

**【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12月15日提出
【計算期間】	第1期(自 2019年10月31日至 2020年9月15日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド2019-10
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 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) 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	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	その他 ( )	中南米 アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信) 資産配分変更 型))		中近東 (中東) エマージング		
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

#### < 商品分類の定義 >

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

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

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

#### 4. 独立した区分

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

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

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1)株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

###### (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

###### (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

###### (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

##### 2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

### 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 4. 投資形態による属性区分

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

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

### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

## ファンドの特色

### ◆「保証契約」の表記について

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

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

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

### ◆「保証会社」の表記について

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

## 投資対象

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

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

## ファンドの特色

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

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

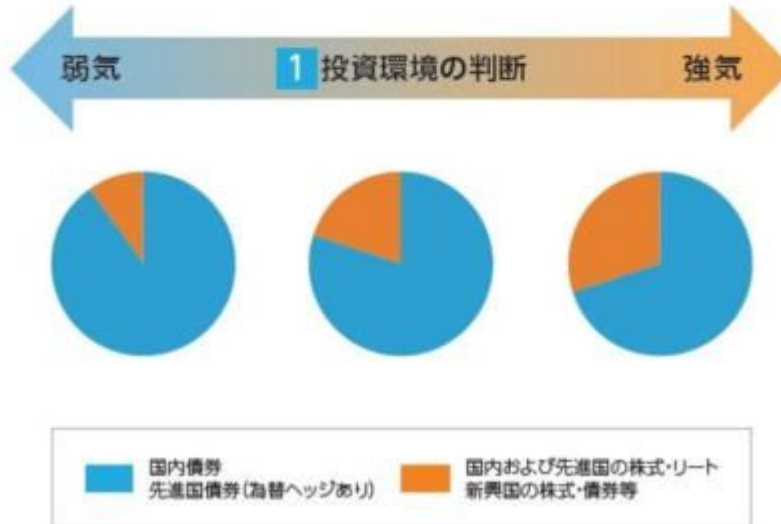
\*基準価額が「確保ライン」を上回っている場合でも、上記の条件以外の理由によって委託会社が繰上償還を決定することがあります。

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

## Point

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

## 投資環境の判断と投資割合のイメージ

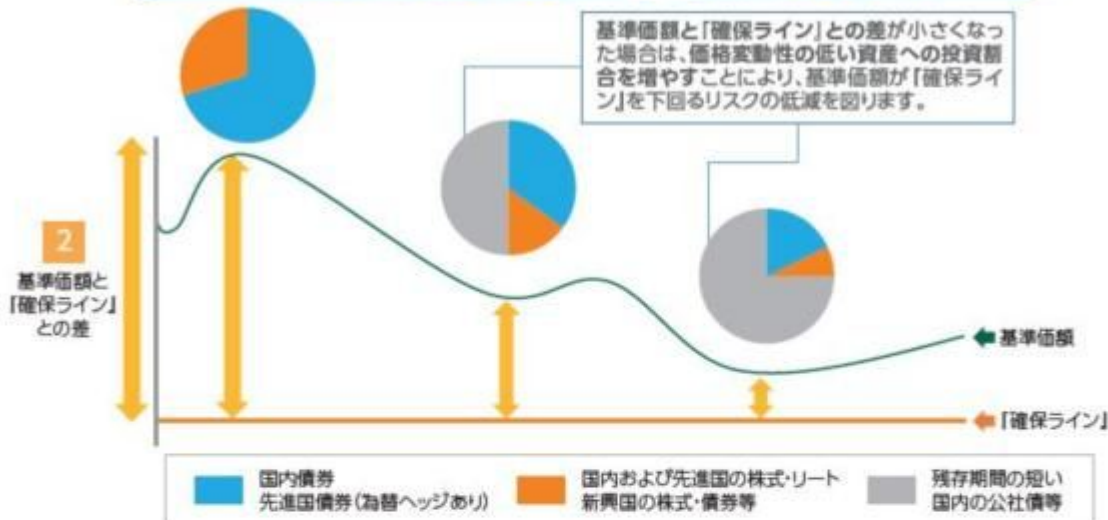


## 2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した『確保ライン』を上回る水準で運用を継続することを目指します。

### Point

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

### 『基準価額と『確保ライン』との差』と投資割合のイメージ

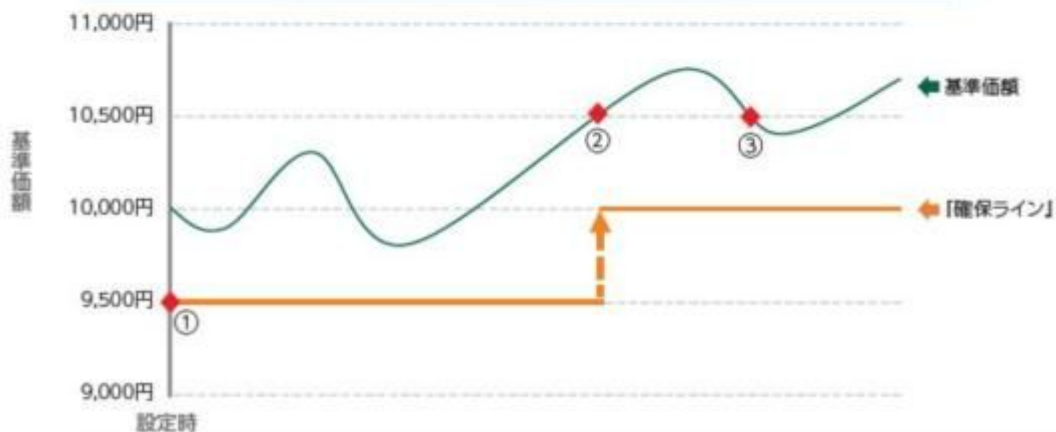


### 『確保ライン』は設定後に見直される場合があります。

### Point

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

### 『確保ライン』の引き上げイメージ



### ⚠️ ご注意ください

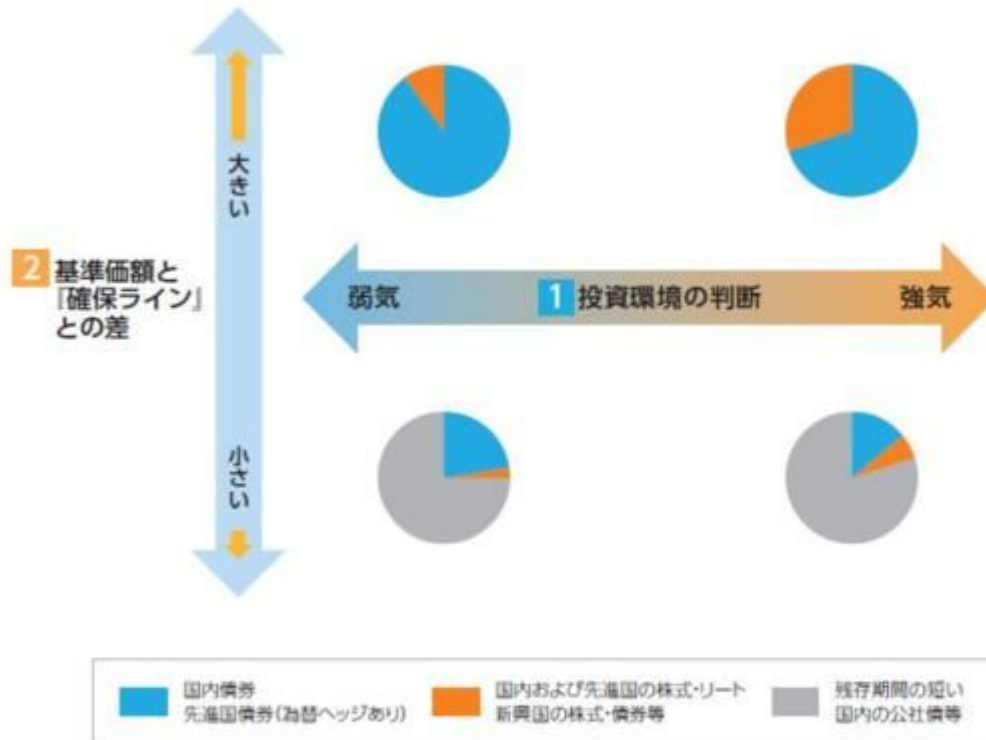
ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。



## 投資対象資産への投資割合のイメージ

## 1 投資環境の判断 と 2 基準価額と「確保ライン」との差

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

⚠️ **ご注意ください**

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

3

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

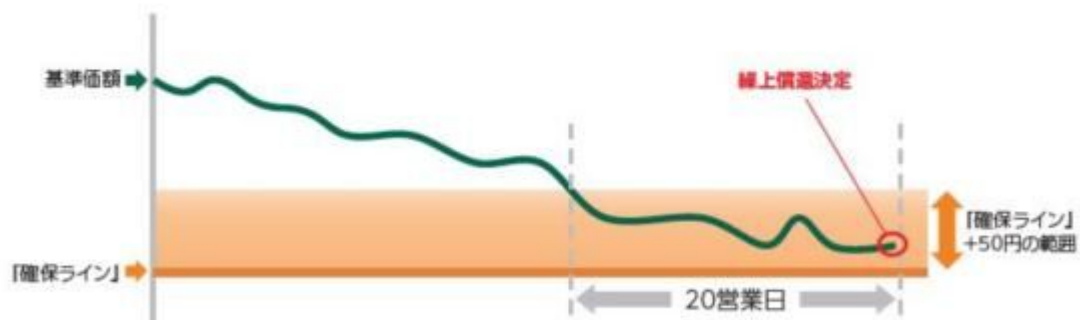
#### 条件① 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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

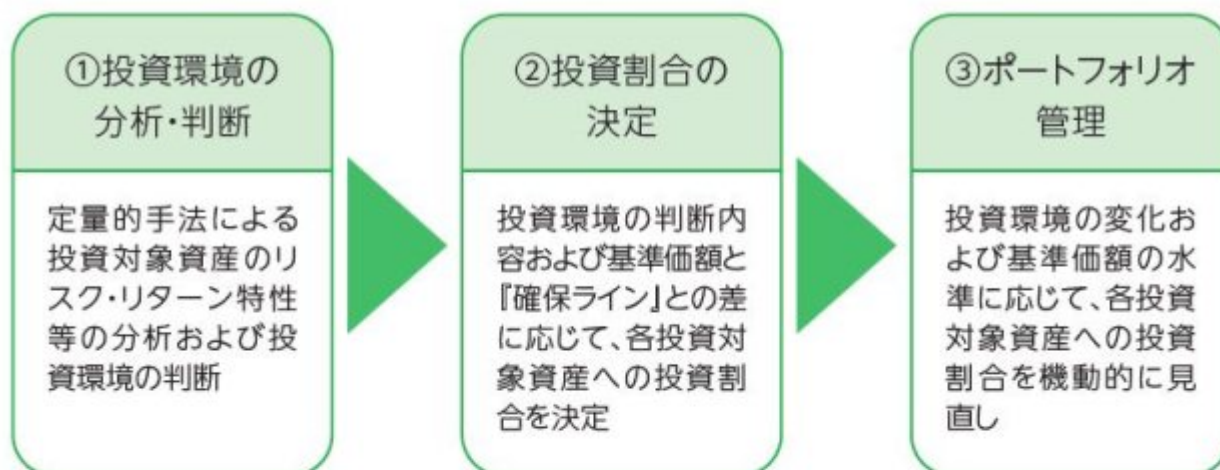


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

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

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

## 運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## 分配方針

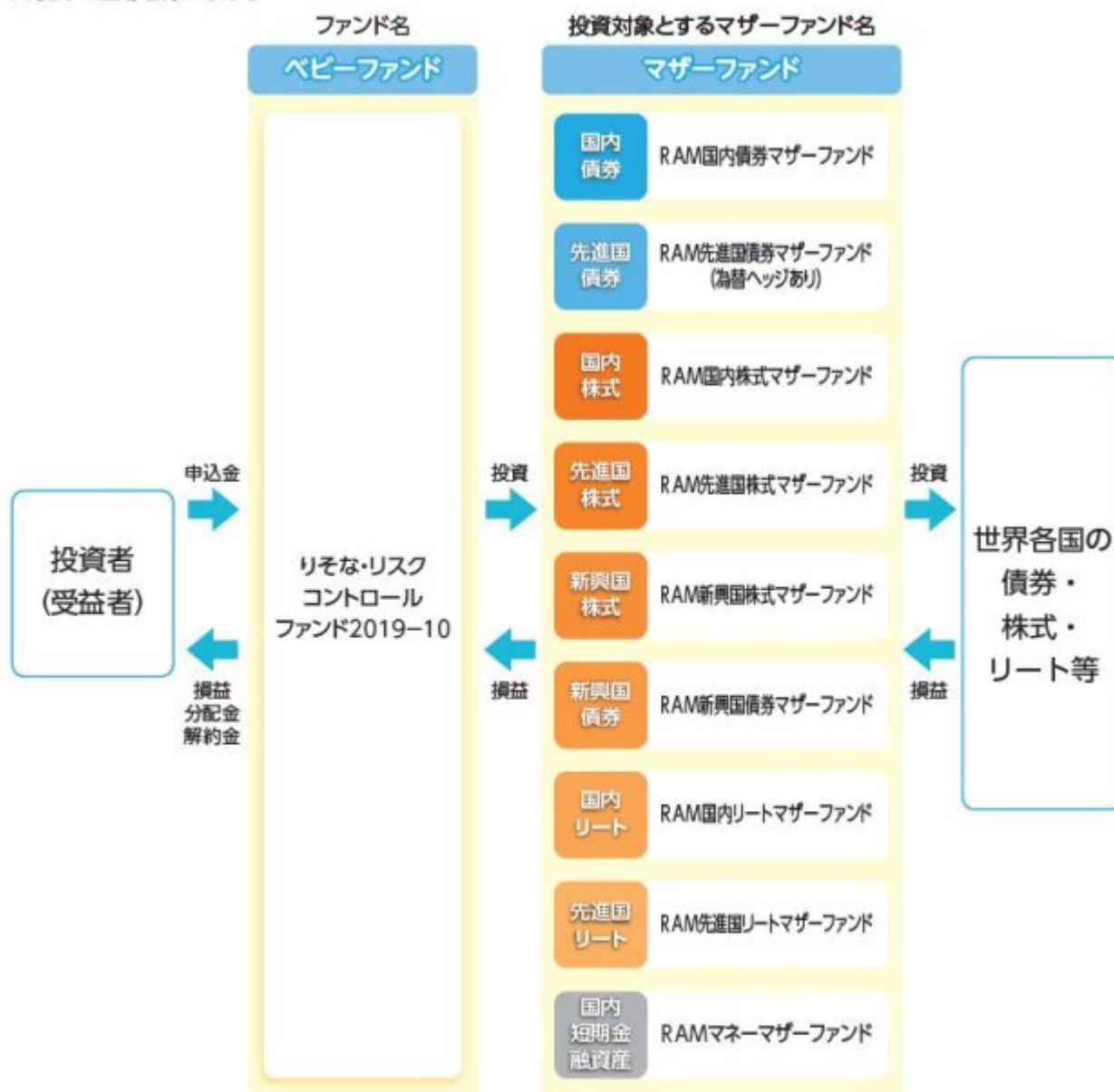
原則、毎年9月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ■ ファンドの仕組み

