16	
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,660	38.86	181,087.60	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,839	44.25	435,375.75	
ORPEA	501	107.25	53,732.25	
SARTORIUS AG-VORZUG	339	348.60	118,175.40	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	41.25	64,481.56	
BAYER AG-REG	10,613	56.91	603,985.83	
EUROFINS SCIENTIFIC	153	655.20	100,245.60	
GALAPAGOS NV	507	157.95	80,080.65	
GRIFOLS SA	3,329	24.50	81,560.50	
IPSEN	158	86.40	13,651.20	
MERCK KGAA	1,467	114.75	168,338.25	
ORION OYJ-CLASS B	739	39.11	28,902.29	
QIAGEN N.V.	2,679	42.86	114,821.94	
RECORDATI SPA	830	45.07	37,408.10	

SANOFI	12,084	85.46	1,032,698.64	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	285.40	85,049.20	
UCB SA	1,446	102.40	148,070.40	
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.23	31,323.38	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	72,029	2.52	182,017.28	
BANCO SANTANDER SA	178,371	1.92	343,756.59	
BANKINTER SA	2,829	4.69	13,270.83	
BNP PARIBAS	12,137	36.66	444,942.42	
CAIXABANK S.A	25,249	2.01	50,775.73	
COMMERZBANK AG	5,632	4.75	26,774.52	
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	8.78	89,250.92	
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	20.70	81,164.70	
FINECOBANK SPA	7,003	12.79	89,603.38	
ING GROEP NV-CVA	42,087	6.94	292,210.04	
INTESA SANPAOLO	162,128	1.85	300,196.20	
KBC GROEP NV	2,393	50.44	120,702.92	
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.13	48,917.83	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	15.90	19,334.40	
SOCIETE GENERALE SA	9,028	14.06	126,987.84	
UNICREDIT SPA	23,350	8.26	192,871.00	
AMUNDI SA	618	65.05	40,200.90	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22,388	8.06	180,648.77	
DEUTSCHE BOERSE AG	2,100	154.70	324,870.00	
EURAZEO	403	44.06	17,756.18	
EXOR NV	1,318	51.32	67,639.76	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,384	77.72	107,564.48	
NATIXIS	3,105	2.48	7,700.40	
SOFINA	168	243.00	40,824.00	
WENDEL	294	84.70	24,901.80	
AEGON NV	16,557	2.48	41,177.25	
AGEAS	1,697	37.86	64,248.42	
ALLIANZ SE-REG	4,511	181.96	820,821.56	
ASSICURAZIONI GENERALI	10,310	13.11	135,164.10	
AXA SA	21,127	17.55	370,821.10	
CNP ASSURANCES	1,015	11.42	11,591.30	

HANNOVER RUECK SE	718	142.90	102,602.20	
MAPFRE SA	942	1.64	1,544.88	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,592	234.60	373,483.20	
NN GROUP NV	2,804	31.86	89,335.44	
POSTE ITALIANE SPA	5,374	8.01	43,045.74	
SAMPO OYJ-A SHS	5,388	32.20	173,493.60	
SCOR SE	1,565	21.94	34,336.10	
AROUNDTOWN SA	10,475	5.09	53,317.75	
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,021	43.38	174,430.98	
LEG IMMOBILIEN AG	667	124.48	83,028.16	
VONOVIA SE	5,762	58.36	336,270.32	
ADYEN NV	195	1,415.50	276,022.50	
AMADEUS IT GROUP SA	4,673	46.30	216,359.90	
ATOS SE	1,004	71.76	72,047.04	
CAPGEMINI SA	1,778	111.35	197,980.30	
DASSAULT SYSTEMES SA	1,443	150.75	217,532.25	
EDENRED	2,756	43.34	119,445.04	
NEMETSCHEK SE	536	61.75	33,098.00	
NEXI SPA	3,732	14.81	55,270.92	
SAP SE	11,190	135.30	1,514,007.00	
TEAMVIEWER AG	1,207	44.10	53,228.70	
WORLDLINE SA	1,544	72.24	111,538.56	
INGENICO GROUP	708	134.85	95,473.80	
NOKIA OYJ	63,040	4.21	265,461.44	
ALTICE EUROPE NV	7,300	4.06	29,645.30	
CELLNEX TELECOM SA	3,335	53.50	178,422.50	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	36,498	15.27	557,324.46	
ELISA OYJ	1,241	50.74	62,968.34	
ILIAD SA	98	168.35	16,498.30	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	8.50	21,024.36	
KONINKLIJKE KPN NV	41,469	2.20	91,314.73	
ORANGE	22,373	9.90	221,626.93	
PROXIMUS	918	17.47	16,042.05	
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.37	27,268.28	
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.36	26,296.91	

	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.38	30,127.00	
	TELEFONICA SA	54,127	3.63	196,535.13	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	42.90	32,861.40	
	E.ON SE	24,963	9.99	249,480.22	
	EDF	6,102	8.90	54,320.00	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	23,881	4.35	103,906.23	
	ELIA GROUP SA/NV	345	91.00	31,395.00	
	ENAGAS SA	2,667	21.61	57,633.87	
	ENDESA SA	3,177	23.96	76,120.92	
	ENEL SPA	87,598	7.88	690,710.23	
	ENGIE	20,132	11.75	236,551.00	
	FORTUM OYJ	3,981	17.68	70,384.08	
	IBERDROLA SA	63,685	10.97	698,624.45	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	16.37	35,113.65	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.51	81,014.57	
	RWE AG	6,560	34.22	224,483.20	
	SNAM SPA	23,547	4.44	104,689.96	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	11.75	26,378.75	
	TERNA SPA	16,305	6.30	102,819.33	
	UNIPER SE	1,464	28.60	41,870.40	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,127	19.99	122,509.36	
	VERBUND AG	797	45.40	36,183.80	
	ASML HOLDING NV	4,536	314.00	1,424,304.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,665	21.80	297,897.00	
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	24.73	149,962.72	
ユーロ 小計		1,940,576		40,468,944.13 (5,107,180,749)	
英ポンド	BP PLC	217,822	2.92	637,456.08	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	44,346	11.71	519,469.04	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	40,202	11.31	454,845.42	
	ANGLO AMERICAN PLC	13,552	18.79	254,669.18	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	11.05	47,736.00	
	BHP GROUP PLC	23,014	18.16	417,934.24	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,494	59.54	88,952.76	
	EVRAZ PLC	3,072	3.46	10,629.12	

GLENCORE PLC	111,426	1.70	190,003.61	
JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	23.37	42,136.11	
MONDI PLC	5,627	15.29	86,036.83	
RIO TINTO PLC	12,131	47.05	570,824.20	
ASHTEAD GROUP PLC	4,156	26.90	111,796.40	
BAE SYSTEMS PLC	35,791	5.34	191,123.94	
BUNZL PLC	3,344	23.84	79,720.96	
DCC PLC	823	68.56	56,424.88	
FERGUSON PLC	2,523	71.00	179,133.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	1.02	45,787.45	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	22,239	2.57	57,176.46	
SMITHS GROUP PLC	3,824	14.20	54,319.92	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	106.65	90,439.20	
EXPERIAN PLC	9,883	27.74	274,154.42	
INTERTEK GROUP PLC	1,825	58.46	106,689.50	
RELX PLC	20,911	17.22	360,087.42	
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.29	110,606.96	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	5.11	62,035.27	
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	45.95	68,833.10	
BURBERRY GROUP PLC	3,298	13.99	46,155.51	
PERSIMMON PLC	3,796	25.34	96,190.64	
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.20	52,156.03	
COMPASS GROUP PLC	19,967	11.95	238,605.65	
GVC HOLDINGS PLC	6,950	7.69	53,501.10	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	41.48	69,271.60	
WHITBREAD PLC	1,474	24.44	36,024.56	
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.55	62,983.25	
INFORMA PLC	17,619	4.12	72,607.89	
ITV PLC	42,960	0.62	26,755.48	
PEARSON PLC	7,332	6.10	44,739.86	
WPP PLC	14,514	6.25	90,712.50	
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	6.93	34,392.64	
KINGFISHER PLC	12,732	2.68	34,147.22	
NEXT PLC	1,278	59.50	76,041.00	
OCADO GROUP PLC	4,239	23.31	98,811.09	

SAINSBURY (J) PLC	9,573	1.89	18,174.34	
TESCO PLC	107,991	2.28	246,219.48	
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.95	44,934.62	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	19.60	64,307.60	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	24,652	25.26	622,709.52	
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	21.09	38,721.24	
DIAGEO PLC	25,139	26.03	654,368.17	
IMPERIAL BRANDS PLC	10,573	12.74	134,752.88	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,596	74.38	564,990.48	
UNILEVER PLC	12,511	45.41	568,124.51	
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00	
SMITH & NEPHEW PLC	9,733	15.66	152,467.44	
ASTRAZENECA PLC	14,047	83.81	1,177,279.07	
GLAXOSMITHKLINE PLC	53,822	15.35	826,598.27	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	23.40	31,636.80	
BARCLAYS PLC	189,992	1.09	207,471.26	
HSBC HOLDINGS PLC	217,809	3.41	743,382.11	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	768,979	0.28	222,619.42	
NATWEST GROUP PLC	42,392	1.15	49,068.74	
STANDARD CHARTERED PLC	30,372	4.21	128,139.46	
3I GROUP PLC	8,862	9.22	81,778.53	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	17.70	54,318.94	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,469	86.36	299,582.84	
M&G PLC	21,579	1.79	38,777.46	
SCHRODERS PLC	1,161	30.25	35,120.25	
ST JAMES'S PLACE PLC	3,582	10.04	35,981.19	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	2.66	49,875.23	
ADMIRAL GROUP PLC	1,104	26.88	29,675.52	
AVIVA PLC	45,209	2.88	130,563.59	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	3.13	23,423.21	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	67,979	2.26	153,700.51	
PRUDENTIAL PLC	28,477	12.56	357,813.50	
RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	4.48	42,112.87	
AVEVA GROUP PLC	700	43.64	30,548.00	
SAGE GROUP PLC/THE	9,110	7.40	67,486.88	

	HALMA PLC	4,416	22.43	99,050.88	
	BT GROUP PLC	82,529	1.08	89,172.58	
	VODAFONE GROUP PLC	294,236	1.18	349,199.28	
	NATIONAL GRID PLC	38,223	8.91	340,872.71	
	SEVERN TRENT PLC	2,734	25.08	68,568.72	
	SSE PLC	11,557	13.02	150,472.14	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	8.94	70,076.24	
英ポンド 小計		3,088,056		15,396,253.97 (2,148,701,204)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	18.17	10,541.50	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	795.00	62,010.00	
	GIVAUDAN-REG	101	3,747.00	378,447.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	5,780	43.97	254,146.60	
	SIKA AG-REG	1,557	207.40	322,921.80	
	ABB LTD-REG	19,969	23.85	476,260.65	
	GEBERIT AG-REG	411	517.00	212,487.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	232.60	50,009.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	235.30	108,943.90	
	ADECCO SA-REG	1,516	47.25	71,631.00	
	SGS SA-REG	67	2,360.00	158,120.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	609	165.15	100,576.35	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5,752	59.90	344,544.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	198	202.60	40,114.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	38.50	9,663.50	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	21	1,947.00	40,887.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	7,560.00	60,480.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	80,500.00	80,500.00	
	NESTLE SA-REG	31,738	108.70	3,449,920.60	
	ALCON INC	5,350	55.82	298,637.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	614	216.20	132,746.80	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	922.80	107,044.80	
	LONZA GROUP AG-REG	806	555.40	447,652.40	
	NOVARTIS AG-REG	22,944	77.25	1,772,424.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7,497	310.70	2,329,317.90	
	VIFOR PHARMA AG	329	130.95	43,082.55	

	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	99.00	27,027.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	26,865	10.43	280,201.95	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,587	42.94	111,085.78	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	211	905.00	190,955.00	
	UBS GROUP AG-REG	39,921	11.21	447,714.01	
	BALOISE HOLDING AG - REG	344	144.40	49,673.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	353.70	130,161.60	
	SWISS RE AG	3,271	73.08	239,044.68	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,622	344.10	558,130.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	620	85.15	52,793.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	737	136.35	100,489.95	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,569	67.00	105,123.00	
	SWISSCOM AG-REG	301	505.00	152,005.00	
スイスフラン 小計		185,660		13,807,515.72 (1,617,964,692)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	224.10	246,285.90	
	BOLIDEN AB	1,948	243.80	474,922.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	6,034	109.15	658,611.10	
	ALFA LAVAL AB	2,277	222.30	506,177.10	
	ASSA ABLOY AB-B	11,374	195.35	2,221,910.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,490	392.60	2,940,574.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,771	341.60	1,288,173.60	
	EPIROC AB-A	5,706	127.90	729,797.40	
	EPIROC AB-B	4,649	123.20	572,756.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	189.40	277,281.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,084	234.80	724,123.20	
	SANDVIK AB	12,786	171.75	2,195,995.50	
	SKANSKA AB-B SHS	2,462	182.95	450,422.90	
	SKF AB-B SHARES	4,538	170.95	775,771.10	
	VOLVO AB-B SHS	16,718	159.25	2,662,341.50	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	129.30	495,606.90	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	178.50	273,462.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	85.96	243,868.52	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,225	607.20	743,820.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	143.80	1,379,185.80	