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



## ■ 主な投資制限

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

## インデックスの著作権等について

### ●RAM国内債券マザーファンド

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

### ●RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

### ●RAM国内株式マザーファンド

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

### ●RAM先進国株式マザーファンド

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

### ●RAM新興国株式マザーファンド

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

### ●RAM新興国債券マザーファンド

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

### ●RAM国内リートマザーファンド

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

### ●RAM先進国リートマザーファンド

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

※RAMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

信託金限度額

500億円を限度とします。

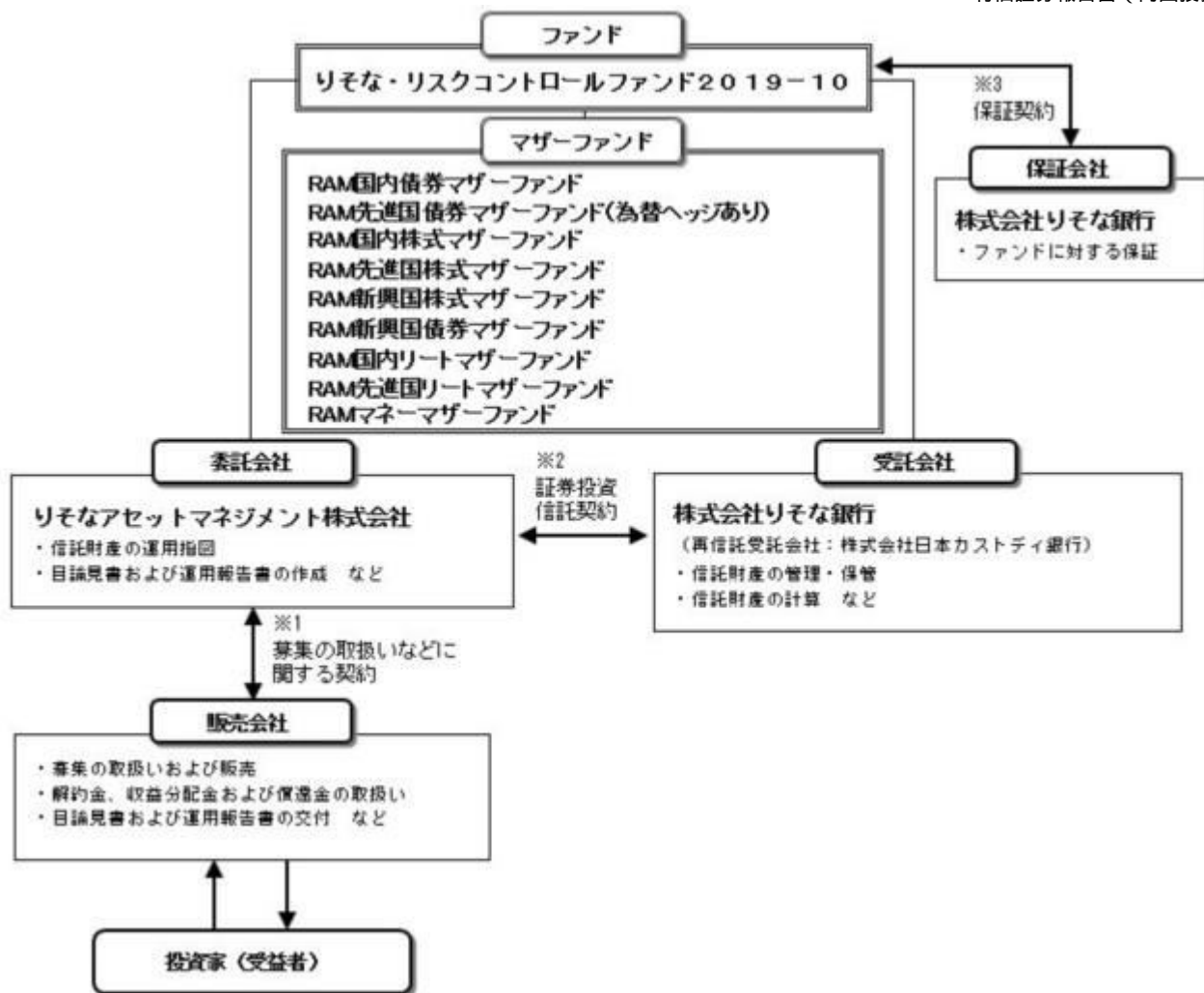
## (2)【ファンドの沿革】

2019年10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】

ファンドの仕組み



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

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

委託会社の概況（2020年9月末現在）

- 1) 資本金  
1,000百万円
- 2) 沿革  
2015年8月3日： りそなアセットマネジメント株式会社設立  
2020年1月1日： 株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継
- 3) 大株主の状況

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

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

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

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

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

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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

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

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

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

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

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

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

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

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 有価証券の指図範囲

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

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

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



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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

##### 投資対象とするマザーファンドの概要

##### <RAM国内債券マザーファンド>

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

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

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

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

## &lt; R A M国内株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、東証株価指数（TOPIX、配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

## &lt; R A M先進国株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R A M新興国株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R A M新興国債券マザーファンド &gt;

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

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R A M国内リートマザーファンド &gt;

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



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。
<b>その他</b>	
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

## &lt; R A M先進国リートマザーファンド &gt;

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

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

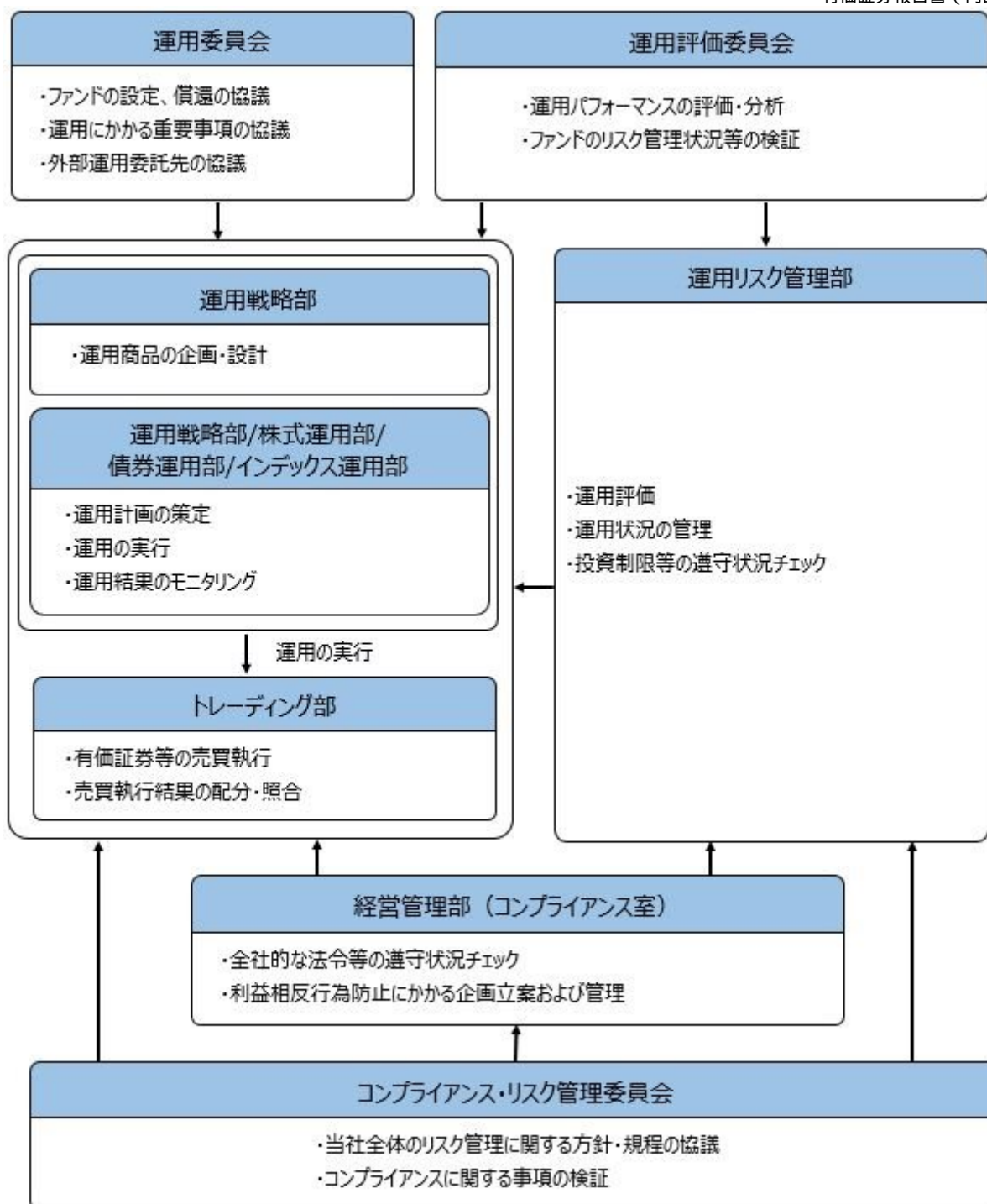
## &lt; RAMマネーマザーファンド &gt;

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

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

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

#### ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2020年9月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

#### (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 3) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。  
委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

## 収益分配金の支払い

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

## (5) 【投資制限】

### 約款に定める投資制限

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

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

#### 10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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



います。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 17) 資金の借入れ

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
3. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・株価変動リスク

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

##### ・金利(債券価格)変動リスク

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

##### ・リートの価格変動リスク

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

##### ・為替変動リスク

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

#### 資産配分リスク

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

#### 信用リスク

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

### 流動性リスク

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

### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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

### （その他の留意点）

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

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

次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。

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

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

- ・信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき。
- ・繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき。
- ・やむを得ない事情が発生したとき。

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

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

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

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

## （２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

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

運用評価委員会は、運用実績および主な投資制限等の遵守状況や運用事務状況等を確認することを通じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。

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

上記体制は2020年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬

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

###### 1) 当初設定日以降、2019年12月5日まで

年率1.243%（税抜1.13%）

###### 2) 2019年12月6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%）

###### 3) 2)にかかわらず、前月末営業日以降にリスク性資産割合が25%未満となった場合においては、前月末営業日のリスク性資産割合に関わらず、委託会社の判断により信託報酬を年率0.297%（税抜0.27%）を上限として変更し、毎月初5営業日以外の営業日より適用する場合があります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

1) 当初設定日以降、2019年12月5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
0.495%	0.605%	0.03%

2) 2019年12月6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	0.495%	0.605%	0.03%
25%以上50%未満	0.216%	0.264%	0.03%
25%未満	0.108%	0.132%	0.03%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

#### 支払時期

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

#### 保証料

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該

諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができません(現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。)

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

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### 1) 収益分配金に対する課税

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

### 2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益(譲渡益)<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>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。

法人受益者の場合

### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

上記は2020年9月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## 【りそな・リスクコントロールファンド2019-10】

以下の運用状況は2020年9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	15,203,115,087	71.00
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		6,210,785,004	29.00
合計(純資産総額)		21,413,900,091	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAMマネーマザーファンド	6,613,979,753	0.9991	6,608,027,172	0.9981	6,601,413,191	30.83
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)	4,926,320,509	1.0609	5,226,333,428	1.0752	5,296,779,811	24.74
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	1,254,987,307	1.0534	1,322,003,630	1.0525	1,320,874,140	6.17
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	873,081,299	1.2972	1,132,561,062	1.3729	1,198,653,315	5.60
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	215,586,043	0.9196	198,252,926	0.9298	200,451,902	0.94
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	151,590,787	1.2341	187,078,191	1.2948	196,279,751	0.92
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	167,588,682	1.1037	184,967,629	1.1627	194,855,360	0.91
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	96,028,013	1.0245	98,380,700	1.0101	96,997,895	0.45
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	80,460,208	1.1483	92,392,457	1.2032	96,809,722	0.45

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	71.00
合計	71.00

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2020年 9月15日)	21,555	21,555	0.9660	0.9660
2019年10月末日	26,468		1.0000	
11月末日	26,492		1.0037	
12月末日	26,392		1.0056	
2020年 1月末日	26,383		1.0144	
2月末日	25,970		1.0056	
3月末日	23,375		0.9596	
4月末日	22,619		0.9589	
5月末日	22,428		0.9594	
6月末日	22,112		0.9605	
7月末日	21,965		0.9641	
8月末日	21,723		0.9659	
9月末日	21,413		0.9646	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2019年10月31日～2020年 9月15日	0.0000

#### 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2019年10月31日～2020年 9月15日	3.40

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

### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2019年10月31日～2020年 9月15日	26,468,299,071	4,152,545,217

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

## R A M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	74,164,216,430	83.34
地方債証券	日本	4,463,682,200	5.02
特殊債券	日本	5,675,039,746	6.38
社債券	日本	3,609,287,000	4.06
	フランス	98,725,000	0.11
	オーストラリア	100,273,000	0.11
	小計	3,808,285,000	4.28
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		874,356,581	0.98
合計（純資産総額）		88,985,579,957	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	100.47	1,286,067,200	0.100	2022/9/20	1.45
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	1,160,000,000	100.89	1,170,335,300	100.81	1,169,488,800	0.100	2024/3/20	1.31
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	100.87	1,079,394,600	0.100	2024/6/20	1.21
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	100.53	1,065,660,400	0.100	2022/12/20	1.20
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	100.59	1,005,930,000	0.100	2023/3/20	1.13
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	920,000,000	101.80	936,571,500	101.36	932,576,400	0.100	2027/3/20	1.05
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	910,000,000	101.30	921,897,300	101.12	920,219,300	0.100	2029/9/20	1.03
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	910,000,000	100.80	917,369,000	100.65	915,951,400	0.100	2023/6/20	1.03
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	814,000,000	103.09	839,166,700	102.57	834,952,360	0.400	2025/9/20	0.94
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	790,000,000	101.42	801,240,300	101.40	801,083,700	0.100	2028/9/20	0.90



日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	760,000,000	101.22	769,287,600	101.06	768,063,600	0.100	2029/12/20	0.86
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	730,000,000	101.77	742,954,900	101.46	740,701,800	0.100	2028/3/20	0.83
日本	国債証券	第414回利付国債（2年）	730,000,000	100.46	733,400,200	100.46	733,387,200	0.100	2022/7/1	0.82
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	720,000,000	100.85	726,151,400	100.99	727,156,800	0.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第138回利付国債（5年）	720,000,000	100.90	726,484,900	100.75	725,464,800	0.100	2023/12/20	0.82
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	710,000,000	101.45	720,343,700	101.31	719,336,500	0.100	2026/12/20	0.81
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	690,000,000	101.51	700,480,300	101.29	698,914,800	0.100	2026/9/20	0.79
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	680,000,000	101.50	690,230,500	101.23	688,411,600	0.100	2026/6/20	0.77
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	680,000,000	101.09	687,446,200	100.99	686,779,600	0.100	2024/12/20	0.77
日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	650,000,000	100.83	655,418,000	100.70	654,550,000	0.100	2023/9/20	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	101.22	647,833,600	0.100	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	631,000,000	102.78	648,591,900	102.38	646,017,800	0.400	2025/3/20	0.73
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	630,000,000	100.95	636,034,000	101.01	636,419,700	0.100	2025/6/20	0.72
日本	国債証券	第141回利付国債（5年）	620,000,000	101.03	626,409,800	100.93	625,809,400	0.100	2024/9/20	0.70
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	600,000,000	100.68	604,135,000	100.87	605,238,000	0.100	2030/6/20	0.68
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	590,000,000	101.35	597,975,200	101.36	598,041,700	0.100	2028/12/20	0.67
日本	国債証券	第354回利付国債（10年）	570,000,000	101.50	578,550,000	101.31	577,512,600	0.100	2029/3/20	0.65
日本	国債証券	第413回利付国債（2年）	550,000,000	100.46	552,569,700	100.45	552,524,500	0.100	2022/6/1	0.62
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	532,000,000	102.98	547,859,440	102.35	544,549,880	0.600	2023/12/20	0.61
日本	国債証券	第411回利付国債（2年）	530,000,000	100.50	532,693,400	100.42	532,268,400	0.100	2022/4/1	0.60

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.34
地方債証券	5.02
特殊債券	6.38
社債券	4.28
合計	99.02

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	79,514,253,089	42.79
	カナダ	3,469,957,549	1.87
	メキシコ	1,343,665,442	0.72
	ドイツ	13,986,432,110	7.53
	イタリア	17,141,464,340	9.22
	フランス	19,201,404,061	10.33
	オランダ	3,496,005,815	1.88
	スペイン	11,048,595,668	5.95
	ベルギー	4,756,390,634	2.56
	オーストリア	2,903,776,393	1.56
	フィンランド	1,115,620,286	0.60
	アイルランド	1,498,991,991	0.81
	イギリス	11,889,696,033	6.40
	スウェーデン	563,202,513	0.30
	ノルウェー	383,504,860	0.21
	デンマーク	967,842,491	0.52
	ポーランド	1,161,458,705	0.63
	オーストラリア	4,394,995,543	2.37
	シンガポール	806,528,202	0.43
	マレーシア	904,203,977	0.49
イスラエル	733,251,752	0.39	
	小計	181,281,241,454	97.55
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		4,551,511,660	2.45
合計（純資産総額）		185,832,753,114	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		180,432,259,510	97.09

(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	7,750,000	10,934.43	847,418,325	10,931.28	847,174,881	1.625	2022/12/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,589.75	815,816,077	12,780.30	828,164,013	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	13,373.12	742,208,160	14,542.12	807,088,016	3.000	2048/2/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,544.43	771,852,323	10,583.30	774,698,017	0.625	2030/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,770,000	11,088.61	750,699,012	11,112.71	752,331,067	1.375	2025/1/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	14,593.66	736,980,023	14,586.76	736,631,446	3.000	2048/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	12,193.94	715,784,504	12,525.72	735,260,209	2.875	2028/8/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,130,000	22,602.33	707,452,954	23,457.45	734,218,228	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,317.78	713,020,682	11,452.85	721,529,550	1.500	2030/2/15	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,440,000	15,663.33	695,452,101	15,868.29	704,552,197	2.500	2030/5/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,384.78	695,610,349	11,476.40	701,208,429	2.375	2024/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,383.45	698,426,833	12,395.95	699,132,005	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,590,000	11,718.63	655,071,826	12,482.74	697,785,521	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,150,000	11,100.53	682,682,964	11,152.39	685,872,222	1.500	2024/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,377.75	664,460,818	11,474.75	670,125,620	2.500	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,492.81	637,851,443	11,895.47	660,198,797	2.250	2027/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,344.53	631,890,722	11,647.29	648,754,540	2.250	2025/11/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	18,953.42	651,997,959	18,831.84	647,815,407	5.500	2029/4/25	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,350,000	14,466.71	629,301,942	14,784.51	643,126,278	1.500	2031/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,346.21	621,772,846	11,440.03	626,914,061	2.750	2023/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,712.84	613,752,994	11,925.23	624,882,055	2.250	2027/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,010,000	11,075.14	554,864,714	12,210.39	611,740,732	2.375	2029/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,159.32	591,444,197	11,479.71	608,424,769	2.000	2025/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,777.13	576,576,724	11,304.48	604,789,753	2.125	2024/3/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,763.89	570,548,718	12,340.16	598,497,949	2.750	2028/2/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,830,000	15,251.57	584,135,356	15,332.98	587,253,265	2.750	2027/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,530,000	10,570.22	584,533,244	10,581.23	585,142,510	0.125	2022/4/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,360,000	10,924.90	585,575,069	10,854.21	581,785,730	2.000	2022/2/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,700,000	10,232.21	583,236,280	10,174.15	579,926,980	1.250	2050/5/15	0.31
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,770,000	15,333.26	578,064,189	15,298.36	576,748,354	3.500	2026/4/25	0.31

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.55
合計	97.55

## 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	752,581,000.00	79,548,037,474	79,585,440,750	42.83
	カナダドル	売建	43,800,000.00	3,460,581,060	3,460,200,000	1.86
	メキシコペソ	売建	290,597,000.00	1,368,217,855	1,362,899,930	0.73
	ユーロ	売建	600,108,000.00	74,539,816,752	74,527,412,520	40.10
	英ポンド	売建	85,687,000.00	11,651,041,332	11,657,716,350	6.27
	スウェーデンクローナ	売建	47,719,000.00	563,446,864	563,084,200	0.30
	ノルウェークローネ	売建	34,141,000.00	383,621,932	383,062,020	0.21
	デンマーククローネ	売建	57,991,000.00	967,753,808	967,289,880	0.52
	ポーランドズロチ	売建	42,732,000.00	1,169,741,067	1,170,429,480	0.63
	オーストラリアドル	売建	57,973,000.00	4,374,439,674	4,374,642,580	2.35
	シンガポールドル	売建	10,436,000.00	806,212,308	806,181,000	0.43
	マレーシアリングット	売建	32,880,000.00	836,408,016	836,467,200	0.45
	イスラエルシェケル	売建	24,005,000.00	737,745,665	737,433,600	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。

#### R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	30,322,171,272	98.41
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		489,402,648	1.59
合計(純資産総額)		30,811,573,920	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	552,670,000	1.79

(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	148,500	7,215.67	1,071,527,349	6,932.00	1,029,402,000	3.34
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	103,600	5,022.63	520,345,094	6,469.00	670,188,400	2.18
日本	株式	ソニー	電気機器	83,400	7,592.74	633,234,775	8,032.00	669,868,800	2.17
日本	株式	キーエンス	電気機器	12,100	40,328.22	487,971,504	48,980.00	592,658,000	1.92
日本	株式	任天堂	その他製品	8,200	44,443.38	364,435,746	59,660.00	489,212,000	1.59
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	110,800	4,026.13	446,095,560	3,744.00	414,835,200	1.35
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	91,100	3,940.28	358,960,109	4,160.00	378,976,000	1.23
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	174,600	2,643.86	461,618,153	2,150.00	375,390,000	1.22
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	898,100	494.51	444,121,535	416.10	373,699,410	1.21
日本	株式	第一三共	医薬品	114,300	2,627.36	300,308,360	3,229.00	369,074,700	1.20
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	93,200	3,060.25	285,215,541	3,885.00	362,082,000	1.18
日本	株式	ダイキン工業	機械	17,000	16,182.25	275,098,396	19,300.00	328,100,000	1.06
日本	株式	日本電産	電気機器	32,000	7,136.46	228,366,860	9,805.00	313,760,000	1.02
日本	株式	HOYA	精密機器	26,400	10,585.79	279,464,947	11,860.00	313,104,000	1.02
日本	株式	信越化学工業	化学	22,400	12,325.55	276,092,388	13,685.00	306,544,000	0.99
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	90,800	3,410.38	309,663,006	2,917.50	264,909,000	0.86
日本	株式	村田製作所	電気機器	39,100	6,364.36	248,846,646	6,773.00	264,824,300	0.86
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	104,800	2,774.45	290,762,510	2,473.50	259,222,800	0.84
日本	株式	KDDI	情報・通信業	95,200	3,233.27	307,807,378	2,656.00	252,851,200	0.82
日本	株式	花王	化学	31,900	8,746.16	279,002,805	7,887.00	251,595,300	0.82
日本	株式	ファナック	電気機器	12,500	19,146.51	239,331,434	20,120.00	251,500,000	0.82
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	91,700	2,465.23	226,062,082	2,685.00	246,214,500	0.80
日本	株式	S M C	機械	4,200	50,949.93	213,989,717	58,460.00	245,532,000	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	178,440	1,459.11	260,364,410	1,310.50	233,845,620	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,400	25,056.48	210,474,492	27,330.00	229,572,000	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	64,000	3,877.09	248,133,972	3,543.00	226,752,000	0.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	86,000	2,588.17	222,582,652	2,512.50	216,075,000	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	46,400	5,376.41	249,465,744	4,600.00	213,440,000	0.69
日本	株式	三井物産	卸売業	113,500	1,786.56	202,775,219	1,803.00	204,640,500	0.66
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	13,500	14,252.21	192,404,915	14,740.00	198,990,000	0.65

## 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	0.15
		建設業	2.43
		食料品	3.71
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21

化学	7.19
医薬品	6.39
石油・石炭製品	0.39
ゴム製品	0.54
ガラス・土石製品	0.77
鉄鋼	0.55
非鉄金属	0.64
金属製品	0.56
機械	5.40
電気機器	15.26
輸送用機器	6.92
精密機器	2.70
その他製品	2.76
電気・ガス業	1.41
陸運業	3.68
海運業	0.14
空運業	0.32
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	9.98
卸売業	4.63
小売業	4.98
銀行業	4.65
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	1.83
その他金融業	1.12
不動産業	1.91
サービス業	5.65
合 計	98.41