	ICA GRUPPEN AB	510	427.40	217,974.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	675.00	1,349,325.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,724	290.00	1,949,960.00	
	NORDEA BANK ABP	36,261	69.79	2,530,655.19	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,719	85.72	1,604,592.68	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,862	87.68	1,566,140.16	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,556	146.20	1,543,287.20	
	EQT AB	2,344	207.00	485,208.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	226.40	143,311.20	
	INVESTOR AB-B SHS	5,160	536.20	2,766,792.00	
	KINNEVIK AB - B	2,331	321.60	749,649.60	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	429.40	395,048.00	
	ERICSSON LM-B SHS	32,774	100.55	3,295,425.70	
	HEXAGON AB-B SHS	3,268	588.60	1,923,544.80	
	TELE2 AB-B SHS	3,777	123.25	465,515.25	
	TELIA CO AB	31,100	34.11	1,060,821.00	
スウェーデンクローナ 小計		279,356		41,908,338.00 (514,215,307)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	9,617	145.70	1,401,196.90	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	27.97	226,724.82	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	386.00	658,902.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	322.60	178,075.20	
	MOWI ASA	5,643	183.30	1,034,361.90	
	ORKLA ASA	6,749	88.96	600,391.04	
	DNB ASA	9,301	145.00	1,348,645.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	188.20	503,246.80	
	TELENOR ASA	9,278	147.00	1,363,866.00	
ノルウェークローネ 小計		53,627		7,315,409.66 (87,711,761)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	710.80	865,754.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,451	361.90	887,016.90	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,207	928.80	2,049,861.60	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	8,315.00	324,285.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	74	8,994.00	665,556.00	
	DSV PANALPINA A S	2,319	923.80	2,142,292.20	

	PANDORA A/S	1,082	450.00	486,900.00	
	CARLSBERG AS-B	1,203	881.20	1,060,083.60	
	AMBU A/S-B	1,526	214.00	326,564.00	
	COLOPLAST-B	1,315	1,030.00	1,354,450.00	
	DEMANT A/S	550	201.80	110,990.00	
	GN STORE NORD A/S	1,197	404.40	484,066.80	
	GENMAB A/S	717	2,307.00	1,654,119.00	
	H LUNDBECK A/S	120	221.90	26,628.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	18,959	415.25	7,872,724.75	
	DANSKE BANK A/S	6,042	104.05	628,670.10	
	TRYG A/S	694	192.10	133,317.40	
	ORSTED A/S	2,091	889.60	1,860,153.60	
デンマーククローネ 小計		43,804		22,933,433.35 (388,721,695)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	29.84	89,878.08	
	OIL SEARCH LTD	14,702	3.14	46,164.28	
	ORIGIN ENERGY LTD	14,373	5.83	83,794.59	
	SANTOS LTD	14,669	5.80	85,080.20	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	20.78	7,418.46	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	8,473	20.45	173,272.85	
	BHP GROUP LTD	31,786	40.01	1,271,757.86	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	12.07	75,509.92	
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	6.09	98,292.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	19,086	17.98	343,166.28	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	30.50	118,980.50	
	NEWCREST MINING LTD	9,074	34.16	309,967.84	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	14.24	105,048.48	
	ORICA LTD	2,575	18.26	47,019.50	
	RIO TINTO LTD	4,114	101.15	416,131.10	
	SOUTH32 LTD	38,772	2.19	84,910.68	
	CIMIC GROUP LTD	682	23.50	16,027.00	
	BRAMBLES LTD	17,428	11.07	192,927.96	
	(Right)SYDNEY AIRPORT-RIGHTS	2,335	0.73	1,704.55	
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	4.56	105,044.16	
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	3.68	32,016.00	

SYDNEY AIRPORT	12,027	5.31	63,863.37	
TRANSURBAN GROUP	30,019	13.77	413,361.63	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,885	28.28	194,707.80	
CROWN RESORTS LTD	773	9.53	7,366.69	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	3.59	76,226.47	
REA GROUP LTD	563	116.00	65,308.00	
SEEK LTD	3,309	19.55	64,690.95	
WESFARMERS LTD	12,403	47.61	590,506.83	
COLES GROUP LTD	15,036	19.12	287,488.32	
WOOLWORTHS GROUP LTD	13,807	40.27	556,007.89	
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	8.81	45,538.89	
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	12.84	90,522.00	
COCHLEAR LTD	742	199.77	148,229.34	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	67.67	96,159.07	
SONIC HEALTHCARE LTD	5,181	34.03	176,309.43	
CSL LTD	4,873	279.34	1,361,223.82	
AUST AND NZ BANKING GROUP	30,789	18.68	575,138.52	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	18,999	71.76	1,363,368.24	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	34,635	18.22	631,049.70	
WESTPAC BANKING CORP	39,063	18.04	704,696.52	
AMP LTD	36,656	1.56	57,183.36	
ASX LTD	2,263	85.43	193,328.09	
MACQUARIE GROUP LTD	3,726	126.18	470,146.68	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	65.36	101,765.52	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,356	5.10	98,715.60	
MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.86	96,147.48	
QBE INSURANCE GROUP LTD	17,256	10.98	189,470.88	
SUNCORP GROUP LTD	11,553	8.81	101,781.93	
LENDLEASE GROUP	8,292	11.52	95,523.84	
AFTERPAY LTD	2,039	75.80	154,556.20	
COMPUTERSHARE LTD	5,604	14.11	79,072.44	
WISETECH GLOBAL LTD	1,600	19.93	31,888.00	
TELSTRA CORP LTD	50,525	3.11	157,132.75	
TPG TELECOM LTD	287	7.45	2,138.15	
AGL ENERGY LTD	7,599	15.32	116,416.68	

	APA GROUP	13,816	11.29	155,982.64	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.83	2,636.89	
オーストラリアドル 小計		728,009		13,319,763.50 (1,019,894,291)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	6.20	50,294.40	
	A2 MILK CO LTD	7,857	20.95	164,604.15	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	34.30	227,614.80	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	12.39	68,219.34	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.92	112,751.64	
	MERCURY NZ LTD	7,200	4.78	34,416.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	4.59	43,155.18	
ニュージーランドドル 小計		67,630		701,055.51 (48,828,516)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	31,500	52.00	1,638,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	6.60	66,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	16,500	94.00	1,551,000.00	
	MTR CORP	19,500	40.35	786,825.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	26,000	58.95	1,532,700.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	32.90	1,019,900.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	9.77	19,540.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	14.80	76,960.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	27.80	611,600.00	
	WH GROUP LTD	91,500	6.85	626,775.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	17.76	63,936.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	22.50	990,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	124.90	1,124,100.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,200	368.40	4,862,880.00	
	AIA GROUP LTD	130,600	75.10	9,808,060.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	26,000	43.00	1,118,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	20.35	549,450.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	30.10	418,871.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	19.40	9,700.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	15,000	40.20	603,000.00	
	SINO LAND CO	18,000	9.55	171,900.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	15,700	99.25	1,558,225.00	

	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	40.90	171,780.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	19.52	97,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	32.80	754,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	11.62	383,460.00	
	PCCW LTD	4,000	4.92	19,680.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	41.55	182,820.00	
	CLP HOLDINGS LTD	16,000	76.00	1,216,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	8.15	252,650.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	104,874	11.20	1,174,588.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	44.35	798,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	89.05	142,480.00	
香港ドル 小計		816,790		34,401,181.40 (473,016,244)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	4.82	91,580.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.39	40,680.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,500	0.95	1,425.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	9,600	3.79	36,384.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.72	58,176.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	19.03	1,903.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.83	121,716.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	19,900	21.07	419,293.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	37,200	8.95	332,940.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	13,400	20.07	268,938.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	8.71	100,165.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	2.81	59,572.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	8.42	25,260.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.69	14,049.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	20.25	83,025.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	80,700	2.44	196,908.00	
シンガポールドル 小計		341,300		1,852,014.00 (144,031,128)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	4,122	12.49	51,483.78	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	482.00	183,642.00	
	BANK HAPOALIM BM	9,996	20.70	206,917.20	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	17.32	310,443.68	

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	10.42	78,347.98	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	68.90	97,424.60	
	AZRIELI GROUP	234	184.50	43,173.00	
	NICE SYSTEMS LTD	731	756.00	552,636.00	
イスラエルシュケル 小計		42,321		1,524,068.24 (47,703,335)	
合　計		11,078,843		46,219,640,881 (46,219,640,881)	

(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	66,943.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,379	234,733.38	
		AMERICAN TOWER CORP	4,757	1,189,820.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	120,512.97	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,572	240,594.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,674	144,683.82	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	97,703.44	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,493	739,682.59	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,875	440,795.00	
		DUKE REALTY CORP	4,194	158,910.66	
		EQUINIX INC	925	704,859.25	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	101,270.16	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,162	226,371.18	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	753	165,019.95	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,476	153,813.96	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	50,519.96	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,755	155,442.55	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	73,215.00	
		INVITATION HOMES INC	4,955	142,059.85	
		IRON MOUNTAIN INC	2,044	60,788.56	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	113,775.76	

	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,301	149,432.86	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	52,769.20	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	72,626.10	
	PROLOGIS INC	7,985	817,025.20	
	PUBLIC STORAGE	1,734	347,216.16	
	REALTY INCOME CORP	3,751	228,848.51	
	REGENCY CENTERS CORP	1,514	64,920.32	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,229	372,595.93	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,443	234,743.74	
	SUN COMMUNITIES INC	1,063	155,718.87	
	UDR INC	3,355	117,492.10	
	VENTAS INC	4,246	172,387.60	
	VEREIT INC	11,100	74,481.00	
	VICI PROPERTIES INC	5,335	122,331.55	
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	44,795.22	
	WELLTOWER INC	4,601	261,106.75	
	WEYERHAEUSER CO	8,460	239,925.60	
	WP CAREY INC	1,458	103,299.30	
	米ドル 小計	143,235	9,013,232.73 (960,359,947)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	44,450.50	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	27,374.40	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	23,745.60	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,097.10	
	カナダドル 小計	4,434	96,667.60 (7,766,274)	
ユーロ	COVIVIO	522	32,598.90	
	GECINA SA	569	65,093.60	
	ICADE	30	1,696.50	
	KLEPIERRE	1,289	19,695.92	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	51,320.36	
	ユーロ 小計	3,606	170,405.28 (21,505,146)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	21,014.63	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	37,893.60	
	SEGRO PLC	13,859	133,489.88	

	英ポンド 小計		26,244	192,398.11 (26,851,080)	
	オーストラリアドル	DEXUS	13,745	116,282.70	
		GOODMAN GROUP	18,868	347,359.88	
		GPT GROUP	15,542	59,059.60	
		MIRVAC GROUP	32,387	68,012.70	
		SCENTRE GROUP	51,996	108,151.68	
		STOCKLAND	29,890	104,316.10	
		VICINITY CENTRES	42,168	57,559.32	
	オーストラリアドル 小計		204,596	860,741.98 (65,907,013)	
	香港ドル	LINK REIT	24,600	1,541,190.00	
	香港ドル 小計		24,600	1,541,190.00 (21,191,362)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	142,072.00	
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	41,310.00	
		CAPITALAND MALL TRUST	22,000	41,360.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	43,930.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	81,620.00	
		SUNTEC REIT	8,500	11,645.00	
	シンガポールドル 小計		158,800	361,937.00 (28,147,840)	
合計				1,131,728,662 (1,131,728,662)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	589銘柄	97.2%	—	69.8%
	投資証券	39銘柄	—	2.8%	2.0%
カナダドル	株式	81銘柄	99.5%	—	3.4%
	投資証券	4銘柄	—	0.5%	0.0%

ユーロ	株式	239銘柄	99.6%	―	10.8%
	投資証券	5銘柄	―	0.4%	0.0%
英ポンド	株式	85銘柄	98.8%	―	4.5%
	投資証券	3銘柄	―	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%	―	3.4%
スウェーデンクローナ	株式	36銘柄	100.0%	―	1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%	―	0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%	―	0.8%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	93.9%	―	2.2%
	投資証券	7銘柄	―	6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%	―	0.1%
香港ドル	株式	33銘柄	95.7%	―	1.0%
	投資証券	1銘柄	―	4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	83.7%	―	0.3%
	投資証券	6銘柄	―	16.3%	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 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	2,143,615,725
コール・ローン	8,158,160
株式	6,809,961,144
投資証券	5,804,727
派生商品評価勘定	247,138,511

	2020年 8月17日現在
未収配当金	16,031,265
差入委託証拠金	500,115,866
流動資産合計	9,730,825,398
資産合計	9,730,825,398
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,540
未払金	1,086,227
未払解約金	2,611,000
未払利息	22
流動負債合計	3,706,789
負債合計	3,706,789
純資産の部	
元本等	
元本	7,304,542,992
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,422,575,617
元本等合計	9,727,118,609
純資産合計	9,727,118,609
負債純資産合計	9,730,825,398

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2020年 8月17日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	5,330,781,126円
期中追加設定元本額	2,824,074,999円
期中一部解約元本額	850,313,133円
期末元本額	7,304,542,992円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	477,932,450円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	993,313,573円
りそなラップ型ファンド（成長型）	988,757,853円
ＤＣりそな　グローバルバランス	9,609,812円
つみたてバランスファンド	299,912,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	247,497,615円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	122,838,568円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	74,383,397円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	4,832,871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	1,475,137円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	2,327,151円
リスクコントロール・オープン	5,218,762円
ＦＷりそな先進国＋新興国株式アクティブファンド	59,237,330円
ＦＷりそな新興国株式インデックスファンド	1,541,583,247円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	920,321,576円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	29,363,095円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	88,156,053円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	101,164,991円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	344,433,903円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	309,509,996円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	193,930,852円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	114,410,913円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	317,562,273円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	51,717,369円
グローバル９資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,024,053円
２．　計算日における受益権の総数	
	7,304,542,992口
３．　計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3317円
(10,000口当たり純資産額)	(13,317円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2020年 8月17日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	252,532,647
投資証券	△2,482,704
合計	250,049,943

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2020年 8月17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	2,666,742,457	―	2,913,876,125	247,133,668
合計		2,666,742,457	―	2,913,876,125	247,133,668

（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 8月17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	26,840,336	－	26,835,193	△5,143
	米ドル	16,118,378	－	16,117,993	△385
	香港ドル	10,721,958	－	10,717,200	△4,758
	売建	137,513	－	137,067	446
	オフショア人民元	137,513	－	137,067	446
合計		26,977,849	－	26,972,260	△4,697

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	62,002	5.23	324,766.47	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.70	5,781.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,306	72.34	311,496.04	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	987	160.70	158,610.90	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	13,717	5.27	72,288.59	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	5.20	76,565.55	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,578	50.00	128,900.00	

YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	5.72	10,868.00	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,090	13.22	27,629.80	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	7.16	22,554.00	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	6,724	28.47	191,432.28	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,251	21.82	27,296.82	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,201	12.76	15,324.76	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	723	119.70	86,543.10	
SEVERSTAL - GDR REG S	1,901	13.20	25,093.20	
SOUTHERN COPPER CORP	785	45.19	35,474.15	
51JOB INC-ADR	300	65.94	19,782.00	
BEST INC - ADR	1,500	4.32	6,480.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,900	33.67	131,313.00	
NIO INC - ADR	9,400	13.10	123,140.00	
GSX TECHEDU INC- ADR	800	89.20	71,360.00	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,400	38.87	54,418.00	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,450	135.63	196,663.50	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	3,900	73.58	286,962.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	3,650	54.51	198,961.50	
58.COM INC-ADR	960	55.66	53,433.60	
AUTOHOME INC-ADR	620	87.48	54,237.60	
BAIDU INC - SPON ADR	2,750	116.74	321,035.00	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,000	41.58	41,580.00	
HUYA INC-ADR	500	24.12	12,060.00	
IQIYI INC-ADR	2,300	19.26	44,298.00	
JOYY INC	620	80.58	49,959.60	
MOMO INC-SPON ADR	1,350	19.71	26,608.50	
NETEASE INC-ADR	782	461.39	360,806.98	
SINA CORP	630	39.60	24,948.00	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,800	14.40	54,720.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	630	32.68	20,588.40	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	18,930	253.97	4,807,652.10	
BAOZUN INC-SPN ADR	500	40.23	20,115.00	
JD.COM INC-ADR	8,620	62.06	534,957.20	
PINDUODUO INC-ADR	2,600	85.04	221,104.00	
TRIP.COM GROUP LTD	4,950	28.54	141,273.00	

	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,600	22.59	103,914.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,288	15.70	67,321.60	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,456	38.54	56,114.24	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	31.02	18,612.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	500	79.53	39,765.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	15,674	3.97	62,304.15	
	CREDICORP LTD	644	131.86	84,917.84	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	28,306	13.09	370,667.07	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.99	21,980.43	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	30.59	15,295.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.83	8,457.12	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	800	78.39	62,712.00	
	GLOBANT SA	340	174.87	59,455.80	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,500	9.52	52,360.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	8.01	6,968.70	
米ドル 小計		300,327		10,429,926.59 (1,111,308,678)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	142,300	7.50	1,067,250.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	32,300	59.25	1,913,775.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	364.16	500,720.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	7,800	36.58	285,324.00	
	ALFA S.A.B.-A	34,600	14.24	492,704.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	47.48	161,432.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,700	178.71	661,227.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,070	255.45	528,781.50	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	172.57	474,567.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	26,000	30.68	797,680.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	69.99	153,978.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	53,400	57.11	3,049,674.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	107.48	515,904.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	42.97	227,741.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	5,600	95.51	534,856.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	19,800	134.66	2,666,268.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,115	264.91	560,284.65	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,000	41.45	621,750.00	

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	37.17	613,305.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	26,700	82.15	2,193,405.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	17,800	17.18	305,804.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	341,600	14.24	4,864,384.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	69.15	428,730.00	
メキシコペソ 小計		773,310		23,619,544.65 (114,554,791)	
ブラジルレアル	COSAN SA	1,200	82.80	99,360.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	37,700	23.25	876,525.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	48,200	22.67	1,092,694.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,600	18.78	142,728.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	23.97	55,131.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	13.68	99,864.00	
	GERDAU SA-PREF	11,500	17.99	206,885.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,400	25.15	186,110.00	
	SUZANO SA	5,007	50.49	252,803.43	
	VALE SA	37,400	61.35	2,294,490.00	
	WEG SA	8,650	69.17	598,320.50	
	CCR SA	13,400	13.50	180,900.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	6,610	49.58	327,723.80	
	RUMO SA	10,100	22.81	230,381.00	
	COGNA EDUCACAO	18,400	7.19	132,296.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,100	113.60	238,560.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	9,200	34.24	315,008.00	
	LOJAS RENNER S.A.	8,100	41.61	337,041.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,400	81.76	605,024.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	7,000	21.09	147,630.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.19	60,570.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	65.62	111,554.00	
	RAIA DROGASIL SA	2,200	112.98	248,556.00	
	AMBEV SA	47,800	13.26	633,828.00	
	BRF SA	5,900	20.70	122,130.00	
	JBS SA	9,700	23.30	226,010.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,000	51.43	360,010.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,400	64.12	153,888.00	

	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	5,000	66.84	334,200.00	
	HYPERA SA	4,000	33.50	134,000.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	13,720	19.67	269,872.40	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	44,890	21.23	953,014.70	
	BANCO DO BRASIL S.A.	8,900	33.18	295,302.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	28.90	127,160.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	49,000	24.73	1,211,770.00	
	ITAUSA SA	45,100	9.93	447,843.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	21,200	60.57	1,284,084.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	82.60	214,760.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,300	27.04	197,392.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,200	7.77	40,404.00	
	PORTO SEGURO SA	700	56.96	39,872.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	3,100	47.60	147,560.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,000	10.25	61,500.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	22.67	49,874.00	
	CIELO SA	11,700	4.95	57,915.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,100	50.11	205,451.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,000	15.24	137,160.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,000	35.64	71,280.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,200	34.08	109,056.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,619	10.40	110,437.60	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	60.83	66,913.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,600	56.42	203,112.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	30.03	69,069.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	45.00	90,000.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	43.79	99,622.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,900	24.01	213,689.00	
ブラジルレアル 小計		620,371		17,578,333.68 (345,238,473)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,205	6,139.00	25,814,495.00	
	EMPRESAS CMPC SA	10,523	1,640.00	17,257,720.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,062	25,698.00	27,291,276.00	
	FALABELLA SA	6,932	2,816.10	19,521,205.20	
	CENCOSUD SA	13,424	1,351.50	18,142,536.00	

	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,569.00	9,662,215.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,780.20	5,073,570.00	
	BANCO DE CHILE	481,649	69.99	33,710,613.51	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	593	25,551.00	15,151,743.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	716,617	32.15	23,039,236.55	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,390.00	7,234,950.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,858	5,260.00	9,773,080.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	263.90	4,751,783.40	
	COLBUN SA	83,944	134.90	11,324,045.60	
	ENEL AMERICAS SA	362,665	113.60	41,198,744.00	
	ENEL CHILE SA	262,172	60.99	15,989,870.28	
チリペソ 小計		1,973,440		284,937,083.54 (38,039,100)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	49,667	2,200.00	109,267,400.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	25,140.00	63,905,880.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,580	25,060.00	114,774,800.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	20,500.00	53,054,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,890	20,400.00	99,756,000.00	
コロンビアペソ 小計		64,267		440,758,080.00 (12,385,302)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	11.54	9,047.36	
	OPAP SA	2,135	7.87	16,802.45	
	JUMBO SA	765	16.00	12,240.00	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,534	13.62	34,513.08	
ユーロ 小計		6,218		72,602.89 (9,162,484)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	917	78.75	72,213.75	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,119	8.56	137,978.64	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	17.27	136,605.70	
	KOC HOLDING AS	8,691	14.80	128,626.80	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	16.86	25,290.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	11.14	61,270.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	88.10	46,781.10	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,769	67.20	320,476.80	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	20.16	38,707.20	

	AKBANK T.A.S.	29,649	4.93	146,169.57	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	21,853	6.78	148,163.34	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	4.83	58,443.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.07	61,296.84	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	7.91	95,386.69	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,983	14.78	177,108.74	
トルコリラ 小計		165,113		1,654,518.17 (23,940,877)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	540.00	404,460.00	
	MONETA MONEY BANK AS	3,886	55.00	213,730.00	
	CEZ AS	1,547	476.50	737,145.50	
チェココルナ 小計		6,182		1,355,335.50 (6,559,823)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,029	1,770.00	5,361,330.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,497	7,200.00	10,778,400.00	
	OTP BANK PLC	2,319	11,070.00	25,671,330.00	
ハンガリーフォリント 小計		6,845		41,811,060.00 (15,231,769)	
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	682	48.28	32,926.96	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,810	55.58	156,179.80	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	19,031	5.32	101,244.92	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,355	132.00	178,860.00	
	LPP SA	14	7,455.00	104,370.00	
	CD PROJEKT SA	697	410.70	286,257.90	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	28.36	90,525.12	
	DINO POLSKA SA	528	229.60	121,228.80	
	BANK PEKAO SA	1,997	56.58	112,990.26	
	MBANK SA	165	207.60	34,254.00	
	PKO BANK POLSKI SA	9,155	23.20	212,396.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	159.80	42,347.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	5,729	28.40	162,703.60	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	7.62	35,806.38	
	PGE SA	9,929	6.84	67,934.21	
ポーランドズロチ 小計		60,248		1,740,024.95 (49,938,716)	

香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	6.35	76,200.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	250,000	3.48	870,000.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	35,500	12.86	456,530.00	
	CNOOC LTD	182,000	8.98	1,634,360.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.70	37,000.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	220,000	2.71	596,200.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	6.07	84,980.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	2.02	60,600.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	13,000	58.65	762,450.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	4.76	61,880.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	27,000	3.12	84,240.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	11.30	474,600.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	28,000	10.60	296,800.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.11	136,650.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	4.85	48,500.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	8.31	166,200.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	1.73	58,820.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	8.72	113,360.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	54,000	4.63	250,020.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	5.23	135,980.00	
	BOC AVIATION LTD	2,200	50.80	111,760.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	42,000	4.71	197,820.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	5.14	143,920.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	17,000	32.95	560,150.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	15.88	206,440.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	23,500	6.52	153,220.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	4.21	185,240.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	16,000	5.08	81,280.00	
	CITIC LTD	62,000	7.61	471,820.00	
	CRRC CORP LTD - H	51,000	3.56	181,560.00	
	FOSUN INTERNATIONAL LTD	24,500	9.25	226,625.00	
	HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	19.86	158,880.00	
	SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	2.44	48,800.00	
	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	11.86	47,440.00	
	SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	3.48	60,900.00	

SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	23.20	185,600.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	19,000	16.70	317,300.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	7.56	45,360.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	6,700	29.90	200,330.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	10,400	7.79	81,016.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	4,750	43.95	208,762.50	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	4.98	204,180.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	14,000	50.20	702,800.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	10.16	101,600.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	5.32	95,760.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.77	115,400.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	3.02	42,280.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	9.06	163,080.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	12,000	3.86	46,320.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	18,500	3.86	71,410.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	4.23	76,140.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	8.60	103,200.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	7.71	30,840.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	10,500	13.18	138,390.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	5.88	105,840.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	3.93	49,125.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.70	261,800.00	
BYD CO LTD-H	6,000	73.45	440,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	5.60	179,200.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	24.50	127,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	61,000	16.70	1,018,700.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	8.00	280,000.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	28,000	7.50	210,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	11,000	83.00	913,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	2.32	55,680.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	14,000	28.85	403,900.00	
LI NING CO LTD	22,000	31.55	694,100.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	8,500	108.10	918,850.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	17.58	105,480.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	4,000	15.54	62,160.00	

CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.63	91,560.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	8,000	43.45	347,600.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	33.45	83,625.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.13	158,200.00	
CHINA LITERATURE LTD	2,800	48.20	134,960.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	57,700	506.50	29,225,050.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	72,000	1.19	85,680.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	35,900	219.80	7,890,820.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	14.34	120,456.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	9.94	139,160.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	48.15	288,900.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	25,500	11.18	285,090.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	86.71	95,381.00	
CHINA FEIHE LTD	9,000	16.38	147,420.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	28,000	35.40	991,200.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	16,000	52.60	841,600.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	14,500	4.92	71,340.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	18,000	13.62	245,160.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	65.20	260,800.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	7.85	117,750.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	5.88	311,640.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	5,000	105.60	528,000.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	7,000	66.50	465,500.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	29.20	116,800.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	19.76	79,040.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	38,000	19.38	736,440.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	3,900	116.40	453,960.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	24,000	18.74	449,760.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,400	14.86	95,104.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	12,400	18.78	232,872.00	
3SBIO INC	13,000	9.39	122,070.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	192.80	115,680.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	9.34	149,440.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.51	49,610.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.74	89,760.00	

CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	58,000	15.44	895,520.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	15.42	154,200.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	6,000	33.15	198,900.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	10,000	50.40	504,000.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	4.79	83,825.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	34.40	206,400.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	107,250	9.16	982,410.00	
SSY GROUP LTD	10,000	4.60	46,000.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	2,324	112.00	260,288.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	9,500	161.40	1,533,300.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	285,000	2.76	786,600.00	
BANK OF CHINA LTD-H	806,000	2.62	2,111,720.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	92,000	4.30	395,600.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	96,000	3.43	329,280.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	971,000	5.80	5,631,800.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	24,000	3.00	72,000.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	40,000	39.45	1,578,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	54,100	4.97	268,877.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.27	58,860.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	615,000	4.69	2,884,350.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	104,000	4.29	446,160.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.59	166,950.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	12.40	99,200.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	41,000	4.78	195,980.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.90	92,700.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,600	18.28	248,608.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	21,000	18.36	385,560.00	
FAR EAST HORIZON LTD	17,000	6.27	106,590.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	9.47	147,732.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	12.98	98,648.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	30,400	7.41	225,264.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	13.98	243,252.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	76,000	19.16	1,456,160.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	28,800	24.65	709,920.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.88	48,400.00	

CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	17,800	14.12	251,336.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	9,000	33.50	301,500.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	92,000	2.63	241,960.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	72,000	6.40	460,800.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	60,000	83.10	4,986,000.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,600	43.10	155,160.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	10,000	10.06	100,600.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	9.66	135,240.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	20,000	22.40	448,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	56,000	5.28	295,680.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	39,500	23.65	934,175.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	7.82	117,300.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	32,000	34.40	1,100,800.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	17,900	26.00	465,400.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	30,000	6.84	205,200.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	79,000	10.26	810,540.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	15,200	9.73	147,896.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	18,000	4.00	72,000.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	14.64	204,960.00	
LOGAN GROUP CO LTD	14,000	13.70	191,800.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	18,500	38.30	708,550.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	78.50	94,200.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	7.60	182,400.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.60	62,400.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	13,000	31.85	414,050.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.17	32,760.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	1.96	45,080.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	2.63	31,560.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	26,000	36.70	954,200.00	
WHARF HOLDINGS LTD	14,000	14.52	203,280.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	52,000	1.45	75,400.00	
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	14,000	3.78	52,920.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.99	59,880.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	25,000	19.46	486,500.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	37.65	301,200.00	

	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	15.44	138,960.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	7,000	56.50	395,500.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,000	30.30	151,500.00	
	CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	3.36	50,400.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	5,000	22.95	114,750.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	8,000	8.22	65,760.00	
	LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	10.30	35,020.00	
	LENOVO GROUP LTD	66,000	4.68	308,880.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	7,400	145.40	1,075,960.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	107,200	15.34	1,644,448.00	
	ZTE CORP-H	8,800	22.40	197,120.00	
	CHINA MOBILE LTD	62,000	58.65	3,636,300.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	142,000	2.78	394,760.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	460,000	1.45	667,000.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	56,000	5.92	331,520.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	27.60	165,600.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.30	191,400.00	
	CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.68	184,800.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	27,400	23.50	643,900.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	38,000	5.32	202,160.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.47	86,730.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	10,000	37.00	370,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	20,000	10.04	200,800.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	8,300	95.15	789,745.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	32,000	13.28	424,960.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	30,000	3.27	98,100.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	38,000	6.44	244,720.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	29.60	148,000.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	34,000	27.50	935,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	42,000	9.07	380,940.00	
香港ドル 小計		9,004,224		116,872,870.50 (1,607,001,969)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	36,700	3.63	133,221.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	21.00	60,900.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	22,500	6.02	135,450.00	

PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	4.97	82,999.00	
GAMUDA BHD	21,000	3.42	71,820.00	
HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.69	66,044.00	
IJM CORP BHD	20,200	1.37	27,674.00	
SIME DARBY BERHAD	33,100	2.15	71,165.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.40	69,660.00	
MISC BHD	13,100	7.89	103,359.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.87	26,316.00	
GENTING BHD	23,100	3.95	91,245.00	
GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.41	78,566.00	
CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	23.20	23,200.00	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,000	32.00	32,000.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.93	29,790.00	
IOI CORP BHD	23,300	4.50	104,850.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,700	22.66	106,502.00	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	700	139.50	97,650.00	
PPB GROUP BERHAD	5,920	19.20	113,664.00	
QL RESOURCES BHD	7,100	9.68	68,728.00	
SIME DARBY PLANTATION BHD	22,400	5.11	114,464.00	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	17,700	16.02	283,554.00	
IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.40	130,140.00	
TOP GLOVE CORP BHD	16,100	23.82	383,502.00	
AMMB HOLDINGS BHD	12,700	3.03	38,481.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	67,500	3.55	239,625.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	14.74	106,128.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	12.84	23,112.00	
MALAYAN BANKING BHD	40,900	7.80	319,020.00	
PUBLIC BANK BERHAD	29,900	17.80	532,220.00	
RHB BANK BHD	18,100	4.94	89,414.00	
AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.18	96,672.00	
DIGI.COM BHD	28,400	4.16	118,144.00	
MAXIS BHD	21,600	5.12	110,592.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	3.78	30,618.00	
PETRONAS GAS BHD	7,500	16.26	121,950.00	
TENAGA NASIONAL BHD	24,300	11.12	270,216.00	

	YTL CORP BHD	19,380	0.71	13,856.70	
マレーシアリンギット 小計		694,000		4,616,511.70 (117,444,057)	
タイバーツ	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.52	347,004.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,000	92.00	1,380,000.00	
	PTT PCL-NVDR	117,400	37.75	4,431,850.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	42.25	557,700.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	25.25	416,625.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	25,000	49.25	1,231,250.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	8,100	364.00	2,948,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	45,100	54.00	2,435,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	9.20	823,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	75,200	10.60	797,120.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	3.88	241,336.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	35,100	20.10	705,510.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	29.75	613,593.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	64,600	15.30	988,380.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	8,800	37.00	325,600.00	
	CP ALL PCL-NVDR	60,100	65.75	3,951,575.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	41,700	33.00	1,376,100.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	40.75	264,875.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	14.00	338,800.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	100,800	20.90	2,106,720.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	3,300	114.50	377,850.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	106.00	434,600.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,300	89.00	1,183,700.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	9.90	247,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	72.25	715,275.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	1.00	215,000.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	24.50	448,350.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	29.75	243,950.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	50.50	383,800.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	46.50	418,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	20,800	46.50	967,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	7.80	751,920.00	

	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	12,500	191.50	2,393,750.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	57.50	1,058,000.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	3,100	36.75	113,925.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.32	282,532.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	48.25	458,375.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	2,800	233.00	652,400.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	46.00	823,400.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	68.25	498,225.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	20,500	32.50	666,250.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	3,200	58.25	186,400.00	
タイバーツ 小計		1,578,525		39,802,140.75 (136,123,321)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	50.25	1,173,840.00	
	AYALA CORPORATION	2,690	749.50	2,016,155.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	401.00	280,700.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	27,220	61.30	1,668,586.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,595	900.00	2,335,500.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	108.00	1,263,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	144.50	650,250.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	50.50	479,750.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,750	142.90	1,393,275.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	65.50	434,265.00	
	BDO UNIBANK INC	21,220	92.00	1,952,240.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	35.95	478,566.40	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.35	485,750.00	
	AYALA LAND INC	85,400	33.30	2,843,820.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	2.97	291,060.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	14.90	365,050.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,800	31.00	3,279,800.00	
	GLOBE TELECOM INC	250	2,136.00	534,000.00	
	PLDT INC	980	1,350.00	1,323,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	25.20	403,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,660	278.60	462,476.00	
フィリピンペソ 小計		610,767		24,114,883.40 (52,570,445)	

インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,115.00	168,253,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	12,700	23,075.00	293,052,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	254,100	915.00	232,501,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	9,700.00	260,930,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	11,950.00	158,935,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	9,500.00	305,900,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	208,300	5,375.00	1,119,612,500.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,600.00	80,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	78,300	6,250.00	489,375,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	3,300	52,500.00	173,250,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,735.00	158,058,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	17,300	10,175.00	176,027,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	7,325.00	353,065,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	78,700	8,200.00	645,340,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,625.00	368,062,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	100,000	32,025.00	3,202,500,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	191,200	6,025.00	1,151,980,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	78,800	5,000.00	394,000,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	563,900	3,340.00	1,883,426,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	508,200	3,030.00	1,539,846,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	2,550.00	71,400,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,230.00	161,745,000.00	
インドネシアルピア 小計		2,893,400		13,387,260,500.00 (97,727,001)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	35,950.00	17,615,500.00	
	S-OIL CORP	483	63,600.00	30,718,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	573	172,000.00	98,556,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,199	31,100.00	37,288,900.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	28,600.00	22,508,200.00	
	KOREA ZINC CO LTD	93	429,000.00	39,897,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	100,000.00	21,800,000.00	
	LG CHEM LTD	469	700,000.00	328,300,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	371,000.00	32,648,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	188	188,000.00	35,344,000.00	
	POSCO	761	210,500.00	160,190,500.00	

POSCO CHEMICAL CO LTD	161	93,100.00	14,989,100.00	
CJ CORP	193	89,200.00	17,215,600.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	313	87,200.00	27,293,600.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	1,310	3,525.00	4,617,750.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	25,650.00	13,184,100.00	
DOOSAN BOBCAT INC	580	29,150.00	16,907,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	439	27,700.00	12,160,300.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	36,000.00	31,248,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	262,000.00	28,820,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	540	24,900.00	13,446,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	393	95,900.00	37,688,700.00	
LG CORP	994	86,000.00	85,484,000.00	
LOTTE CORP	242	33,450.00	8,094,900.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	500	15,000.00	7,500,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	883	124,000.00	109,492,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	12,400.00	19,889,600.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,232	5,750.00	30,084,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	364	233,500.00	84,994,000.00	
S-1 CORPORATION	120	98,000.00	11,760,000.00	
CJ LOGISTICS	65	154,000.00	10,010,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	132,000.00	28,908,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	19,500.00	18,622,500.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	3,810.00	12,485,370.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	552	33,850.00	18,685,200.00	
HANON SYSTEMS	1,394	13,000.00	18,122,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	689	224,000.00	154,336,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,541	167,000.00	257,347,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	273	86,100.00	23,505,300.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	86,700.00	14,739,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,715	44,400.00	120,546,000.00	
COWAY CO LTD	531	82,400.00	43,754,400.00	
FILA HOLDINGS CORP	364	34,100.00	12,412,400.00	
HLB INC	411	89,400.00	36,743,400.00	
LG ELECTRONICS INC	1,102	88,700.00	97,747,400.00	
KANGWON LAND INC	869	23,250.00	20,204,250.00	

CHEIL WORLDWIDE INC	499	18,850.00	9,406,150.00	
KAKAO CORP	573	362,500.00	207,712,500.00	
NAVER CORP	1,247	305,000.00	380,335,000.00	
NCSOFT CORP	168	872,000.00	146,496,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	193	145,500.00	28,081,500.00	
PEARL ABYSS CORP	70	196,400.00	13,748,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	133,600.00	15,096,800.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	233	78,900.00	18,383,700.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	100	63,400.00	6,340,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	84,200.00	6,736,000.00	
SHINSEGAE INC	54	230,000.00	12,420,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	133,000.00	7,581,000.00	
E-MART INC	157	130,500.00	20,488,500.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	35,150.00	6,854,250.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	401,000.00	35,288,000.00	
KT&G CORP	1,195	88,100.00	105,279,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	158,000.00	39,658,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	593,000.00	7,709,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	302	196,500.00	59,343,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	209	59,700.00	12,477,300.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	96	1,565,000.00	150,240,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	782,000.00	11,730,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	708	104,200.00	73,773,600.00	
CELLTRION INC	956	304,500.00	291,102,000.00	
CELLTRION PHARM INC	150	112,700.00	16,905,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	46	306,500.00	14,099,000.00	
HELIXMITH CO LTD	165	58,000.00	9,570,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	169	800,000.00	135,200,000.00	
YUHAN CORP	514	64,000.00	32,896,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	5,470.00	13,921,150.00	
HANA FINANCIAL GROUP	3,100	30,800.00	95,480,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	8,700.00	22,541,700.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,037	39,800.00	160,672,600.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	4,683	32,700.00	153,134,100.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	5,693	9,100.00	51,806,300.00	