## 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	34	日本円	544,863,700	552,670,000	1.79

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

## R A M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	38,066,889,841	54.64
	カナダ	1,940,885,207	2.79
	パナマ	10,578,884	0.02
	ドイツ	1,791,278,350	2.57
	イタリア	332,666,095	0.48
	フランス	1,871,092,467	2.69
	オランダ	1,091,102,687	1.57
	スペイン	419,374,342	0.60
	ベルギー	160,118,127	0.23
	オーストリア	25,765,858	0.04
	ルクセンブルク	34,728,547	0.05
	フィンランド	236,949,367	0.34
	アイルランド	1,037,113,907	1.49
	ポルトガル	30,100,565	0.04
	イギリス	2,347,575,474	3.37
	スイス	2,096,999,659	3.01
	スウェーデン	593,506,081	0.85
	ノルウェー	107,295,559	0.15
	デンマーク	477,964,517	0.69
	ケイマン	116,452,970	0.17
	リベリア	16,768,073	0.02
	オーストラリア	1,151,883,191	1.65
	パミューダ	158,861,452	0.23
	ニュージーランド	58,589,707	0.08
	パプアニューギニア	3,096,493	0.00
	香港	450,250,560	0.65
	シンガポール	169,225,160	0.24
	イスラエル	109,174,299	0.16
	キュラソー	30,637,860	0.04
	ジャージー	179,785,823	0.26
マン島	9,590,671	0.01	
小計		55,126,301,793	79.12
投資証券	アメリカ	1,124,459,849	1.61
	カナダ	7,149,637	0.01
	フランス	21,792,346	0.03
	イギリス	24,783,969	0.04
	オーストラリア	83,879,862	0.12

	香港	26,596,001	0.04
	シンガポール	27,628,334	0.04
	小計	1,316,289,998	1.89
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,228,759,944	18.99
合計(純資産総額)		69,671,351,735	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	10,581,163,800	15.19
	買建	ドイツ	2,755,063,466	3.95

(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		358,298,260	0.51

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	224,180	9,579.91	2,147,624,786	12,070.72	2,706,014,458	3.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	93,149	19,586.06	1,824,422,323	21,928.10	2,042,581,332	2.93
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	5,483	253,913.72	1,392,208,953	332,728.30	1,824,349,291	2.62
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	31,154	24,986.43	778,427,520	27,697.38	862,884,239	1.24
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	3,924	158,289.69	621,128,759	155,455.11	610,005,867	0.88
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,892	158,541.55	617,043,720	155,104.91	603,668,333	0.87
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	34,128	15,704.86	535,975,651	15,558.94	530,995,777	0.76
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	38,555	12,412.35	478,558,155	12,619.88	486,559,782	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	32,028	13,368.09	428,153,323	14,522.10	465,114,075	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	21,845	21,544.66	470,643,130	21,100.75	460,945,927	0.66



アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	7,959	36,011.16	286,612,859	55,971.37	445,476,166	0.64
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	9,615	22,970.70	220,863,357	44,337.60	426,306,082	0.61
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	11,575	34,257.19	396,527,069	35,573.13	411,759,026	0.59
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	18,044	22,506.29	406,103,511	22,264.55	401,741,576	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	13,939	25,941.50	361,598,571	28,789.23	401,293,188	0.58
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	39,445	12,485.85	492,504,409	10,088.02	397,922,343	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	12,296	31,567.16	388,149,858	32,179.07	395,673,845	0.57
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	53,764	6,244.82	335,746,807	6,267.59	336,970,816	0.48
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	9,120	37,273.47	339,934,108	36,835.80	335,942,569	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	6,244	42,392.47	264,698,640	51,771.11	323,258,836	0.46
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	23,512	14,023.93	329,730,838	13,267.32	311,941,228	0.45
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	11,655	21,663.43	252,487,358	26,180.21	305,130,348	0.44
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	5,727	44,033.32	252,178,841	52,210.18	299,007,724	0.43
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	14,458	15,517.24	224,348,330	20,578.10	297,518,170	0.43
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	54,829	6,709.23	367,860,526	5,415.90	296,948,491	0.43
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	59,369	4,581.62	272,006,619	4,887.95	290,193,297	0.42
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	32,760	8,892.57	291,320,717	8,665.01	283,866,055	0.41
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	92,649	3,706.70	343,422,147	2,994.14	277,404,077	0.40
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	72,105	4,053.27	292,261,219	3,826.78	275,930,405	0.40
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	52,919	5,620.12	297,411,297	5,175.73	273,894,773	0.39

#### ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	2.16
		素材	3.60
		資本財	5.02
		商業・専門サービス	1.01
		運輸	1.73

	自動車・自動車部品	1.26
	耐久消費財・アパレル	1.57
	消費者サービス	1.25
	メディア・娯楽	5.44
	小売	5.10
	食品・生活必需品小売り	1.26
	食品・飲料・タバコ	3.60
	家庭用品・パーソナル用品	1.82
	ヘルスケア機器・サービス	4.31
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.91
	銀行	3.97
	各種金融	3.39
	保険	2.43
	不動産	0.36
	ソフトウェア・サービス	10.15
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.06
	電気通信サービス	1.65
	公益事業	2.76
	半導体・半導体製造装置	3.31
投資証券		1.89
合計		81.01

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2012	買建	600	米ドル	99,700,812.5	10,548,345,964	100,011,000	10,581,163,800	15.19
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002012	買建	1,233	ユーロ	22,484,510	2,791,901,607	22,187,835	2,755,063,466	3.95

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,100,000.00	327,055,378	327,949,000	0.47
	カナダドル	買建	145,000.00	11,440,849	11,457,900	0.02
	英ポンド	買建	116,000.00	15,766,448	15,785,280	0.02
	スイスフラン	買建	27,000.00	3,079,142	3,106,080	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	31,014,027	0.31
	アルゼンチン	1,321,220	0.01
	メキシコ	126,258,705	1.24
	ブラジル	362,626,389	3.57
	チリ	39,927,148	0.39
	コロンビア	12,403,677	0.12
	ペルー	2,684,421	0.03
	オランダ	30,983,479	0.31
	ルクセンブルク	11,306,655	0.11
	ギリシャ	9,831,000	0.10
	トルコ	26,332,766	0.26
	チェコ	7,635,587	0.08
	ハンガリー	15,283,432	0.15
	ポーランド	51,409,261	0.51
	ロシア	200,329,175	1.97
	ケイマン	2,153,686,155	21.23
	バミューダ	61,476,972	0.61
	香港	181,854,950	1.79
	シンガポール	1,581,079	0.02
	マレーシア	139,170,858	1.37
	タイ	145,523,667	1.43
	フィリピン	58,759,709	0.58
	インドネシア	101,707,945	1.00
	韓国	977,644,178	9.64
	台湾	1,002,446,303	9.88
	中国	901,943,717	8.89
	インド	671,059,637	6.61
	カタール	64,024,796	0.63
	エジプト	8,562,673	0.08
南アフリカ	274,980,183	2.71	
ジャージー	6,989,854	0.07	
アラブ首長国連邦	44,846,118	0.44	
マン島	1,739,917	0.02	

	サウジアラビア	223,519,679	2.20
	小計	7,950,865,332	78.37
投資証券	メキシコ	2,784,469	0.03
	南アフリカ	2,393,245	0.02
	小計	5,177,714	0.05
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,189,309,204	21.58
合計（純資産総額）		10,145,352,250	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,243,783,124	22.12

(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		181,899,280	1.79

(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	22,430	24,062.94	539,731,920	29,299.19	657,180,922	6.48
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	68,500	5,834.96	399,695,150	6,900.07	472,655,137	4.66
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	294,000	1,254.23	368,744,234	1,568.84	461,238,960	4.55
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	57,181	5,287.51	302,345,256	5,284.55	302,176,425	2.98
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	42,600	2,204.72	93,921,174	3,202.29	136,417,554	1.34
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	34,133	2,371.80	80,956,652	3,255.32	111,113,923	1.10
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,210	16,688.00	86,944,510	18,502.93	96,400,304	0.95
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	10,220	5,469.01	55,893,377	7,951.92	81,268,704	0.80
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,153,000	85.48	98,566,420	68.38	78,849,635	0.78
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	71,500	1,219.26	87,177,125	1,084.49	77,541,214	0.76
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	40,855	1,154.51	47,167,719	1,463.05	59,772,908	0.59
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	6,610	8,305.47	54,899,175	7,627.20	50,415,792	0.50

香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	74,000	876.63	64,870,986	668.16	49,444,395	0.49
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	19,738	3,214.04	63,438,836	2,483.99	49,029,093	0.48
ブラジル	株式	VALE SA	素材	44,400	1,026.10	45,559,007	1,095.22	48,628,190	0.48
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	982	40,191.89	39,468,444	47,690.40	46,831,981	0.46
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,959	4,318.45	43,007,509	4,585.40	45,665,999	0.45
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	151,800	317.25	48,158,871	280.28	42,546,504	0.42
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,250	13,436.01	43,667,033	12,968.96	42,149,133	0.42
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	18,000	1,664.27	29,956,920	2,220.40	39,967,200	0.39
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	731,000	72.75	53,187,192	54.46	39,812,819	0.39
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,478	19,642.60	29,031,772	26,922.20	39,791,012	0.39
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	32,945	1,597.09	52,616,276	1,192.36	39,282,498	0.39
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	10,828	3,158.81	34,203,606	3,608.17	39,069,373	0.39
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	4,600	5,878.34	27,040,391	7,906.43	36,369,596	0.36
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	128,400	204.13	26,210,474	273.68	35,140,833	0.35
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	552	39,334.01	21,712,378	59,383.19	32,779,526	0.32
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	72,632	694.78	50,463,670	450.49	32,720,454	0.32
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	61,367	673.94	41,357,852	517.72	31,771,077	0.31
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	12,500	1,860.87	23,260,932	2,522.52	31,531,500	0.31

## 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	4.31
		素材	5.47
		資本財	2.10
		商業・専門サービス	0.25
		運輸	1.08
		自動車・自動車部品	2.04
		耐久消費財・アパレル	1.04
		消費者サービス	1.40
		メディア・娯楽	7.41
		小売	11.02
		食品・生活必需品小売り	1.08

	食品・飲料・タバコ	2.80
	家庭用品・パーソナル用品	0.91
	ヘルスケア機器・サービス	0.98
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.43
	銀行	9.46
	各種金融	1.60
	保険	2.48
	不動産	1.81
	ソフトウェア・サービス	1.75
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.46
	電気通信サービス	2.59
	公益事業	1.53
	半導体・半導体製造装置	6.38
投資証券		0.05
合計		78.42

#### 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 2012	買建	396	米ドル	21,483,090	2,272,910,922	21,207,780	2,243,783,124	22.12

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,162,000.00	122,613,377	122,927,980	1.21
	メキシコペソ	買建	1,100,000.00	5,175,720	5,181,000	0.05
	トルコリラ	買建	300,000.00	4,043,040	4,047,000	0.04
	ポーランドズロチ	買建	150,000.00	4,018,260	4,108,500	0.04
	香港ドル	買建	3,030,000.00	41,248,736	41,329,200	0.41
	南アフリカランド	買建	690,000.00	4,277,448	4,305,600	0.04

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### R A M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	1,680,074,938	32.59
	アイルランド	3,434,433,312	66.62
	小計	5,114,508,250	99.21
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		40,915,777	0.79
合計（純資産総額）		5,155,424,027	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		57,401,654	1.11

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	595,625	6,118.41	3,644,280,338	5,766.09	3,434,433,312	66.62
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	518,437	3,466.41	1,797,116,158	3,240.65	1,680,074,938	32.59

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.21
合計	99.21

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	542,600.00	57,231,820	57,401,654	1.11

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	18,849,764,720	97.03
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		576,376,053	2.97
合計（純資産総額）		19,426,140,773	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	573,979,000	2.95

(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	2,015	800,794.12	1,613,600,163	596,000	1,200,940,000	6.18
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,081	728,603.25	1,516,223,364	538,000	1,119,578,000	5.76
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,148	301,585.79	949,392,097	355,500	1,119,114,000	5.76
日本	投資証券	G L P 投資法人	5,983	142,659.07	853,529,244	162,800	974,032,400	5.01
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,729	170,950.83	1,150,328,173	132,000	888,228,000	4.57
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,969	277,477.59	823,830,989	269,000	798,661,000	4.11
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,146	207,827.29	861,651,981	161,300	668,749,800	3.44
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,909	203,240.96	794,468,912	162,400	634,821,600	3.27
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,976	337,438.47	666,778,420	311,000	614,536,000	3.16
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,941	169,461.48	498,386,217	180,300	530,262,300	2.73
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,450	172,170.51	766,158,806	116,700	519,315,000	2.67
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	6,120	85,012.39	520,275,880	77,600	474,912,000	2.44
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,295	439,224.38	568,795,585	326,500	422,817,500	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	691	680,860.43	470,474,560	607,000	419,437,000	2.16
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	1,043	508,316.17	530,173,770	399,500	416,678,500	2.14
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,360	285,798.21	388,685,566	301,500	410,040,000	2.11
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,319	168,608.06	391,002,108	176,200	408,607,800	2.10



日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	644	781,210.2	503,099,369	629,000	405,076,000	2.09
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,703	63,493.01	425,593,648	51,700	346,545,100	1.78
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,444	170,703.99	417,200,564	136,900	334,583,600	1.72
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	596	516,186.9	307,647,398	502,000	299,192,000	1.54
日本	投資証券	大和証券りピン投資法人	2,625	103,003.59	270,384,436	108,800	285,600,000	1.47
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	908	346,407.73	314,538,226	307,000	278,756,000	1.43
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,700	46,648.93	405,845,732	31,200	271,440,000	1.40
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	443	786,508.22	348,423,142	604,000	267,572,000	1.38
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,110	138,729.09	292,718,384	121,100	255,521,000	1.32
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	1,357	204,602.77	277,645,968	185,900	252,266,300	1.30
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	691	413,651.21	285,832,990	358,000	247,378,000	1.27
日本	投資証券	日本リート投資法人	676	453,895.55	306,833,392	356,500	240,994,000	1.24
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,931	173,992.5	335,979,526	122,900	237,319,900	1.22