	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	317	63,800.00	20,224,600.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,580.00	8,294,860.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	9,150.00	27,422,550.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	9,520.00	14,660,800.00	
	SAMSUNG CARD CO	217	30,050.00	6,520,850.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	31,950.00	26,326,800.00	
	DB INSURANCE CO LTD	482	48,500.00	23,377,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	24,050.00	10,846,550.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	322	189,000.00	60,858,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	752	65,300.00	49,105,600.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	190	102,000.00	19,380,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	366	169,000.00	61,854,000.00	
	KMW CO LTD	187	74,200.00	13,875,400.00	
	LG DISPLAY CO LTD	2,534	13,700.00	34,715,800.00	
	LG INNOTEK CO LTD	153	163,500.00	25,015,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	584	138,000.00	80,592,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	48,081	58,000.00	2,788,698,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	8,329	50,600.00	421,447,400.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	564	444,000.00	250,416,000.00	
	LG UPLUS CORP	2,330	12,300.00	28,659,000.00	
	SK TELECOM	213	237,000.00	50,481,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,411	21,950.00	52,921,450.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	26,450.00	5,951,250.00	
	SK HYNIX INC	5,510	80,200.00	441,902,000.00	
韓国ウォン 小計		148,997		9,183,955,830.00 (826,556,024)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	10,000	83.00	830,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	41.50	913,000.00	
	CHINA STEEL CORP	120,000	20.20	2,424,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	36,000	71.50	2,574,000.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	39,000	80.80	3,151,200.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	52,000	63.30	3,291,600.00	
	TAIWAN CEMENT	49,477	42.85	2,120,089.45	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	667.00	667,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	25,000	26.25	656,250.00	

HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,174	318.50	692,419.00	
CHINA AIRLINES LTD	17,000	8.08	137,360.00	
EVA AIRWAYS CORP	26,023	11.20	291,457.60	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	13.55	427,502.50	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	33.95	746,900.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	15,000	38.65	579,750.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	386.50	780,730.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	196.00	666,400.00	
FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	30.55	305,500.00	
GIANT MANUFACTURING	3,000	304.00	912,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	349.50	699,000.00	
POU CHEN	24,000	27.70	664,800.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,000	645.00	1,935,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	276.00	1,656,000.00	
STANDARD FOODS CORP	3,120	62.50	195,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	49,000	68.30	3,346,700.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	53,616	18.40	986,534.40	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	179,000	19.35	3,463,650.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	114,906	26.95	3,096,716.70	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	105,627	21.65	2,286,824.55	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	87,416	18.80	1,643,420.80	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	110,000	30.05	3,305,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	102,995	11.00	1,132,945.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	87,769	13.15	1,154,162.35	
TAIWAN BUSINESS BANK	44,672	10.15	453,420.80	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	94,374	20.45	1,929,948.30	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	44.00	1,540,000.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,997	132.00	1,583,604.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	98,000	19.10	1,871,800.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	80,000	40.30	3,224,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	129,000	8.66	1,117,140.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	20.70	544,824.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	68,000	41.85	2,845,800.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	111,835	8.41	940,532.35	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	43.10	258,600.00	

RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	53.10	335,592.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	5,000	228.50	1,142,500.00	
ACER INC	22,000	23.05	507,100.00	
ADVANTECH CO LTD	3,299	301.50	994,648.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	7,000	245.00	1,715,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	9.85	847,100.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	206.00	1,442,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	88.00	441,320.00	
COMPAL ELECTRONICS	46,000	18.65	857,900.00	
DELTA ELECTRONICS INC	20,000	201.50	4,030,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	53.60	375,200.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	125,800	80.40	10,114,320.00	
INNOLUX CORP	90,000	8.22	739,800.00	
INVENTEC CORP	28,000	23.65	662,200.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,855.00	3,855,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	19,000	47.20	896,800.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	144.00	1,008,000.00	
PEGATRON CORP	18,000	66.70	1,200,600.00	
QUANTA COMPUTER INC	30,000	81.00	2,430,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	45.55	455,500.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	181.50	544,500.00	
WISTRON CORP	29,951	34.75	1,040,797.25	
WIWYNN CORP	1,000	782.00	782,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	17,960	40.55	728,278.00	
YAGEO CORPORATION	4,198	375.00	1,574,250.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	135.50	813,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	38,000	109.00	4,142,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	62.60	1,064,200.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	17,000	103.00	1,751,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	33,000	66.80	2,204,400.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	412.00	824,000.00	
MEDIATEK INC	15,000	680.00	10,200,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	55.10	661,200.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	6,000	285.00	1,710,000.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	285.50	285,500.00	

	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	91.30	547,800.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	406.50	2,032,500.00	
	SILERGY CORP	1,000	1,740.00	1,740,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	248,000	427.00	105,896,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	114,000	23.55	2,684,700.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	7,000	91.50	640,500.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	303.00	909,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	13.15	289,300.00	
新台湾ドル 小計		3,272,834		241,158,587.55 (872,994,086)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,798	413.25	2,809,273.50	
	COAL INDIA LTD	9,401	131.85	1,239,521.85	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,566	208.65	952,695.90	
	INDIAN OIL CORP LTD	14,264	84.80	1,209,587.20	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	77.10	2,042,379.00	
	PETRONET LNG LTD	4,527	259.95	1,176,793.65	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,830	2,113.80	60,940,854.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	220.75	1,708,605.00	
	ASIAN PAINTS LTD	3,027	1,802.55	5,456,318.85	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	550.35	1,452,373.65	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	628.95	2,032,766.40	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	12,818	184.95	2,370,689.10	
	JSW STEEL LTD	9,306	265.35	2,469,347.10	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,165	1,371.60	1,597,914.00	
	SHREE CEMENT LTD	83	21,458.25	1,781,034.75	
	TATA STEEL LTD	3,946	418.50	1,651,401.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,198	4,010.10	4,804,099.80	
	UPL LTD	5,324	485.65	2,585,600.60	
	VEDANTA LTD	19,986	122.65	2,451,282.90	
	HAVELLS INDIA LTD	2,780	611.00	1,698,580.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	4,499	982.80	4,421,617.20	
	SIEMENS LTD	766	1,211.90	928,315.40	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,572	348.10	1,591,513.20	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	379.60	592,935.20	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	699	1,139.15	796,265.85	

BAJAJ AUTO LTD	881	2,987.55	2,632,031.55	
BHARAT FORGE LTD	1,595	494.95	789,445.25	
BOSCH LTD	73	13,705.15	1,000,475.95	
EICHER MOTORS LTD	140	20,144.15	2,820,181.00	
HERO MOTOCORP LTD	1,024	2,803.80	2,871,091.20	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	7,702	614.45	4,732,493.90	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,249	6,588.20	8,228,661.80	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,207	120.00	864,840.00	
TATA MOTORS LTD	18,122	124.60	2,258,001.20	
PAGE INDUSTRIES LTD	54	18,948.25	1,023,205.50	
TITAN CO LTD	2,882	1,104.15	3,182,160.30	
JUBILANT FOODWORKS LTD	681	1,869.65	1,273,231.65	
INFO EDGE INDIA LTD	655	3,246.15	2,126,228.25	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	161.20	1,501,900.40	
AVENUE SUPERMARTS LTD	1,602	2,178.00	3,489,156.00	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	626	3,801.35	2,379,645.10	
ITC LTD	35,192	196.40	6,911,708.80	
NESTLE INDIA LTD	238	16,354.70	3,892,418.60	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	4,017	537.50	2,159,137.50	
UNITED SPIRITS LTD	3,058	584.15	1,786,330.70	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,411.15	987,805.00	
DABUR INDIA LTD	5,557	497.10	2,762,384.70	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,680	684.60	2,519,328.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	8,321	2,173.90	18,089,021.90	
MARICO LTD	4,834	366.30	1,770,694.20	
AUROBINDO PHARMA LTD	2,600	879.10	2,285,660.00	
BIOCON LTD	2,750	395.10	1,086,525.00	
CIPLA LTD	3,668	771.80	2,830,962.40	
DIVI'S LABORATORIES LTD	854	3,089.80	2,638,689.20	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,211	4,519.40	5,472,993.40	
LUPIN LTD	2,363	1,018.20	2,406,006.60	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	728	1,432.10	1,042,568.80	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	8,695	531.35	4,620,088.25	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,838.95	1,362,696.00	
AXIS BANK LTD	22,978	435.85	10,014,961.30	

	BANDHAN BANK LTD	7,394	288.20	2,130,950.80	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	16,605	1,791.70	29,751,178.50	
	ICICI BANK LTD	48,487	361.40	17,523,201.80	
	LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	264.15	614,677.05	
	STATE BANK OF INDIA	16,134	196.50	3,170,331.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	1,885	3,331.10	6,279,123.50	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	330	2,345.60	774,048.00	
	REC LTD	7,000	108.00	756,000.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	686.35	448,872.90	
	BAJAJ FINSERV LTD	402	6,246.70	2,511,173.40	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	6,678	587.75	3,924,994.50	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,977	1,309.75	2,589,375.75	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	458.95	1,710,506.65	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,755	839.30	3,151,571.50	
	DLF LTD	4,542	142.45	647,007.90	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,236	709.10	7,967,447.60	
	INFOSYS LTD	34,508	953.60	32,906,828.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	9,183	2,242.15	20,589,663.45	
	TECH MAHINDRA LTD	4,862	695.90	3,383,465.80	
	WIPRO LTD	11,992	276.50	3,315,788.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	24,902	528.60	13,163,197.20	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	199.25	478,200.00	
	GAIL INDIA LTD	17,471	95.95	1,676,342.45	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	2,160	387.90	837,864.00	
	NTPC LTD	25,698	88.40	2,271,703.20	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	17,317	175.40	3,037,401.80	
インドルピー 小計		629,578		392,185,410.05 (560,825,136)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	3,800	16.91	64,258.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.15	104,490.00	
	INDUSTRIES QATAR	17,213	8.90	153,195.70	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	4.01	87,257.60	
	MASRAF AL RAYAN	33,102	4.01	132,739.02	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	5,838	8.45	49,331.10	
	QATAR ISLAMIC BANK	12,416	16.09	199,773.44	

	QATAR NATIONAL BANK	46,167	18.22	841,162.74	
	BARWA REAL ESTATE CO	14,730	3.30	48,638.46	
	OOREDOO QPSC	5,987	6.59	39,460.31	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,015	17.15	103,157.25	
カタールリアル 小計		215,628		1,823,463.62 (53,190,433)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	140.18	392,504.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	500	1,341.19	670,595.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	4,253	495.55	2,107,574.15	
	GOLD FIELDS LTD	9,048	213.93	1,935,638.64	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,260	170.47	1,408,082.20	
	KUMBA IRON ORE LTD	703	573.69	403,304.07	
	NORTHAM PLATINUM LTD	3,813	154.00	587,202.00	
	SASOL LTD	5,312	146.52	778,314.24	
	SIBANYE STILLWATER LTD	23,563	54.62	1,287,011.06	
	BIDVEST GROUP LTD	2,876	142.29	409,226.04	
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,613	104.70	482,981.10	
	MR PRICE GROUP LTD	2,802	123.55	346,187.10	
	NASPERS LTD-N SHS	4,489	3,008.40	13,504,707.60	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	10.75	106,973.25	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	7,365	33.87	249,452.55	
	BID CORP LTD	3,419	284.94	974,209.86	
	CLICKS GROUP LTD	2,589	248.50	643,366.50	
	PICK N PAY STORES LTD	2,743	45.02	123,489.86	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,619	119.21	550,630.99	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	1,441	171.61	247,290.01	
	TIGER BRANDS LTD	1,150	179.12	205,988.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	17.80	227,181.40	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,574	135.00	482,490.00	
	ABSA GROUP LTD	7,463	76.50	570,919.50	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	486	880.82	428,078.52	
	NEDBANK GROUP LTD	3,923	103.43	405,755.89	
	STANDARD BANK GROUP LTD	13,209	106.23	1,403,192.07	
	FIRSTRAND LTD	49,293	37.99	1,872,641.07	
	PSG GROUP LTD	1,806	160.64	290,115.84	

	REINET INVESTMENTS SCA	1,613	312.34	503,804.42	
	REMGRO LTD	5,030	91.19	458,685.70	
	DISCOVERY LTD	4,144	119.94	497,031.36	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	16.14	162,723.48	
	OLD MUTUAL LTD	48,784	12.94	631,264.96	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,580	32.75	182,745.00	
	SANLAM LTD	19,161	60.15	1,152,534.15	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,106	90.15	370,155.90	
	MTN GROUP LTD	17,388	69.03	1,200,293.64	
	VODACOM GROUP LTD	6,615	135.58	896,861.70	
南アフリカランド 小計		321,329		39,151,202.82 (239,996,873)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	28,809	5.16	148,654.44	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	3.95	80,738.00	
	EMIRATES NBD PJSC	11,600	10.05	116,580.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	27,831	11.20	311,707.20	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	29,017	1.85	53,681.45	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.40	42,943.60	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	36,755	2.80	102,914.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	17,750	16.70	296,425.00	
アラブディルハム 小計		202,876		1,153,643.69 (33,524,885)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.42	12,840.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.02	47,436.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	15.63	23,445.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.94	3,234.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.91	2,455.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.48	22,848.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	7.78	19,450.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.30	1,890.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.41	23,717.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	520	4.13	2,147.60	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	33.29	29,961.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.13	9,047.83	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.25	6,825.00	

ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.75	2,145.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	59.45	166,460.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	4.95	39,600.00	
BBMG CORPORATION-A	900	3.26	2,934.00	
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	53.15	63,780.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	12.84	37,236.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.35	29,580.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	13.47	6,735.00	
GEM CO LTD-A	3,500	5.60	19,600.00	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	6.75	9,450.00	
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	58.30	29,150.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	18.85	68,237.00	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.33	20,143.50	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.23	3,345.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	27.70	30,470.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.40	15,400.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.19	21,301.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	8.37	29,295.00	
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	11.89	22,591.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	93.75	28,125.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	15.10	4,530.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	54.70	10,940.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.46	2,584.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	23.86	40,562.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.92	2,044.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.24	16,128.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	19.35	65,790.00	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	7.10	14,910.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,120	39.21	43,915.20	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	25.91	36,274.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.37	23,700.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	36.74	29,392.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	12.64	27,808.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	106.84	32,052.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.79	18,192.00	

SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.60	2,160.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	18.28	20,108.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	25.59	5,118.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	15.14	22,710.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.28	3,420.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.76	7,488.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	67.48	155,204.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	82.31	32,924.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	15.30	18,360.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	16.09	27,353.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	80.29	48,174.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	42.11	10,948.60	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	7.18	16,514.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	15.32	6,128.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	10.20	4,080.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	8,800	5.78	50,864.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	24.14	24,140.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	49.81	69,734.00	
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	26.11	10,444.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	11.19	33,570.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	66.15	6,615.00	
AVICOPTER PLC-A	500	63.49	31,745.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	30.78	43,092.00	
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	2.99	29,900.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.95	18,285.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	20.50	2,050.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	8.26	2,478.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.53	3,265.00	
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	16.01	14,409.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.81	2,905.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	7,400	9.11	67,414.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.58	51,336.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	10,300	5.06	52,118.00	
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	36.11	3,611.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.30	157,940.00	

CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,300	200.37	260,481.00	
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.17	3,255.00	
CRRC CORP LTD-A	18,500	5.92	109,520.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	10.06	6,036.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	52.24	79,404.80	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	7.04	2,935.68	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	26.92	26,920.00	
GUOCHENG MINING CO LTD-A	900	22.90	20,610.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	55.29	33,174.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	50.10	15,030.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	12.66	17,724.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	60.64	62,823.04	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	11.26	29,276.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.90	5,220.00	
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	900	23.77	21,393.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	21.18	74,956.02	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	4.15	16,600.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	20.40	126,480.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.19	17,864.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.87	4,696.00	
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	6.20	1,860.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	55.13	38,591.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	15.45	20,085.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	26.03	33,839.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	11.88	4,752.00	
TBEA CO LTD-A	400	8.68	3,472.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	2,700	15.92	42,984.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	6.35	6,985.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	9.65	2,895.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.71	4,684.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	31.15	6,230.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	94.35	39,627.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	22.49	67,245.10	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	14.71	19,123.00	
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	14.95	2,990.00	

ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	8.09	7,281.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	9.27	24,102.00	
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	24.61	34,454.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	64.63	51,704.00	
AIR CHINA LTD-A	800	7.27	5,816.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.88	6,344.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.76	52,416.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	5.21	6,252.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.64	73,704.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	15.04	12,032.00	
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	10.50	7,350.00	
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.99	21,945.00	
S F HOLDING CO LTD-A	1,800	66.20	119,160.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	75.15	22,545.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.52	4,520.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	10.20	19,380.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.50	7,000.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	44.46	4,446.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	23.34	27,307.80	
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	6.90	22,080.00	
BYD CO LTD -A	800	81.93	65,544.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	157.16	31,432.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	11.45	5,725.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	28.54	5,708.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	23.32	32,648.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	24.38	29,256.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	44.50	35,600.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	3,510	18.45	64,759.50	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	25.18	2,518.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	22.95	2,295.00	
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	7.40	14,800.00	
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	56.25	78,750.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,800	22.30	62,440.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	41.65	4,165.00	
JOYOUNG CO LTD -A	600	39.45	23,670.00	

NAVINFO CO LTD-A	900	18.35	16,515.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	105.91	14,827.40	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	24.91	9,964.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	6.29	38,998.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	54.60	16,380.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.43	2,972.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	84.60	25,380.00	
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	19.21	15,368.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	36.60	36,600.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	45.55	27,330.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.42	8,162.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	16.01	17,290.80	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	14.93	19,409.00	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	24.90	19,920.00	
CHINA FILM CO LTD-A	200	14.89	2,978.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	11.11	2,222.00	
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.78	1,278.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	6.12	74,052.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	602.43	60,243.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	20.53	4,106.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.30	13,530.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	63.92	83,735.20	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	19.62	21,582.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	10.20	3,060.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	35.93	48,505.50	
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	18.75	16,875.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	42.91	38,619.00	
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	20.93	8,372.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	10.64	31,920.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,300	207.25	269,425.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	27.48	5,496.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.83	49,150.00	
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	10.43	34,419.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.68	28,080.00	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	98.25	19,650.00	

YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	87.80	36,876.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	9.12	28,272.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	66.00	46,200.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	219.22	65,766.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	48.88	24,440.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	11.77	5,885.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	66.78	40,068.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	7.30	17,520.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	65.30	26,120.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	69.45	27,780.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	38.35	26,845.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,800	155.00	279,000.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	26.85	24,165.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	68.95	89,635.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	20.27	50,675.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	51.90	62,280.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	35.24	148,008.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	49.11	49,110.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,000	130.83	130,830.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	23.38	46,760.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	72.99	21,897.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	86.26	25,878.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	800	1,661.00	1,328,800.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	117.59	117,590.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,040	92.28	188,251.20	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	34.96	90,896.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	400	166.90	66,760.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	64.70	25,880.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	500	59.89	29,945.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,300	23.47	77,451.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	74.90	7,490.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	2,760	23.78	65,632.80	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,400	212.90	510,960.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	23.01	25,311.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	24.34	31,642.00	

C&S PAPER CO LTD-A	1,000	25.69	25,690.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	178.50	17,850.00	
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	41.70	25,020.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	2,221	44.95	99,833.95	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	146.37	14,637.00	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	50.25	10,050.00	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	41.51	16,604.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	84.46	16,892.00	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	300	89.78	26,934.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	26.63	6,391.20	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	69.34	26,349.20	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	33.65	16,825.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	17.70	3,540.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	38.80	27,160.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	15.87	7,617.60	
OVCTEK CHINA INC-A	300	58.25	17,475.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	22.59	4,518.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	315.72	221,004.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	186.00	18,600.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	21.41	22,266.40	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	23.32	20,988.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	227.92	45,584.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,080	46.33	50,036.40	
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	30.45	6,090.00	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	131.20	39,360.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	149.27	44,781.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	200	452.51	90,502.00	
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	43.85	26,310.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	29.52	2,952.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	900	145.00	130,500.00	
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	42.15	25,290.00	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	39.73	3,973.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	34.51	6,902.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	100.48	30,144.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	54.85	42,783.00	

HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	24.24	16,968.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	2,980	89.50	266,710.00	
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	17.11	17,110.00	
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	29.43	26,487.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	18.30	29,280.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	52.15	26,075.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	53.30	34,645.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	26.21	6,814.60	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	58.20	69,840.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	9.42	27,318.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	26.48	23,832.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	199.64	59,892.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	32.35	3,235.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	29.20	29,200.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	22.39	4,478.00	
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	5.41	11,902.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	13.91	2,782.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	73.52	44,112.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	1,440	107.88	155,347.20	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	28.49	28,490.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	103.86	51,930.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	300	198.39	59,517.00	
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.72	12,584.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	37.29	45,120.90	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	30.05	53,489.00	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	63.17	25,268.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.25	163,475.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	4.90	36,750.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	10.07	15,105.00	
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.35	54,605.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.79	130,288.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	11.64	5,820.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	6.44	20,608.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	8.60	20,640.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	33.56	114,104.00	

BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.53	75,149.30	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.28	3,168.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.23	18,690.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	18,400	3.93	72,312.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	13,000	38.00	494,000.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	16,400	5.63	92,332.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.44	28,336.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	5.02	181,724.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	16.10	220,570.00	
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	14.47	189,557.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	10.59	205,446.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	5.16	4,644.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	15.45	23,175.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	8.43	6,744.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	13.10	36,680.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,600	20.49	53,274.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,900	31.37	216,453.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	1,300	54.35	70,655.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	13.37	2,674.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,920	25.33	149,953.60	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	22.42	71,744.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	11.00	5,500.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.73	62,856.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	15.66	42,282.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	13.81	8,286.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,500	19.00	66,500.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	10.32	5,160.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	3,700	15.39	56,943.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	141.84	28,368.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	8.36	3,344.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	20.92	115,060.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	12.75	3,825.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	8.11	5,677.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	15.55	24,880.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	10.54	31,620.00	

ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	11.86	61,672.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	4.19	13,408.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	14.71	8,826.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.45	13,625.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	8.17	3,268.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	5.68	86,336.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	14.06	4,218.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	10.36	3,108.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.59	21,242.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	6.99	30,057.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.67	4,835.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	15.47	20,111.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,200	42.83	51,396.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	32.03	140,932.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.88	3,528.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	62.50	56,250.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	7.39	25,865.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	6,800	78.19	531,692.00	
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	6.88	15,136.00	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.25	14,450.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	17.60	25,168.00	
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	33.75	23,625.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	17.32	62,352.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	6,500	27.68	179,920.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.99	2,796.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	35.10	28,080.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	15.65	51,645.00	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	5.67	15,309.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	8.93	10,716.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	10.19	31,589.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	10.34	7,238.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	4.19	5,028.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	17.02	141,266.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	8.47	5,082.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	21.67	19,503.00	

SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	5.46	13,650.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.37	4,044.00	
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	7.30	24,820.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.94	21,514.00	
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	3.62	18,462.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	18.98	5,694.00	
AISINO CORP-A	200	17.75	3,550.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	400	47.15	18,860.00	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	32.93	3,293.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	25.86	18,102.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	103.65	20,730.00	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	22.46	15,722.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	12.15	4,860.00	
GLODON CO LTD-A	500	66.45	33,225.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	103.10	71,035.90	
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	38.45	38,450.00	
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	17.14	8,570.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	217.58	21,758.00	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	3.04	2,371.20	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	67.82	27,128.00	
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	20.00	8,000.00	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	90.71	27,213.00	
VENUSTECH GROUP INC-A	400	40.85	16,340.00	
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	8.82	7,938.00	
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	900	24.69	22,221.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	44.96	103,767.68	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	31.59	18,954.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	46.17	41,553.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	4.94	101,270.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	28.32	19,824.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	19.30	50,180.00	
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	44.34	49,660.80	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	27.74	30,514.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	15.03	57,114.00	
GOERTEK INC -A	2,000	40.70	81,400.00	

GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	14.80	32,560.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	11.54	28,850.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	14.30	4,290.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	100.33	50,165.00	
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	5,500	39.84	219,120.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	16.59	3,318.00	
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	5.28	14,784.00	
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	13.93	12,537.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	36.30	21,780.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	30.10	39,130.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.83	15,709.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	4,133	53.80	222,355.40	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	208.00	41,600.00	
NINESTAR CORP-A	100	39.12	3,912.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	19.06	7,624.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	28.01	28,010.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	145.56	40,756.80	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	25.23	25,230.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	58.89	53,001.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	27.16	19,012.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	53.93	37,751.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	16.98	5,094.00	
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	3.07	2,456.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,340	42.95	57,553.00	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	24.56	31,928.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	22.67	18,136.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	136.40	95,480.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	38.00	51,680.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	23.37	37,392.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	49.54	19,816.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	64.14	19,242.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	23.95	57,480.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	56.47	28,235.00	
ZTE CORP-A	2,700	38.37	103,599.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	5.32	73,416.00	

	CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	5.15	12,875.00	
	CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.54	19,522.00	
	CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	12,400	18.21	225,804.00	
	GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.11	5,908.00	
	HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.81	4,953.00	
	HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.83	3,864.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.85	2,310.00	
	INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.66	13,034.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.82	9,702.00	
	SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.83	17,226.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.86	4,102.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.61	3,366.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.91	6,937.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	5.16	22,188.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	212.10	29,694.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	18.30	36,600.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	56.35	146,510.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	28.43	45,488.00	
	SG MICRO CORP-A	100	346.00	34,600.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	206.15	51,537.50	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	23.46	53,958.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	15.90	30,210.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	26.22	20,976.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	137.50	68,750.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	14.66	16,126.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	400	186.28	74,512.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	11.55	17,325.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	25.28	22,752.00	
オフショア人民元 小計		1,101,144		20,239,991.20 (310,886,264)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	13.22	21,508.94	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	12,204	33.35	407,003.40	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	54.90	64,452.60	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	11.28	42,660.96	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	15.32	53,620.00	