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.03
合計	97.03

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	334	日本円	570,660,640	573,979,000	2.95

(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9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	オーストラリア	14,267,610	0.07
投資証券	アメリカ	15,505,999,821	73.46
	カナダ	395,481,668	1.87
	ドイツ	60,679,336	0.29
	イタリア	1,807,411	0.01

	フランス	383,077,960	1.81
	オランダ	36,236,240	0.17
	スペイン	94,528,222	0.45
	ベルギー	297,966,726	1.41
	アイルランド	28,461,334	0.13
	イギリス	1,098,965,733	5.21
	オーストラリア	1,529,516,438	7.25
	ニュージーランド	100,893,515	0.48
	香港	362,928,794	1.72
	シンガポール	945,959,037	4.48
	韓国	18,651,228	0.09
	イスラエル	11,189,165	0.05
	ガーンジー	42,985,998	0.20
	マン島	5,908,796	0.03
	小計	20,921,237,422	99.11
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	173,699,437	0.82
	合計(純資産総額)	21,109,204,469	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		51,632,650	0.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	132,899	9,976.79	1,325,905,451	10,538.73	1,400,587,741	6.63
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,929	68,806.16	1,096,013,341	80,774.06	1,286,650,129	6.10
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	48,442	14,478.94	701,389,227	15,607.61	756,064,134	3.58
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	27,248	22,182.02	604,415,786	23,372.27	636,847,831	3.02
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	74,809	7,231.97	541,016,522	5,766.10	431,356,175	2.04
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	298,253	1,149.04	342,706,128	1,372.40	409,324,863	1.94
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	61,874	7,092.51	438,842,083	6,464.37	399,977,048	1.89
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,232	19,904.12	502,220,959	15,607.61	393,811,367	1.87
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	54,881	11,070.60	607,565,678	6,770.14	371,552,163	1.76
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,053	17,137.49	360,795,651	16,920.59	356,229,265	1.69
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	61,406	7,487.94	459,805,019	5,405.32	331,919,203	1.57
香港	投資証券	LINK REIT	371,400	992.03	368,442,474	849.71	315,583,223	1.50
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	66,996	4,949.69	331,610,029	4,504.96	301,814,568	1.43

アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	100,636	3,059.14	307,860,611	2,962.39	298,124,086	1.41
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	96,645	3,295.89	318,532,170	2,861.88	276,587,359	1.31
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	213,816	1,233.66	263,777,881	1,267.27	270,962,619	1.28
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,225	10,921.65	253,655,366	11,345.99	263,510,664	1.25
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	67,008	3,762.54	252,120,829	3,910.36	262,025,939	1.24
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,647	15,587.15	275,066,523	14,842.68	261,928,809	1.24
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,544	13,232.61	271,850,850	12,202.97	250,697,857	1.19
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,716	28,537.99	334,351,098	21,117.68	247,414,739	1.17
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	95,946	2,467.58	236,754,578	2,474.66	237,433,920	1.12
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	31,473	7,957.49	250,446,119	6,890.75	216,872,701	1.03
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	25,504	12,203.28	311,232,555	8,493.62	216,621,386	1.03
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,504	7,132.60	217,572,955	6,522.56	198,964,475	0.94
アメリカ	投資証券	UDR INC	53,472	4,499.73	240,610,078	3,419.45	182,845,151	0.87
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95,238	2,138.69	203,685,153	1,861.02	177,240,013	0.84
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,340	10,654.89	184,755,870	9,460.63	164,047,428	0.78
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	938,360	227.57	213,545,680	172.11	161,507,896	0.77
アメリカ	投資証券	CYRUSONE INC	21,106	7,224.45	152,479,378	7,561.52	159,593,568	0.76

## 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	不動産	0.07
投資証券			99.11
合計			99.18

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	305,000.00	32,131,445	32,265,950	0.15
	カナダドル	買建	24,000.00	1,891,893	1,896,480	0.01
	ユーロ	買建	25,000.00	3,076,025	3,104,250	0.01
	英ポンド	買建	20,000.00	2,712,770	2,721,600	0.01
	オーストラリアドル	買建	100,000.00	7,470,360	7,548,000	0.04
	シンガポールドル	買建	53,000.00	4,072,366	4,096,370	0.02

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A M マネーマザーファンド

以下の運用状況は2020年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	17,503,666,400	57.67
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		12,848,052,472	42.33
合計(純資産総額)		30,351,718,872	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871回国庫短期証券	3,700,000,000	100.11	3,704,143,000	100.01	3,700,606,800		2020/11/20	12.19
日本	国債証券	第938回国庫短期証券	2,200,000,000	100.02	2,200,594,000	100.03	2,200,682,000		2020/12/21	7.25
日本	国債証券	第940回国庫短期証券	2,000,000,000	100.05	2,001,020,000	100.04	2,000,940,000		2021/1/6	6.59
日本	国債証券	第936回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,441,000	100.03	1,500,462,000		2020/12/14	4.94
日本	国債証券	第934回国庫短期証券	1,500,000,000	100.03	1,500,463,500	100.02	1,500,385,500		2020/12/7	4.94
日本	国債証券	第933回国庫短期証券	1,500,000,000	100.03	1,500,460,500	100.01	1,500,295,500		2020/11/30	4.94
日本	国債証券	第921回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,345,000	100.00	1,500,054,000		2020/10/12	4.94
日本	国債証券	第919回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,360,000	100.00	1,500,019,500		2020/10/5	4.94
日本	国債証券	第928回国庫短期証券	1,000,000,000	100.02	1,000,232,000	100.01	1,000,128,000		2020/11/9	3.30
日本	国債証券	第926回国庫短期証券	600,000,000	100.01	600,113,400	100.01	600,063,000		2020/11/2	1.98
日本	国債証券	第923回国庫短期証券	300,000,000	100.01	300,040,500	100.00	300,017,700		2020/10/19	0.99
日本	国債証券	第864回国庫短期証券	200,000,000	100.10	200,208,200	100.00	200,012,400		2020/10/20	0.66

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	57.67
合計	57.67

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

### 2【換金（解約）手続等】

#### （1）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

#### （2）取扱時間

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

#### （3）解約請求不可日

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

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

#### （4）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、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。

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

- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けられない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。
- ・また基準価額が『確保ライン』まで下落した場合は、償還日までの一定期間において解約請求の受付を中止する場合があります。

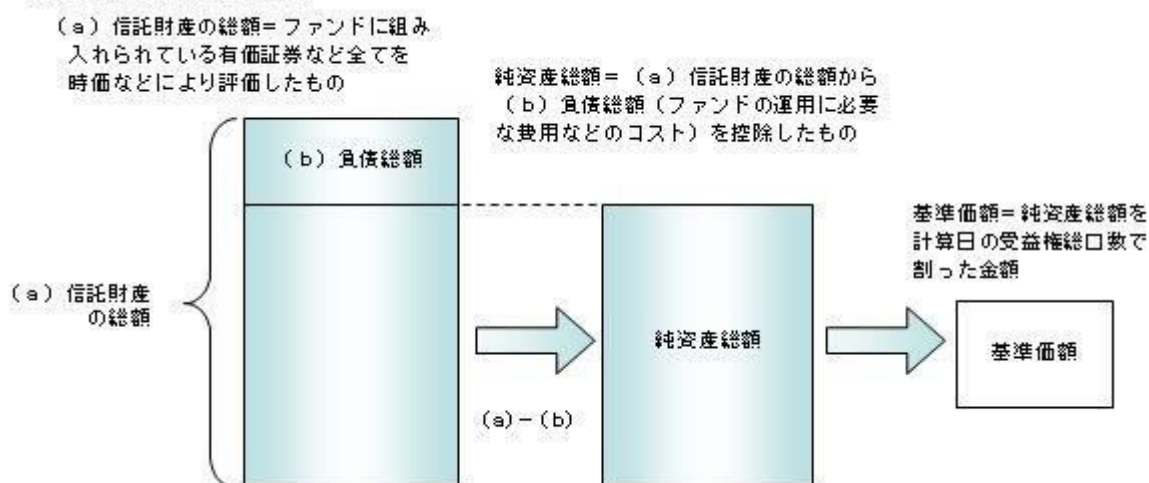
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

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

##### <基準価額算出の流れ>



##### 有価証券などの評価基準

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

##### <主な資産の評価方法>

###### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

###### 国内上場株式

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

###### 外国株式

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

###### 公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日<sup>\*</sup>における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

###### 国内上場不動産投信

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

###### 海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## （2）【保管】

該当事項はありません。

## （3）【信託期間】

2029年9月18日までとします（2019年10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9月16日から翌年9月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

## （5）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき
  - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
  - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合
  - ロ) 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して 50円未満となった場合
  - ハ) 保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき
  - ニ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
  - ホ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ヘ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
  - ト) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

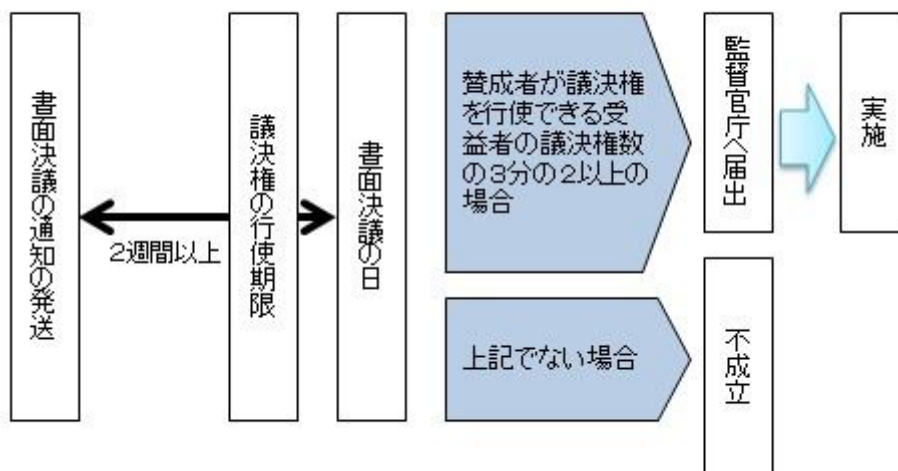
### 信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更（保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。）すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なもの（保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。）または併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

### 書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っ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、知っ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>



### 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

### 運用報告書の作成

- ・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。
- ・交付運用報告書は、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。



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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金・償還金受領権

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

##### (2) 解約請求権

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

##### (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年10月31日から2020年9月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【りそな・リスクコントロールファンド2019 - 10】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2020年 9月15日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		4,186,222,319
親投資信託受益証券		17,447,542,052
流動資産合計		21,633,764,371
資産合計		21,633,764,371
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		23,883,040
未払受託者報酬		2,676,211
未払委託者報酬		32,454,339
未払利息		11,354
その他未払費用		18,788,651
流動負債合計		77,813,595
負債合計		77,813,595
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		22,315,753,854
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		759,803,078
元本等合計		21,555,950,776
純資産合計		21,555,950,776
負債純資産合計		21,633,764,371

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	631,432,346
営業収益合計	631,432,346
営業費用	
支払利息	2,075,016
受託者報酬	6,943,086
委託者報酬	172,771,029
その他費用	48,038,494
営業費用合計	229,827,625
営業利益又は営業損失（ ）	861,259,971
経常利益又は経常損失（ ）	861,259,971
当期純利益又は当期純損失（ ）	861,259,971
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	101,456,893
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	101,456,893
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	759,803,078

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日(2019年10月31日)から2020年9月15日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2020年9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
設定年月日	2019年10月31日
設定元本額	26,468,299,071円
期首元本額	26,468,299,071円
元本残存率	84.3%
2. 計算期間の末日における受益権の総数	22,315,753,854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	759,803,078円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9660円
(10,000口当たり純資産額)	(9,660円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年10月31日 至 2020年9月15日	
分配金の計算過程	
A 当ファンドの配当等収益額	2,075,016円
B 親ファンドの配当等収益額	220,274,758円
RAM国内株式マザーファンド	2,116,669円
RAM国内リートマザーファンド	6,176,560円
RAM先進国株式マザーファンド	26,783,651円
RAM新興国株式マザーファンド	3,702,608円
RAM先進国リートマザーファンド	9,597,617円
RAM国内債券マザーファンド	13,988,273円
RAM新興国債券マザーファンド	11,821,242円
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	147,624,879円
RAMマネーマザーファンド	1,536,741円
C 配当等収益額合計(A+B)	218,199,742円

D 経費	227,752,609円
E 差引配当等収益額(C-D)	9,552,867円
F 当ファンドの当期末残存受益権口数	22,315,753,854口
G 当ファンドの期中平均残存受益権口数	24,303,640,765口
H 分配対象配当等収益額(E×F/G)	0円
I 元本超過額	0円
J 分配可能額(H<I)	0円
K 10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	0円
L 10,000口当たりの分配額	0円
M 収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

<p>第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期 2020年 9月15日現在</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日
該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	202,549,293
合計	202,549,293

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

( 4 ) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	1,599,577,416	1,683,875,145	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	6,311,888,064	6,759,400,927	
	R A M国内株式マザーファンド	212,928,226	247,869,747	
	R A M先進国株式マザーファンド	1,020,794,874	1,422,681,815	
	R A M新興国株式マザーファンド	182,986,013	244,249,730	
	R A M新興国債券マザーファンド	117,502,888	122,590,763	
	R A M国内リートマザーファンド	102,290,023	122,134,287	
	R A M先進国リートマザーファンド	252,360,970	243,326,447	
	R A Mマネーマザーファンド	6,613,979,753	6,601,413,191	
	合計	16,414,308,227	17,447,542,052	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

## RAM国内債券マザーファンド



## 貸借対照表

(単位：円)

2020年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	404,425
コール・ローン	625,403,973
国債証券	73,920,430,950
地方債証券	4,464,600,300
特殊債券	5,399,373,624
社債券	3,808,594,000
未収利息	214,218,382
前払費用	18,683,480
流動資産合計	88,451,709,134
資産合計	88,451,709,134
負債の部	
流動負債	
未払解約金	31,983,000
未払利息	1,696
流動負債合計	31,984,696
負債合計	31,984,696
純資産の部	
元本等	
元本	83,995,022,050
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,424,702,388
元本等合計	88,419,724,438
純資産合計	88,419,724,438
負債純資産合計	88,451,709,134

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	65,239,032,003円
期中追加設定元本額	64,343,431,175円
期中一部解約元本額	45,587,441,128円
期末元本額	83,995,022,050円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,409,283,881円

りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,110,434,951円
りそなラップ型ファンド(成長型)	386,281,430円
DCりそな グローバルバランス	420,713,938円
つみたてバランスファンド	1,638,325,840円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,226,446,675円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	253,699,007円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	59,530,122円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	17,661,744円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,381,190円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	571,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	266,905円
リスクコントロール・オープン	49,940,609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	47,644,767,871円
Smart-i 国内債券インデックス	878,361,782円
Smart-i 8資産バランス 安定型	485,418,350円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	264,660,622円
Smart-i 8資産バランス 成長型	95,553,694円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,137,077,738円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,812,616,838円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,599,577,416円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,047,157,853円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,815,346,089円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	469,881,457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)	10,143,640円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,067,368,018円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	130,157,356円
2. 計算日における受益権の総数	83,995,022,050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	1.0527円
(10,000口当たり純資産額)	(10,527円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

#### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	
	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券
	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお
	ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 9月15日現在	
該当事項はありません。	

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

### （その他の注記）

#### 1 有価証券に関する注記

##### 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		925,492,490
地方債証券		23,424,700
特殊債券		35,774,983

社債券	26,074,000
合計	1,010,766,173

(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405回利付国債(2年)	230,000,000	230,609,500	
	第406回利付国債(2年)	250,000,000	250,717,500	
	第407回利付国債(2年)	330,000,000	331,016,400	
	第408回利付国債(2年)	530,000,000	531,749,000	
	第409回利付国債(2年)	180,000,000	180,633,600	
	第410回利付国債(2年)	410,000,000	411,553,900	
	第411回利付国債(2年)	440,000,000	441,865,600	
	第412回利付国債(2年)	330,000,000	331,580,700	
	第413回利付国債(2年)	550,000,000	552,491,500	
	第414回利付国債(2年)	570,000,000	572,604,900	
	第415回利付国債(2年)	450,000,000	452,110,500	
	第130回利付国債(5年)	240,000,000	240,741,600	
	第131回利付国債(5年)	360,000,000	361,328,400	
	第132回利付国債(5年)	40,000,000	40,172,800	
	第133回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,286,182,400	
	第134回利付国債(5年)	1,060,000,000	1,065,766,400	
	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,006,030,000	
	第136回利付国債(5年)	910,000,000	916,042,400	
	第137回利付国債(5年)	650,000,000	654,615,000	

第138回利付国債(5年)	720,000,000	725,536,800
第139回利付国債(5年)	1,060,000,000	1,068,776,800
第140回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,079,490,900
第141回利付国債(5年)	620,000,000	625,747,400
第142回利付国債(5年)	680,000,000	686,548,400
第143回利付国債(5年)	510,000,000	514,967,400
第144回利付国債(5年)	630,000,000	636,174,000
第1回利付国債(40年)	40,000,000	59,019,600
第2回利付国債(40年)	100,000,000	143,489,000
第3回利付国債(40年)	110,000,000	158,694,800
第4回利付国債(40年)	150,000,000	217,785,000
第5回利付国債(40年)	170,000,000	239,407,600
第6回利付国債(40年)	170,000,000	236,218,400
第7回利付国債(40年)	190,000,000	254,337,800
第8回利付国債(40年)	210,000,000	263,295,900
第9回利付国債(40年)	310,000,000	291,424,800
第10回利付国債(40年)	300,000,000	330,915,000
第11回利付国債(40年)	240,000,000	257,056,800
第12回利付国債(40年)	250,000,000	242,180,000
第13回利付国債(40年)	100,000,000	96,806,000
第319回利付国債(10年)	240,000,000	243,770,400
第320回利付国債(10年)	202,000,000	204,918,900
第321回利付国債(10年)	241,000,000	245,166,890
第322回利付国債(10年)	220,000,000	223,471,600
第323回利付国債(10年)	340,000,000	346,262,800
第324回利付国債(10年)	183,000,000	186,048,780
第325回利付国債(10年)	330,000,000	336,253,500
第326回利付国債(10年)	280,000,000	285,300,400
第327回利付国債(10年)	387,000,000	395,200,530
第328回利付国債(10年)	411,000,000	418,595,280
第329回利付国債(10年)	297,000,000	304,689,330
第330回利付国債(10年)	257,000,000	264,224,270
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,985,400
第332回利付国債(10年)	532,000,000	544,714,800
第333回利付国債(10年)	225,000,000	230,784,750
第334回利付国債(10年)	261,000,000	268,195,770
第335回利付国債(10年)	345,000,000	353,763,000
第336回利付国債(10年)	210,000,000	215,619,600
第337回利付国債(10年)	170,000,000	173,094,000
第338回利付国債(10年)	631,000,000	645,721,230
第339回利付国債(10年)	385,000,000	394,297,750
第340回利付国債(10年)	814,000,000	834,911,660

第341回利付国債(10年)	520,000,000	531,138,400
第342回利付国債(10年)	300,000,000	303,405,000
第343回利付国債(10年)	680,000,000	688,071,600
第344回利付国債(10年)	690,000,000	698,556,000
第345回利付国債(10年)	710,000,000	718,938,900
第346回利付国債(10年)	920,000,000	932,042,800
第347回利付国債(10年)	200,000,000	202,720,000
第348回利付国債(10年)	470,000,000	476,636,400
第349回利付国債(10年)	440,000,000	446,270,000
第350回利付国債(10年)	730,000,000	740,198,100
第351回利付国債(10年)	430,000,000	435,869,500
第352回利付国債(10年)	790,000,000	800,491,200
第353回利付国債(10年)	590,000,000	597,587,400
第354回利付国債(10年)	640,000,000	647,923,200
第355回利付国債(10年)	640,000,000	647,590,400
第356回利付国債(10年)	910,000,000	919,855,300
第357回利付国債(10年)	760,000,000	767,387,200
第358回利付国債(10年)	720,000,000	726,840,000
第359回利付国債(10年)	600,000,000	604,968,000
第1回利付国債(30年)	60,000,000	75,205,800
第7回利付国債(30年)	40,000,000	50,125,600
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,702,000
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,922,400
第13回利付国債(30年)	90,000,000	111,429,900
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,666,400
第15回利付国債(30年)	160,000,000	209,838,400
第16回利付国債(30年)	100,000,000	131,526,000
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,251,000
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,653,200
第19回利付国債(30年)	100,000,000	129,733,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	133,034,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	117,378,900
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,894,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	214,580,800
第24回利付国債(30年)	100,000,000	134,534,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	131,722,000
第26回利付国債(30年)	145,000,000	193,805,550
第27回利付国債(30年)	215,000,000	292,264,550
第28回利付国債(30年)	110,000,000	150,376,600
第29回利付国債(30年)	70,000,000	94,875,200
第30回利付国債(30年)	190,000,000	255,506,300
第31回利付国債(30年)	130,000,000	173,486,300
第32回利付国債(30年)	215,000,000	292,354,850

第33回利付国債(30年)	230,000,000	300,968,800	
第34回利付国債(30年)	255,000,000	345,262,350	
第35回利付国債(30年)	316,000,000	416,822,960	
第36回利付国債(30年)	305,000,000	403,637,000	
第37回利付国債(30年)	320,000,000	418,371,200	
第38回利付国債(30年)	220,000,000	283,888,000	
第39回利付国債(30年)	220,000,000	289,137,200	
第40回利付国債(30年)	155,000,000	200,725,000	
第41回利付国債(30年)	195,000,000	248,679,600	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	242,550,200	
第43回利付国債(30年)	100,000,000	127,790,000	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	230,252,400	
第45回利付国債(30年)	220,000,000	271,713,200	
第46回利付国債(30年)	240,000,000	296,604,000	
第47回利付国債(30年)	230,000,000	289,889,700	
第48回利付国債(30年)	253,000,000	307,377,290	
第49回利付国債(30年)	230,000,000	279,558,100	
第50回利付国債(30年)	250,000,000	268,177,500	
第51回利付国債(30年)	390,000,000	370,929,000	
第52回利付国債(30年)	230,000,000	229,471,000	
第53回利付国債(30年)	220,000,000	224,584,800	
第54回利付国債(30年)	230,000,000	246,148,300	
第55回利付国債(30年)	170,000,000	181,821,800	
第56回利付国債(30年)	220,000,000	235,144,800	
第57回利付国債(30年)	230,000,000	245,667,600	
第58回利付国債(30年)	350,000,000	373,583,000	
第59回利付国債(30年)	220,000,000	229,048,600	
第60回利付国債(30年)	190,000,000	207,651,000	
第61回利付国債(30年)	220,000,000	228,628,400	
第62回利付国債(30年)	220,000,000	217,021,200	
第63回利付国債(30年)	210,000,000	201,177,900	
第64回利付国債(30年)	180,000,000	172,166,400	
第65回利付国債(30年)	150,000,000	143,245,500	
第66回利付国債(30年)	230,000,000	219,291,200	
第67回利付国債(30年)	140,000,000	140,709,800	
第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,566,800	
第54回利付国債(20年)	180,000,000	185,328,000	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	103,245,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,377,300	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	113,956,700	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	104,113,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,664,000	

第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,044,000
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,427,000
第62回利付国債(20年)	80,000,000	82,071,200
第63回利付国債(20年)	60,000,000	63,214,800
第64回利付国債(20年)	120,000,000	127,363,200
第65回利付国債(20年)	380,000,000	405,254,800
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,430,200
第68回利付国債(20年)	90,000,000	97,387,200
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,713,600
第70回利付国債(20年)	110,000,000	120,511,600
第71回利付国債(20年)	100,000,000	108,801,000
第72回利付国債(20年)	210,000,000	228,834,900
第73回利付国債(20年)	180,000,000	196,340,400
第75回利付国債(20年)	100,000,000	110,034,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	109,128,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,916,200
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,781,500
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,008,200
第80回利付国債(20年)	90,000,000	99,467,100
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,180,900
第82回利付国債(20年)	170,000,000	188,881,900
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,163,300
第84回利付国債(20年)	120,000,000	133,324,800
第85回利付国債(20年)	150,000,000	168,273,000
第86回利付国債(20年)	100,000,000	113,289,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	101,461,500
第88回利付国債(20年)	185,000,000	210,716,850
第89回利付国債(20年)	120,000,000	135,986,400
第90回利付国債(20年)	170,000,000	193,643,600
第91回利付国債(20年)	80,000,000	91,610,400
第92回利付国債(20年)	255,000,000	290,248,650
第93回利付国債(20年)	80,000,000	90,972,800
第94回利付国債(20年)	140,000,000	160,119,400
第95回利付国債(20年)	185,000,000	215,140,200
第96回利付国債(20年)	70,000,000	80,451,700
第97回利付国債(20年)	130,000,000	151,057,400
第98回利付国債(20年)	70,000,000	80,844,400
第99回利付国債(20年)	85,000,000	98,603,400
第100回利付国債(20年)	151,000,000	177,000,690
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,745,800
第102回利付国債(20年)	145,000,000	172,940,050
第103回利付国債(20年)	100,000,000	118,489,000
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,692,800



第105回利付国債(20年)	12,000,000	14,086,440	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	47,276,800	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	94,266,400	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	255,582,800	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	93,287,200	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	230,718,150	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,818,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	243,451,850	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	101,266,450	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	191,201,600	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	120,428,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	169,281,000	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	269,919,000	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	156,415,310	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	176,176,500	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	231,002,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	243,382,150	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	223,677,500	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	320,779,850	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	240,054,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	146,965,200	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	120,381,000	
第127回利付国債(20年)	70,000,000	83,535,200	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	269,111,250	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	213,366,600	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	213,791,400	
第131回利付国債(20年)	170,000,000	200,057,700	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	200,509,900	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	291,699,450	
第134回利付国債(20年)	205,000,000	244,644,950	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,280,400	
第136回利付国債(20年)	110,000,000	128,769,300	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	201,376,900	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,522,400	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	211,134,600	
第140回利付国債(20年)	380,000,000	451,086,600	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	220,050,100	
第142回利付国債(20年)	200,000,000	240,306,000	
第143回利付国債(20年)	205,000,000	241,787,250	
第144回利付国債(20年)	280,000,000	326,804,800	
第145回利付国債(20年)	405,000,000	483,586,200	
第146回利付国債(20年)	400,000,000	478,512,000	