	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	2,161	84.90	183,468.90	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	4,523	38.25	173,004.75	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	9,130	89.20	814,396.00	
	SAUDI CEMENT	565	55.60	31,414.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	1,544	20.28	31,312.32	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	8.73	71,044.74	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,789	54.50	152,000.50	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	82.40	34,772.80	
	JARIR MARKETING CO	611	167.00	102,037.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	117.80	47,826.80	
	ALMARAI CO	2,209	53.60	118,402.40	
	SAVOLA	2,712	48.65	131,938.80	
	AL RAJHI BANK	12,412	63.80	791,885.60	
	ALINMA BANK	8,696	15.34	133,396.64	
	ARAB NATIONAL BANK	6,307	20.28	127,905.96	
	BANK AL-JAZIRA	3,069	12.76	39,160.44	
	BANK ALBILAD	3,925	24.90	97,732.50	
	BANQUE SAUDI FRANSI	6,113	33.85	206,925.05	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	14,926	37.60	561,217.60	
	RIYAD BANK	13,885	17.92	248,819.20	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	10,048	27.10	272,300.80	
	SAUDI BRITISH BANK	6,357	24.48	155,619.36	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	536	123.20	66,035.20	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	83.70	55,325.70	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	7.91	31,181.22	
	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	7.79	33,458.05	
	ETIHAD ETISALAT CO	3,984	27.10	107,966.40	
	SAUDI TELECOM CO	6,089	96.40	586,979.60	
	SAUDI ELECTRICITY CO	9,159	15.70	143,796.30	
サウジアラビアリアル 小計		171,901		6,140,570.53 (174,760,637)	
合　計		24,821,524		6,809,961,144 (6,809,961,144)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	34,100	648,582.00	
		メキシコペソ 小計	34,100	648,582.00 (3,145,622)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	31,594	433,785.62	
		南アフリカランド 小計	31,594	433,785.62 (2,659,105)	
合計				5,804,727 (5,804,727)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	57銘柄	100.0%	—	16.3%
メキシコペソ	株式	23銘柄	97.3%	—	1.7%
	投資証券	1銘柄	—	2.7%	0.0%
ブラジルレアル	株式	56銘柄	100.0%	—	5.1%
チリペソ	株式	16銘柄	100.0%	—	0.6%
コロンビアペソ	株式	5銘柄	100.0%	—	0.2%
ユーロ	株式	4銘柄	100.0%	—	0.1%
トルコリラ	株式	15銘柄	100.0%	—	0.4%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式	15銘柄	100.0%	—	0.7%
香港ドル	株式	205銘柄	100.0%	—	23.6%
マレーシアリンギット	株式	39銘柄	100.0%	—	1.7%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%	—	2.0%
フィリピンペソ	株式	21銘柄	100.0%	—	0.8%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%	—	1.4%

韓国ウォン	株式	105銘柄	100.0%	—	12.1%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%	—	12.8%
インドルピー	株式	86銘柄	100.0%	—	8.2%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%	—	0.8%
南アフリカランド	株式	39銘柄	98.9%	—	3.5%
	投資証券	1銘柄	—	1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式	8銘柄	100.0%	—	0.5%
オフショア人民元	株式	461銘柄	100.0%	—	4.6%
サウジアラビアリアル	株式	34銘柄	100.0%	—	2.6%

（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 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	18,006,169
コール・ローン	33,567,984
投資信託受益証券	4,914,823,103
流動資産合計	4,966,397,256
資産合計	4,966,397,256
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,474,000
未払利息	91
流動負債合計	1,474,091
負債合計	1,474,091
純資産の部	
元本等	
元本	4,774,608,043
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	190,315,122

	2020年 8月17日現在
元本等合計	4,964,923,165
純資産合計	4,964,923,165
負債純資産合計	4,966,397,256

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 8月17日現在	
1.　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	3,709,933,148円
期中追加設定元本額	1,680,862,791円
期中一部解約元本額	616,187,896円
期末元本額	4,774,608,043円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	598,543,508円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	437,252,032円
りそなラップ型ファンド（成長型）	233,270,305円
ＤＣりそな　グローバルバランス	11,920,884円
つみたてバランスファンド	382,346,596円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	160,619,688円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	77,644,922円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	47,738,681円

りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	3,041,258円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,567,995円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	963,601円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	1,556,383円
リスクコントロール・オープン	1,669,251円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	76,142,670円
ＦＷりそな新興国債券インデックスファンド	1,735,991,728円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	24,627,412円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	62,853,772円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	64,195,452円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	220,331,718円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	197,267,710円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	123,639,844円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	72,921,967円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	203,513,683円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	33,314,279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）	672,704円
２．　計算日における受益権の総数	
	4,774,608,043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	1.0399円
(10,000口当たり純資産額)	(10,399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 8月17日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資信託受益証券	△214,799,501
合計	△214,799,501

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	575,535	32,146,507.42	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	447,087	13,980,410.49	
	米ドル 小計		1,022,622	46,126,917.91 (4,914,823,103)	
合計				4,914,823,103 (4,914,823,103)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＡＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2020年 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	137,058,988
投資証券	17,973,510,610
派生商品評価勘定	1,941,290
未収入金	1,054,248
未収配当金	173,971,997
前払金	5,394,000
差入委託証拠金	83,990,000
流動資産合計	18,376,921,133
資産合計	18,376,921,133
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,225,260
未払解約金	4,281,000
未払利息	371
流動負債合計	10,506,631
負債合計	10,506,631
純資産の部	
元本等	
元本	15,737,240,868
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,629,173,634
元本等合計	18,366,414,502
純資産合計	18,366,414,502
負債純資産合計	18,376,921,133

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 8月17日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	13,297,314,709円
期中追加設定元本額	4,540,786,524円
期中一部解約元本額	2,100,860,365円
期末元本額	15,737,240,868円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	535,287,691円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	395,651,760円
りそなラップ型ファンド（成長型）	371,148,960円
ＤＣりそな　グローバルバランス	10,732,791円
つみたてバランスファンド	691,464,201円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３０	174,962,235円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	85,187,205円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	52,114,717円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	3,342,882円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	2,789,512円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,008,772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	1,493,805円
ＦＷりそな国内リートインデックスオープン	3,338,933,517円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	2,323,391,178円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	2,276,837,904円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	22,063,243円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	70,819,330円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	69,181,890円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	197,792,518円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	176,156,582円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	110,443,552円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	65,120,248円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	181,806,838円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	29,607,286円
Ｊ－ＲＥＩＴインデックスファンド（適格機関投資家専用）	3,193,526,250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）	629,921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	
	15,737,240,868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	1.1671円
(10,000口当たり純資産額)	(11,671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 8月17日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△3,614,259,870
合計	△3,614,259,870

(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 8月17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	385,189,970	－	380,906,000	△4,283,970
合計		385,189,970	－	380,906,000	△4,283,970

（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	333	33,832,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	499	46,107,600	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	454	64,740,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	677	440,727,000	
	ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人	2,494	178,570,400	
	森ヒルズリート投資法人	2,345	307,664,000	
	産業ファンド投資法人	2,881	537,018,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,936	613,712,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,330	253,099,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,021	392,064,000	
	ＧＬＰ投資法人	5,861	1,025,675,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	890	296,370,000	
	日本プロロジスリート投資法人	3,084	1,096,362,000	
	星野リゾート・リート投資法人	310	140,740,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	318	78,196,200	
	イオンリート投資法人	2,068	228,100,400	
	ヒューリックリート投資法人	1,641	218,253,000	
	日本リート投資法人	662	227,066,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13,096	175,355,440	
	積水ハウス・リート投資法人	5,996	419,120,400	
	トーセイ・リート投資法人	451	47,309,900	
	ケネディクス商業リート投資法人	750	153,675,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	435	50,199,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	392	38,102,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	6,592	893,216,000	
	いちごホテルリート投資法人	356	22,143,200	
	ラサールロジポート投資法人	1,906	351,466,400	
	スターアジア不動産投資法人	2,094	86,796,300	

	マリモ地方創生リート投資法人	191	18,622,500	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	584	322,952,000	
	大江戸温泉リート投資法人	329	19,542,600	
	投資法人みらい	2,202	77,400,300	
	森トラスト・ホテルリート投資法人	441	41,454,000	
	三菱地所物流リート投資法人	405	186,097,500	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	556	89,238,000	
	ザイマックス・リート投資法人	312	27,237,600	
	タカラレーベン不動産投資法人	613	52,779,300	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	644	101,430,000	
	日本ビルファンド投資法人	1,974	1,166,634,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,038	1,098,482,000	
	日本リテールファンド投資法人	3,853	564,464,500	
	オリックス不動産投資法人	4,062	609,300,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,269	371,817,000	
	プレミア投資法人	1,841	216,317,500	
	東急リアル・エステート投資法人	1,367	177,299,900	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,416	135,794,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,360	483,960,000	
	森トラスト総合リート投資法人	1,457	184,893,300	
	インヴィンシブル投資法人	8,524	222,732,120	
	フロンティア不動産投資法人	676	220,038,000	
	平和不動産リート投資法人	1,269	144,031,500	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,332	382,550,400	
	福岡リート投資法人	1,054	136,914,600	
	ケネディクス・オフィス投資法人	631	365,349,000	
	いちごオフィスリート投資法人	1,691	120,399,200	
	大和証券オフィス投資法人	434	249,984,000	
	阪急阪神リート投資法人	921	106,836,000	
	スターツプロシード投資法人	317	63,431,700	
	大和ハウスリート投資法人	2,909	818,010,800	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,567	292,559,850	
	大和証券リビング投資法人	2,572	269,802,800	
	ジャパンエクセレント投資法人	1,892	219,472,000	
合計		121,575	17,973,510,610	

(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 8月17日現在
資産の部	
流動資産	
預金	11,121,601
コール・ローン	13,354,236
投資証券	20,859,325,412
未収入金	20,815,594
未収配当金	47,767,989
流動資産合計	20,952,384,832
資産合計	20,952,384,832
負債の部	
流動負債	
未払金	3,723,426
未払解約金	7,242,000
未払利息	36
流動負債合計	10,965,462
負債合計	10,965,462
純資産の部	
元本等	
元本	21,757,822,280
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	△816,402,910
元本等合計	20,941,419,370
純資産合計	20,941,419,370
負債純資産合計	20,952,384,832

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 8月17日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	13,000,812,433円
期中追加設定元本額	10,696,062,743円
期中一部解約元本額	1,939,052,896円
期末元本額	21,757,822,280円
期末元本の内訳※	
りそなラップ型ファンド（安定型）	671,077,584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）	1,793,781,924円
ＤＣりそな　グローバルバランス	13,317,891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	251,074,520円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４０	121,835,055円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５０	73,723,399円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０３５	4,694,812円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	3,948,590円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０５５	1,425,555円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０６０	2,202,444円
リスクコントロール・オープン	7,151,488円
ＦＷりそな先進国リートインデックスオープン	8,493,740,740円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	4,269,174,772円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	1,272,784,243円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定型	27,326,385円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　安定成長型	88,234,898円

Ｓｍａｒｔ－ｉ　８資産バランス　成長型	98,046,426円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０６	478,033,534円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	419,475,068円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１０	263,098,543円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－１２	155,082,503円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０３	435,095,213円
りそな・リスクコントロールファンド２０２０－０６	70,843,905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）	2,021,384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	
	21,757,822,280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	816,402,910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	0.9625円
(10,000口当たり純資産額)	(9,625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 8月17日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17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。

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 8月17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 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	△2,445,826,226
合計	△2,445,826,226

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,937	194,031.63	
		AGREE REALTY CORP	9,155	611,187.80	
		ALEXANDER'S INC	368	95,348.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,833	3,716,413.26	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,232	223,581.12	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,565	798,617.85	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	143,218.80	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	44,294	1,244,661.40	
		AMERICOLD REALTY TRUST	34,824	1,325,401.44	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,877	947,356.97	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,978	343,134.18	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	66,200	22,508.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,169	4,208.40	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,532	3,754,622.60	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	25,855.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	25,054	2,165,417.22	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	13,173.67	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	30,901	347,636.25	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52,716	655,259.88	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,842	117,415.06	
		BRT APARTMENTS CORP	877	9,401.44	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,840	1,484,951.20	
		CARETRUST REIT INC	17,311	325,619.91	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	3,614.68	
		CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	14,990.27	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,481	58,010.04	
		CITY OFFICE REIT INC	8,644	77,623.12	
		CLIPPER REALTY INC	1,350	10,071.00	
		COLONY CAPITAL INC	83,392	224,324.48	

COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,242	256,390.94	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	176,376.56	
CORECIVIC INC	19,484	192,307.08	
COREPOINT LODGING INC	7,200	43,632.00	
CORESITE REALTY CORP	7,022	859,563.02	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,132	486,144.12	
COUSINS PROPERTIES INC	25,471	798,770.56	
CUBESMART	33,446	1,035,488.16	
CYRUSONE INC	19,956	1,636,791.12	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,147	186,101.15	
DIGITAL REALTY TRUST INC	46,652	7,152,684.64	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,700	160,218.00	
DOUGLAS EMMETT INC	28,919	834,602.34	
DUKE REALTY CORP	63,778	2,416,548.42	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,662	324,745.74	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,877	916,016.40	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,942	168,882.42	
EPR PROPERTIES	13,450	439,142.50	
EQUINIX INC	15,374	11,715,141.74	
EQUITY COMMONWEALTH	20,728	632,825.84	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,444	2,057,066.48	
EQUITY RESIDENTIAL	61,006	3,318,116.34	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,956	261,730.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,296	2,475,518.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	22,245	2,318,151.45	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	22,161.20	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,303	1,007,369.64	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,042	927,527.36	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,917	320,470.77	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	78,351.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8,641	84,768.21	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,914	1,344,620.16	
GEO GROUP INC/THE	19,721	220,086.36	