	第147回利付国債(20年)	395,000,000	468,248,800
	第148回利付国債(20年)	405,000,000	475,490,250
	第149回利付国債(20年)	380,000,000	446,743,200
	第150回利付国債(20年)	430,000,000	500,322,200
	第151回利付国債(20年)	445,000,000	505,996,150
	第152回利付国債(20年)	440,000,000	500,618,800
	第153回利付国債(20年)	340,000,000	391,928,200
	第154回利付国債(20年)	208,000,000	236,930,720
	第155回利付国債(20年)	350,000,000	388,300,500
	第156回利付国債(20年)	430,000,000	437,993,700
	第157回利付国債(20年)	280,000,000	276,200,400
	第158回利付国債(20年)	260,000,000	268,353,800
	第159回利付国債(20年)	330,000,000	345,615,600
	第160回利付国債(20年)	350,000,000	372,018,500
	第161回利付国債(20年)	290,000,000	303,398,000
	第162回利付国債(20年)	280,000,000	292,647,600
	第163回利付国債(20年)	330,000,000	344,830,200
	第164回利付国債(20年)	490,000,000	503,367,200
	第165回利付国債(20年)	330,000,000	338,556,900
	第166回利付国債(20年)	490,000,000	519,057,000
	第167回利付国債(20年)	360,000,000	368,632,800
	第168回利付国債(20年)	350,000,000	351,816,500
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	276,318,000
	第170回利付国債(20年)	370,000,000	364,749,700
	第171回利付国債(20年)	270,000,000	265,882,500
	第172回利付国債(20年)	330,000,000	330,897,600
	第173回利付国債(20年)	340,000,000	340,622,200
	国債証券合計	68,517,000,000	73,920,430,950
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	116,804,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,563,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,228,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,283,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,179,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,969,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,962,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,780,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,164,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,907,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,649,900
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,377,000
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,329,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,977,000

	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,878,000	
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,152,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,615,000	
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,544,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,118,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,204,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,665,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,071,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	118,729,000	
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,599,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,150,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,668,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,859,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,378,000	
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,587,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,353,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,412,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,276,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,053,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,207,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,314,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,623,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,135,000	
	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	102,178,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,388,400	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,000,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,985,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,305,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,464,600,300	
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	101,998,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,471,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,963,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,598,000	
	第27回道路債券	100,000,000	108,341,000	
	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	116,755,380	
	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	129,764,790	
	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	101,973,000	
	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	102,298,000	

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	105,772,760	
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	135,214,450	
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	100,700,000	
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,043,000	
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	101,310,000	
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	100,760,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	127,495,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	110,133,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,711,450	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,919,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,641,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,220,900	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,414,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,551,490	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,158,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,233,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,710,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,029,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	114,099,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	91,315,000	91,000,876	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	96,984,000	96,949,085	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,351,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,790,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,230,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,139,000	88,205,581	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,120,000	87,942,412	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,351,000	89,045,438	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,941,000	88,758,851	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,181,000	91,799,207	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,047,000	93,238,088	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,664,000	95,899,387	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,297,000	98,249,817	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	64,271,000	64,218,297	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	66,918,000	66,909,300	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	71,029,000	71,068,065	
第327回信金中金債	100,000,000	100,065,000	
第340回信金中金債	100,000,000	100,164,000	
第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,297,000	
第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,012,000	

	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,075,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,829,000	
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,999,000	
	特殊債券合計	5,181,257,000	5,399,373,624	
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	98,683,000	
	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	100,251,000	
	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	98,494,000	
	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	99,944,000	
	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	99,713,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,836,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,215,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,854,000	
	第12回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,691,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,245,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,030,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,033,000	
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,538,000	
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,876,000	
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,019,000	
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,758,000	
	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	98,457,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,132,000	
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,848,000	
	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	98,187,000	
	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	100,210,000	
	第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,014,000	
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,839,000	
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,327,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,347,000	
	第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,601,000	
	第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,172,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,147,000	
	第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,796,000	

第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,906,000	
第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,180,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,019,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,892,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,397,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,864,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,436,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	101,468,000	
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	100,175,000	
社債券合計	3,800,000,000	3,808,594,000	
合計		87,592,998,874	

## 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 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	118,741,041
コール・ローン	1,771,376,456
国債証券	183,492,021,503
派生商品評価勘定	642,269,716
未収入金	21,321
未収利息	882,804,477
前払費用	149,643,202
流動資産合計	187,056,877,716
資産合計	
187,056,877,716	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	236,138,562
未払金	55,326,305
未払解約金	100,023,000
未払利息	4,804
流動負債合計	391,492,671
負債合計	
391,492,671	
純資産の部	
元本等	
元本	174,303,735,274

2020年 9月15日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,361,649,771
元本等合計	186,665,385,045
純資産合計	186,665,385,045
負債純資産合計	187,056,877,716

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	134,058,130,758円
期中追加設定元本額	185,083,110,685円
期中一部解約元本額	144,837,506,169円
期末元本額	174,303,735,274円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	14,767,606,459円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	7,171,427,909円
りそなラップ型ファンド(成長型)	895,110,714円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,203,729,193円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	248,991,609円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	58,300,088円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	17,358,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,299,209円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	563,264円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	262,752円
リスクコントロール・オープン	196,951,344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）	86,919,517,891円
Smart-i 先進国債券インデックス（為替ヘッジあり）	683,578,903円
Smart-i 8資産バランス 安定型	477,249,079円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	259,764,007円
Smart-i 8資産バランス 成長型	94,091,036円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	12,352,245,011円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	11,098,503,110円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	6,311,888,064円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	4,103,694,701円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	11,089,193,399円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,851,948,999円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり（適格機関投資家専用）	7,284,066,437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）	9,987,848円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	5,038,496,255円
りそなFT RCバランスファンド（適格機関投資家専用）	83,887,635円
2. 計算日における受益権の総数	174,303,735,274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	1.0709円
(10,000口当たり純資産額)	(10,709円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### （金融商品に関する注記）

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項



2020年 9月15日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 9月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		3,620,778,607
合計		3,620,778,607

(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 9月15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	183,709,055,464	-	183,302,924,310	406,131,154
	米ドル	80,200,206,717	-	80,384,744,300	184,537,583
	カナダドル	3,564,555,397	-	3,547,163,200	17,392,197
	メキシコペソ	1,402,586,050	-	1,450,563,060	47,977,010
	ユーロ	76,188,271,151	-	76,106,212,000	82,059,151
	英ポンド	12,197,817,209	-	11,763,311,910	434,505,299
	スウェーデンクローナ	584,426,294	-	574,910,000	9,516,294
	ノルウェークローネ	409,774,381	-	398,801,920	10,972,461
	デンマーククローネ	979,014,628	-	978,341,910	672,718
	ポーランドズロチ	1,224,043,203	-	1,202,145,750	21,897,453
	オーストラリアドル	4,558,221,115	-	4,511,751,420	46,469,695
	シンガポールドル	810,592,620	-	809,046,160	1,546,460
	マレーシアリングット	836,408,016	-	838,111,200	1,703,184
	イスラエルシェケル	753,138,683	-	737,821,480	15,317,203
	合計		183,709,055,464	-	183,302,924,310

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	2,210,000.00	2,230,931.79	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,633,970.04	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,052,234.80	
		US TREASURY N/B	3,230,000.00	3,263,184.37	
		US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,429,152.71	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,056,982.80	
		US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,397,581.99	
		US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,290,625.00	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,365,843.75	
		US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,208,196.71	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,063,750.00	
		US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,394,778.82	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,276,864.78	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,252,749.76	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,474,437.44	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,819,753.12	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,548,046.75	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,125,937.20	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,394,246.03	
		US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,672,395.18	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,051,093.60	
		US TREASURY N/B	7,560,000.00	7,759,630.87	
		US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,231,519.50	
		US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,788,391.50	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,014,433.50	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,787,687.36	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,357,140.51	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,817,361.30	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,265,605.15	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,100,312.50	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,247,487.50	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,519,288.94	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,529,351.88	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,823,691.20	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,078,999.14	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,876,890.52	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,499,609.25	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,187,368.85	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,418,699.11	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,954,921.78	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,999,218.40	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,264,882.62	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,504,510.75	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,046,220.44	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,999,648.40	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,828,203.12	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,565,527.25	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,419,340.50	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,759,796.91	
US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,513,381.73	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,580,262.79	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,801,647.50	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,543,792.04	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,288,062.50	
US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,881,622.24	
US TREASURY N/B	5,080,000.00	5,243,214.81	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,351,690.15	
US TREASURY N/B	7,750,000.00	8,009,442.87	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,641,534.26	

US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,403,722.59	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,450,067.04	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,632,040.88	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,837,264.72	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,544,589.75	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,376,816.32	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,591,288.95	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,213,645.96	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,490,632.69	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,509,912.00	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,713,872.98	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,422,118.23	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,555,857.29	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,897,790.65	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,142,319.45	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,926,597.60	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,459,298.78	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,267,884.29	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,373,015.05	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,998,437.40	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,166,035.13	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,567,989.51	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,898,441.24	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,403,556.19	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,293,078.12	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,106,025.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,974,191.24	
US TREASURY N/B	800,000.00	867,624.96	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,927,604.20	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,571,722.62	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,455,392.77	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,051,174.97	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,917,740.15	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,648,633.16	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,568,281.16	

US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,920,796.74
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,614,559.31
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,716,140.62
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,472,068.57
US TREASURY N/B	800,000.00	859,593.68
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,332,293.31
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,349,251.47
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,609,998.18
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,688,827.99
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,589,670.22
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,239,374.80
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,626,962.82
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,813,662.36
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,582,203.03
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,713,921.81
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,903,390.55
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,622,485.75
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,368,749.76
US TREASURY N/B	4,760,000.00	5,161,252.76
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,403,847.64
US TREASURY N/B	7,600,000.00	8,007,905.68
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,195,175.74
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,047,890.34
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,879,236.68
US TREASURY N/B	6,770,000.00	7,108,235.29
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,580,205.02
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,556,683.45
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,802,567.77
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,847,379.62
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,678,335.70
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,293,618.79
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,773,443.20
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,420,332.70
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,371,832.68
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,649,273.20

US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,534,941.35	
US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,018,702.30	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,748,429.29	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,121,081.98	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,761,182.27	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,503,960.80	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	6,129,610.65	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,949,915.49	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,907,652.28	
US TREASURY N/B	3,820,000.00	4,291,978.57	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,288,308.53	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,901,277.28	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,952,957.25	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,784,960.75	
US TREASURY N/B	4,710,000.00	5,050,370.97	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,973,375.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,937,199.05	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,830,343.62	
US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,872,614.31	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,051,900.00	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,171,250.00	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,710,476.46	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	3,526,485.77	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,744,138.64	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,253,242.00	
US TREASURY N/B	4,470,000.00	4,779,931.47	
US TREASURY N/B	2,730,000.00	3,050,241.55	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,045,820.30	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,838,226.44	
US TREASURY N/B	3,150,000.00	3,166,549.78	
US TREASURY N/B	3,120,000.00	3,521,700.00	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,114,531.25	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,514,765.45	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	6,234,644.11	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,900,935.87	

US TREASURY N/B	4,850,000.00	5,652,523.19
US TREASURY N/B	5,590,000.00	6,589,430.51
US TREASURY N/B	220,000.00	305,567.96
US TREASURY N/B	5,870,000.00	6,943,109.37
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,820,043.26
US TREASURY N/B	530,000.00	736,037.50
US TREASURY N/B	5,640,000.00	6,598,579.47
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,772,850.65
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,251,304.59
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,079,683.27
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,807,937.50
US TREASURY N/B	780,000.00	1,194,161.67
US TREASURY N/B	7,320,000.00	7,305,130.87
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,141,097.49
US TREASURY N/B	610,000.00	901,727.68
US TREASURY N/B	540,000.00	821,179.67
US TREASURY N/B	130,000.00	211,767.95
US TREASURY N/B	690,000.00	1,066,858.54
US TREASURY N/B	520,000.00	816,339.05
US TREASURY N/B	960,000.00	1,354,837.44
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,988,413.99
US TREASURY N/B	1,340,000.00	2,129,186.70
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,512,562.40
US TREASURY N/B	780,000.00	1,262,625.00
US TREASURY N/B	950,000.00	1,498,958.92
US TREASURY N/B	4,770,000.00	4,729,753.12
US TREASURY N/B	1,410,000.00	2,099,027.23
US TREASURY N/B	1,750,000.00	1,728,398.35
US TREASURY N/B	770,000.00	1,202,673.78
US TREASURY N/B	900,000.00	1,493,507.79
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,799,657.31
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,596,206.19
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,415,131.22
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,828,471.80
US TREASURY N/B	1,550,000.00	2,075,849.59



US TREASURY N/B	1,640,000.00	2,117,201.46	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,399,617.80	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	3,057,774.94	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,157,124.88	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,569,442.06	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,382,760.76	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,740,844.43	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,855,080.69	
US TREASURY N/B	2,850,000.00	3,912,515.62	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,235,218.72	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,945,460.83	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,783,500.00	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,965,604.11	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,823,963.99	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,768,582.64	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	3,008,075.24	
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,878,417.72	
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,832,700.00	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,924,527.21	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,819,544.45	
US TREASURY N/B	2,370,000.00	3,107,847.59	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,482,027.56	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	8,653,393.98	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,566,715.49	
US TREASURY N/B	5,050,000.00	6,957,163.81	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	5,292,703.07	
US TREASURY N/B	3,780,000.00	5,225,554.40	
US TREASURY N/B	3,870,000.00	5,239,616.99	
US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,825,940.76	
US TREASURY N/B	4,150,000.00	5,127,519.22	
US TREASURY N/B	3,860,000.00	4,419,700.00	
US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,478,679.26	
US TREASURY N/B	980,000.00	972,343.75	
米ドル 小計	684,810,000.00	758,970,431.83	(80,253,533,461)