GETTY REALTY CORP	6,175	184,015.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	114,663.68	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	40,495.40	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	98,677.72	
GLOBAL NET LEASE INC	16,550	291,776.50	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,203	641,098.89	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	37,679	968,350.30	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	93,645	2,529,351.45	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	27,873.33	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	18,432	701,153.28	
HOST HOTELS & RESORTS INC	122,860	1,382,175.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,165	617,232.35	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	17,854	208,534.72	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,134	237,488.22	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,740	448,463.40	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,974	140,608.02	
INVITATION HOMES INC	93,886	2,691,711.62	
IRON MOUNTAIN INC	49,684	1,477,602.16	
JBG SMITH PROPERTIES	20,196	558,419.40	
KILROY REALTY CORP	18,496	1,075,172.48	
KIMCO REALTY CORP	75,757	907,568.86	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,699	157,401.51	
LEXINGTON REALTY TRUST	47,838	553,007.28	
LIFE STORAGE INC	8,049	821,239.47	
LTC PROPERTIES INC	6,359	236,809.16	
MACERICH CO/THE	20,631	165,048.00	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	193,280.92	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	256,400	192,300.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	91,438	1,753,780.84	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,744	2,267,795.84	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17,950	260,454.50	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30,040	1,075,432.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,777	353,485.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,723	492,881.86	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,695	72,197.00	

NEXPOINT RESIDENTIAL	4,057	167,594.67	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,819	192,581.97	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,089	1,218,404.13	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,185	40,160.30	
PARAMOUNT GROUP INC	30,907	225,312.03	
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,506	383,186.76	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,138	264,106.34	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	9,894.30	
PHYSICIANS REALTY TRUST	34,938	635,871.60	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,777	368,304.09	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	29,442.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	60,860.56	
PRIME US REIT	85,000	65,450.00	
PROLOGIS INC	128,259	13,123,460.88	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,480	455,497.20	
PUBLIC STORAGE	26,168	5,239,880.32	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,355	695,648.90	
REALTY INCOME CORP	59,324	3,619,357.24	
REGENCY CENTERS CORP	29,567	1,267,832.96	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,899	225,843.05	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	39,537	270,037.71	
RETAIL VALUE INC	1,615	21,237.25	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,320	975,816.40	
RLJ LODGING TRUST	28,086	271,591.62	
RPT REALTY	15,048	97,661.52	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,923	371,020.97	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,637	530,634.93	
SAFEHOLD INC	2,352	126,278.88	
SAUL CENTERS INC	2,130	65,944.80	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,242	92,118.24	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	239,030.40	
SIMON PROPERTY GROUP INC	52,861	3,604,062.98	
SITE CENTERS CORP	24,168	194,794.08	
SL GREEN REALTY CORP	13,535	641,288.30	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,442	624,074.76	

		STAG INDUSTRIAL INC	26,154	852,620.40	
		STORE CAPITAL CORP	38,667	976,728.42	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	117,667.20	
		SUN COMMUNITIES INC	16,967	2,485,495.83	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,478	328,062.18	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,020	109,098.20	
		TAUBMAN CENTERS INC	10,971	420,518.43	
		TERRENO REALTY CORP	11,502	671,831.82	
		UDR INC	51,022	1,786,790.44	
		UMH PROPERTIES INC	7,056	95,044.32	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,060	148,052.20	
		URBAN EDGE PROPERTIES	17,978	196,319.76	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	57,160.01	
		VENTAS INC	64,946	2,636,807.60	
		VEREIT INC	186,972	1,254,582.12	
		VICI PROPERTIES INC	81,146	1,860,677.78	
		VORNADO REALTY TRUST	27,817	989,728.86	
		WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	14,270.33	
		WASHINGTON REIT	14,564	328,272.56	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	21,596	408,812.28	
		WELLTOWER INC	72,579	4,118,858.25	
		WHITESTONE REIT	7,716	52,854.60	
		WP CAREY INC	29,793	2,110,834.05	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	20,048	184,040.64	
	米ドル 小計		4,358,168	146,394,155.97 (15,598,297,318)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,085	394,323.50	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,597	108,964.05	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,226	130,667.92	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,801	692,538.79	
		CHOICE PROPERTIES REIT	26,037	332,232.12	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,280	93,624.00	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	111,513.66	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	124,709.28	
		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	146,775.30	

		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,061	80,895.12	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	268,790.40	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,848	369,902.40	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,054	259,058.36	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	152,451.00	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	150,212.44	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	62,279.90	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	59,320.74	
		NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	6,008	208,477.60	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,751	179,246.38	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,823	400,772.96	
		SLATE OFFICE REIT	4,169	16,175.72	
		SLATE RETAIL REIT - U	1,920	17,760.00	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,423	257,156.10	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,126	146,239.56	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	28,224.00	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,100	108,641.00	
	カナダドル 小計		280,908	4,900,952.30 (393,742,507)	
	ユーロ	AEDIFICA	4,689	464,211.00	
		ALSTRIA OFFICE REIT-AG	28,430	359,923.80	
		ALTAREA	659	82,111.40	
		BEFIMMO	4,044	158,322.60	
		COFINIMMO	4,226	523,178.80	
		COVIVIO	8,276	516,836.20	
		EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	7,371	76,216.14	
		GECINA SA	9,547	1,092,176.80	
		HAMBORNER REIT AG	12,779	109,592.70	
		HIBERNIA REIT PLC	124,814	147,779.77	
		ICADE	4,706	266,124.30	
		IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	15,546.14	
		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,440	293,998.80	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	93,555.00	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	113,641.50	
		KLEPIERRE	35,203	537,901.84	

		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	54,447.03	
		MERCIALYS	3,481	21,634.41	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	64,785	495,605.25	
		MONTEA	1,871	182,048.30	
		NSI NV	3,090	93,936.00	
		RETAIL ESTATES	1,989	110,588.40	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,952	1,027,780.32	
		VASTNED RETAIL NV	3,660	91,500.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,050	636,914.25	
		WERELDHAVE NV	7,169	52,620.46	
		ユーロ 小計	513,612	7,618,191.21 (961,415,730)	
	英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	16,120.00	
		ASSURA PLC	472,419	383,604.22	
		BIG YELLOW GROUP PLC	29,321	304,938.40	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	97,713.00	
		BRITISH LAND CO PLC	165,720	607,032.36	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,700	186,084.20	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	3,446.52	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,652	123,917.20	
		DERWENT LONDON PLC	18,288	514,990.08	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	67,708.19	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	45,664	273,984.00	
		HAMMERSON PLC	135,561	69,000.54	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	131,300	748,410.00	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	163,242	393,413.22	
		LXI REIT PLC	94,678	102,252.24	
		NEWRIVER REIT PLC	56,051	34,639.51	
		PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	67,600.80	
		PRIMARY HEALTH PROPERTIES	233,711	356,642.98	
		RDI REIT PLC	48,350	42,064.50	
		REGIONAL REIT LTD	68,961	55,858.41	
		SAFESTORE HOLDINGS PLC	37,357	288,769.61	
		SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	35,087.51	
		SEGRO PLC	206,516	1,989,162.11	

	SHAFTESBURY PLC	36,422	188,483.85	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	49,939	53,434.73	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	294,977	464,293.79	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	124,710	84,179.25	
	UNITE GROUP PLC	68,253	641,578.20	
	WORKSPACE GROUP PLC	21,040	120,559.20	
	英ポンド 小計	3,345,961	8,314,968.62 (1,160,437,020)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	66,607	181,171.04	
	APN INDUSTRIA REIT	13,219	32,254.36	
	ARENA REIT	52,557	127,713.51	
	BWP TRUST	82,681	333,204.43	
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	135,801.90	
	CHARTER HALL GROUP	80,514	898,536.24	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,828	352,159.56	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,091	273,295.75	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	142,791.77	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	324,502	290,429.29	
	DEXUS	190,212	1,609,193.52	
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	93,147.00	
	GOODMAN GROUP	281,653	5,185,231.73	
	GPT GROUP	340,528	1,294,006.40	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	169,500.71	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,020	62,009.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,899	235,024.29	
	MIRVAC GROUP	688,152	1,445,119.20	
	NATIONAL STORAGE REIT	158,638	291,893.92	
	RURAL FUNDS GROUP	67,950	148,131.00	
	SCENTRE GROUP	911,360	1,895,628.80	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	196,242	419,957.88	
	STOCKLAND	407,672	1,422,775.28	
	VICINITY CENTRES	670,328	914,997.72	
	WAYPOINT REIT LTD	119,935	311,831.00	
	オーストラリアドル 小計	5,147,559	18,265,805.30 (1,398,612,711)	

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	179,005.59	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	187,660	426,926.50	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	272,970	266,145.75	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	310,187.47	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	49,526	133,224.94	
ニュージーランドドル 小計		841,430	1,315,490.25 (91,623,895)	
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,375,660.00	
	FORTUNE REIT	239,000	1,594,130.00	
	LINK REIT	358,700	22,472,555.00	
	PROSPERITY REIT	226,000	555,960.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	196,000	723,240.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	977,400.00	
香港ドル 小計		1,627,700	27,698,945.00 (380,860,493)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	95,698.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	175,200	113,880.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	517,200	1,779,168.00	
	ASCOTT TRUST	316,596	280,187.46	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	490,600	794,772.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	487,500	916,500.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	140,500	164,385.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	143,100	147,393.00	
	ESR REIT	390,700	150,419.50	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	80,100.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	107,400	63,903.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	126,100	293,813.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	58,159.50	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	419,979	558,572.07	
	KEPPEL DC REIT	212,400	620,208.00	
	KEPPEL REIT	327,600	357,084.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	127,100	80,073.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	24,091.10	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	374,400	715,104.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	262,400	816,064.00	

		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	529,400	1,122,328.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	354,900	310,537.50	
		OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	446,000	165,020.00	
		PARKWAYLIFE REAL ESTATE	70,900	250,986.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	58,436.50	
		SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	71,377.50	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	41,369.00	
		SPH REIT	161,200	138,632.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	251,500	111,917.50	
		SUNTEC REIT	421,200	577,044.00	
	シンガポールドル 小計		7,781,075	10,957,222.63 (852,143,203)	
	韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	15,600	80,964,000.00	
		SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	27,101,000.00	
	韓国ウォン 小計		19,700	108,065,000.00 (9,725,850)	
	イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	29,265	398,296.65	
	イスラエルシュケル 小計		29,265	398,296.65 (12,466,685)	
合計				20,859,325,412 (20,859,325,412)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券	157銘柄	100.0%	74.8%
カナダドル	投資証券	26銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券	26銘柄	100.0%	4.6%
英ポンド	投資証券	30銘柄	100.0%	5.6%
オーストラリアドル	投資証券	25銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	1.8%

シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	4.1%
韓国ウォン	投資証券	2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシュケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 8月31日現在です。

【リスクコントロール・オープン】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	338,245,146円
Ⅱ　負債総額	193,880円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	338,051,266円
Ⅳ　発行済口数	330,667,106口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0223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	88,999,117,006円
Ⅱ　負債総額	2,105,439,099円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	86,893,677,907円
Ⅳ　発行済口数	82,796,382,100口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0495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	186,501,459,639円
Ⅱ　負債総額	3,261,597,279円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	183,239,862,360円
Ⅳ　発行済口数	172,272,857,448口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0637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	29,843,552,205円
Ⅱ　負債総額	36,058,062円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	29,807,494,143円
Ⅳ　発行済口数	25,966,196,404口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1479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	70,971,926,071円
Ⅱ　負債総額	768,587,711円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	70,203,338,360円
Ⅳ　発行済口数	49,091,404,620口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4301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	10,212,867,385円
Ⅱ　負債総額	134,633,225円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,078,234,160円
Ⅳ　発行済口数	7,439,467,860口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3547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	5,080,464,673円
Ⅱ　負債総額	15,303,129円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,065,161,544円
Ⅳ　発行済口数	4,895,593,131口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0346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	19,388,537,150円
Ⅱ　負債総額	27,397,353円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	19,361,139,797円
Ⅳ　発行済口数	15,935,900,244口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2149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	21,513,039,975円
Ⅱ　負債総額	37,033,214円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	21,476,006,761円
Ⅳ　発行済口数	22,147,889,423口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	0.9697円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

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

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

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

定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2020年8月末現在	資本金の額	1,000,000,000円
	発行可能株式総数	3,960,000株
	発行済株式総数	3,960,000株

●過去５年間における主な資本金の増減

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8月末現在）

①　会社の意思決定機構

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

②　投資運用の意思決定機構

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

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

2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。
2020年8月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

ファンドの種類	本数	純資産総額（百万円）
追加型株式投資信託	80	801,077
単位型株式投資信託	6	119,996
合計	86	921,073

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	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
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
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	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。
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

（３）保証会社

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

２【関係業務の概要】

（１）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（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）保証会社
基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。

３【資本関係】

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

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 5月28日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取 締 役 会　御 中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山　田　　信　之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	畑　中　　建　二	印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第5期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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

2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2020年10月9日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　山　田　　信　之　　印

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているリスクコントロール・オープンの2020年3月31日から2020年8月17日までの特定期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、リスクコントロール・オープンの2020年8月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

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