カナダドル	GOV OF CANADA	1,680,000.00	1,689,676.80	
	GOV OF CANADA	830,000.00	840,159.20	
	GOV OF CANADA	610,000.00	621,095.90	
	GOV OF CANADA	1,450,000.00	1,456,713.50	
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,123,353.00	
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,126,958.40	
	GOV OF CANADA	2,050,000.00	2,051,619.50	
	GOV OF CANADA	2,280,000.00	2,315,271.60	
	GOV OF CANADA	170,000.00	170,107.10	
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,877,132.90	
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,209,592.80	
	GOV OF CANADA	1,480,000.00	1,555,790.80	
	GOV OF CANADA	840,000.00	896,910.00	
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,276,205.40	
	GOV OF CANADA	980,000.00	1,026,491.20	
	GOV OF CANADA	1,290,000.00	1,343,728.50	
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,199,099.00	
	GOV OF CANADA	2,990,000.00	3,016,252.20	
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,225,681.50	
	GOV OF CANADA	1,530,000.00	1,593,510.30	
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,119,590.00	
	GOV OF CANADA	350,000.00	507,178.00	
	GOV OF CANADA	1,660,000.00	1,911,705.80	
	GOV OF CANADA	2,420,000.00	2,584,414.80	
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,534,981.50	
	GOV OF CANADA	830,000.00	1,370,081.00	
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,574,780.00	
GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,817,688.60		
GOV OF CANADA	1,280,000.00	1,816,128.00		
GOV OF CANADA	1,470,000.00	1,841,571.90		
GOV OF CANADA	370,000.00	591,544.90		
	カナダドル 小計	39,270,000.00	44,285,014.10	(3,551,658,130)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	18,950,000.00	19,581,355.25	
	UNITED MEXICAN STATE	24,320,000.00	25,125,614.59	

	UNITED MEXICAN STATE	14,250,000.00	14,968,770.00
	UNITED MEXICAN STATE	20,840,000.00	22,905,452.40
	UNITED MEXICAN STATE	18,480,000.00	20,592,264.00
	UNITED MEXICAN STATE	22,670,000.00	27,048,030.40
	UNITED MEXICAN STATE	15,420,000.00	15,865,483.80
	UNITED MEXICAN STATE	25,110,000.00	28,096,081.20
	UNITED MEXICAN STATE	24,110,000.00	28,764,917.70
	UNITED MEXICAN STATE	11,846,000.00	13,570,540.68
	UNITED MEXICAN STATE	7,560,000.00	8,647,203.60
	UNITED MEXICAN STATE	6,300,000.00	8,562,141.00
	UNITED MEXICAN STATE	15,320,000.00	18,341,104.00
	UNITED MEXICAN STATE	16,400,000.00	18,116,260.00
	UNITED MEXICAN STATE	13,890,000.00	15,676,948.50
	メキシコペソ 小計	255,466,000.00	285,862,167.12 (1,432,169,457)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	1,360,000.00	1,416,351.60
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	748,563.20
	GOV OF AUSTRIA	720,000.00	729,946.08
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	948,374.82
	GOV OF AUSTRIA	420,000.00	427,241.64
	GOV OF AUSTRIA	830,000.00	845,602.34
	GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,053,904.74
	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	707,139.60
	GOV OF AUSTRIA	900,000.00	986,462.10
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,028,702.16
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	1,136,636.73
	GOV OF AUSTRIA	1,080,000.00	1,167,738.31
	GOV OF AUSTRIA	820,000.00	875,042.50
	GOV OF AUSTRIA	820,000.00	1,205,619.76
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	993,938.40
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,012,521.00
	GOV OF AUSTRIA	670,000.00	690,885.96
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	945,145.60
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	2,053,696.09
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	1,015,773.01
	GOV OF AUSTRIA	640,000.00	859,052.16

GOV OF AUSTRIA	350,000.00	403,066.65
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	823,980.50
GOV OF AUSTRIA	500,000.00	1,036,134.50
GOV OF AUSTRIA	200,000.00	316,739.20
GOV OF BELGIUM	1,240,000.00	1,302,433.73
GOV OF BELGIUM	1,210,000.00	1,296,999.00
GOV OF BELGIUM	1,410,000.00	1,552,003.92
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,232,450.58
GOV OF BELGIUM	760,000.00	780,064.00
GOV OF BELGIUM	1,330,000.00	1,493,539.72
GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,223,856.27
GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,515,104.20
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,192,997.49
GOV OF BELGIUM	1,310,000.00	1,426,167.78
GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,270,088.82
GOV OF BELGIUM	870,000.00	896,305.32
GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	2,207,078.00
GOV OF BELGIUM	1,400,000.00	1,531,443.20
GOV OF BELGIUM	1,340,000.00	1,484,732.06
GOV OF BELGIUM	960,000.00	992,419.20
GOV OF BELGIUM	1,120,000.00	1,262,813.44
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,037,715.00
GOV OF BELGIUM	720,000.00	843,292.80
GOV OF BELGIUM	800,000.00	1,133,411.20
GOV OF BELGIUM	1,610,000.00	2,777,555.39
GOV OF BELGIUM	490,000.00	595,859.60
GOV OF BELGIUM	680,000.00	884,059.84
GOV OF BELGIUM	480,000.00	490,986.24
GOV OF BELGIUM	1,450,000.00	2,592,056.37
GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,398,331.74
GOV OF BELGIUM	970,000.00	1,254,553.76
GOV OF BELGIUM	720,000.00	963,867.74
GOV OF BELGIUM	470,000.00	738,123.33
GOV OF BELGIUM	550,000.00	897,894.25
GOV OF FINLAND	430,000.00	434,389.87

GOV OF FINLAND	530,000.00	554,305.80	
GOV OF FINLAND	340,000.00	359,105.28	
GOV OF FINLAND	670,000.00	683,135.35	
GOV OF FINLAND	510,000.00	559,115.55	
GOV OF FINLAND	280,000.00	287,178.64	
GOV OF FINLAND	520,000.00	637,673.92	
GOV OF FINLAND	360,000.00	386,991.00	
GOV OF FINLAND	510,000.00	540,658.14	
GOV OF FINLAND	550,000.00	588,471.11	
GOV OF FINLAND	430,000.00	538,920.72	
GOV OF FINLAND	360,000.00	387,138.60	
GOV OF FINLAND	480,000.00	517,757.99	
GOV OF FINLAND	350,000.00	389,302.90	
GOV OF FINLAND	390,000.00	457,850.25	
GOV OF FINLAND	250,000.00	257,307.37	
GOV OF FINLAND	320,000.00	332,662.40	
GOV OF FINLAND	380,000.00	593,823.82	
GOV OF FINLAND	330,000.00	439,898.29	
GOV OF FRANCE	2,940,000.00	3,067,407.24	
GOV OF FRANCE	2,580,000.00	2,603,968.20	
GOV OF FRANCE	3,980,000.00	4,214,628.96	
GOV OF FRANCE	2,860,000.00	2,891,256.94	
GOV OF FRANCE	3,320,000.00	3,524,276.28	
GOV OF FRANCE	2,000,000.00	2,030,230.00	
GOV OF FRANCE	3,490,000.00	3,545,452.61	
GOV OF FRANCE	3,960,000.00	4,216,449.60	
GOV OF FRANCE	3,830,000.00	4,418,977.40	
GOV OF FRANCE	3,730,000.00	3,811,713.11	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,354,210.00	
GOV OF FRANCE	3,220,000.00	3,541,688.94	
GOV OF FRANCE	3,620,000.00	3,714,461.72	
GOV OF FRANCE	3,220,000.00	3,385,293.54	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,046,757.68	
GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,321,841.31	
GOV OF FRANCE	2,470,000.00	2,539,782.44	

GOV OF FRANCE	3,770,000.00	4,637,593.87	
GOV OF FRANCE	2,880,000.00	3,050,334.72	
GOV OF FRANCE	2,960,000.00	3,097,651.24	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,329,879.10	
GOV OF FRANCE	4,230,000.00	5,210,632.44	
GOV OF FRANCE	3,620,000.00	3,943,403.56	
GOV OF FRANCE	3,350,000.00	3,659,339.00	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,201,255.92	
GOV OF FRANCE	2,620,000.00	2,810,914.16	
GOV OF FRANCE	3,380,000.00	3,468,721.62	
GOV OF FRANCE	4,440,000.00	5,646,436.80	
GOV OF FRANCE	1,540,000.00	1,572,460.12	
GOV OF FRANCE	4,090,000.00	4,839,214.38	
GOV OF FRANCE	2,450,000.00	4,220,431.97	
GOV OF FRANCE	3,120,000.00	3,667,313.52	
GOV OF FRANCE	2,540,000.00	4,319,905.00	
GOV OF FRANCE	3,000,000.00	3,554,457.00	
GOV OF FRANCE	2,160,000.00	3,666,744.72	
GOV OF FRANCE	2,300,000.00	2,979,884.60	
GOV OF FRANCE	590,000.00	621,536.68	
GOV OF FRANCE	3,130,000.00	5,838,927.36	
GOV OF FRANCE	2,170,000.00	3,668,927.50	
GOV OF FRANCE	2,320,000.00	3,293,399.14	
GOV OF FRANCE	2,330,000.00	3,012,079.54	
GOV OF FRANCE	1,290,000.00	1,386,243.03	
GOV OF FRANCE	1,360,000.00	2,871,786.88	
GOV OF FRANCE	1,380,000.00	3,072,639.00	
GOV OF FRANCE	1,100,000.00	1,621,580.18	
GOV OF GERMANY	1,800,000.00	1,851,217.20	
GOV OF GERMANY	1,110,000.00	1,117,387.05	
GOV OF GERMANY	1,880,000.00	1,893,420.38	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,159,766.95	
GOV OF GERMANY	1,830,000.00	1,896,041.04	
GOV OF GERMANY	1,940,000.00	1,959,678.19	
GOV OF GERMANY	1,540,000.00	1,556,963.10	

GOV OF GERMANY	800,000.00	809,704.80	
GOV OF GERMANY	1,910,000.00	1,995,112.46	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,161,402.92	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	1,877,503.95	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	2,025,100.80	
GOV OF GERMANY	1,560,000.00	1,589,952.00	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	1,972,131.96	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	2,421,171.20	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,117,848.05	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,194,544.16	
GOV OF GERMANY	2,010,000.00	2,063,381.58	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,188,157.93	
GOV OF GERMANY	1,440,000.00	1,539,308.16	
GOV OF GERMANY	1,970,000.00	2,028,834.05	
GOV OF GERMANY	3,050,000.00	3,217,923.85	
GOV OF GERMANY	1,590,000.00	1,642,311.00	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,693,081.60	
GOV OF GERMANY	800,000.00	828,674.40	
GOV OF GERMANY	2,600,000.00	2,773,152.20	
GOV OF GERMANY	2,990,000.00	3,115,047.78	
GOV OF GERMANY	2,600,000.00	2,757,874.60	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,515,115.14	
GOV OF GERMANY	2,380,000.00	2,574,196.10	
GOV OF GERMANY	1,280,000.00	1,338,142.72	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,911,366.60	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,508,699.27	
GOV OF GERMANY	1,190,000.00	1,702,978.06	
GOV OF GERMANY	2,000,000.00	2,139,438.00	
GOV OF GERMANY	2,570,000.00	2,755,302.14	
GOV OF GERMANY	2,560,000.00	2,689,489.92	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,222,812.26	
GOV OF GERMANY	2,410,000.00	2,530,357.81	
GOV OF GERMANY	1,210,000.00	1,269,486.02	
GOV OF GERMANY	1,610,000.00	2,635,516.87	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,875,907.84	

GOV OF GERMANY	1,020,000.00	1,062,504.42	
GOV OF GERMANY	2,330,000.00	4,009,996.40	
GOV OF GERMANY	1,640,000.00	3,066,157.12	
GOV OF GERMANY	1,900,000.00	3,826,596.20	
GOV OF GERMANY	1,740,000.00	3,074,814.90	
GOV OF GERMANY	2,330,000.00	3,823,105.94	
GOV OF GERMANY	2,630,000.00	4,424,677.81	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,834,177.76	
GOV OF GERMANY	1,270,000.00	1,285,266.67	
GOV OF IRELAND	560,000.00	571,564.00	
GOV OF IRELAND	440,000.00	445,216.20	
GOV OF IRELAND	680,000.00	757,115.40	
GOV OF IRELAND	680,000.00	775,057.20	
GOV OF IRELAND	970,000.00	1,229,831.96	
GOV OF IRELAND	940,000.00	1,017,127.94	
GOV OF IRELAND	530,000.00	548,942.20	
GOV OF IRELAND	650,000.00	709,306.00	
GOV OF IRELAND	810,000.00	901,856.26	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,035,238.25	
GOV OF IRELAND	510,000.00	525,735.48	
GOV OF IRELAND	410,000.00	472,032.50	
GOV OF IRELAND	420,000.00	487,950.96	
GOV OF IRELAND	390,000.00	405,143.57	
GOV OF IRELAND	490,000.00	610,045.33	
GOV OF IRELAND	760,000.00	1,049,738.60	
GOV OF IRELAND	420,000.00	535,190.88	
GOV OF ITALY	2,130,000.00	2,232,475.79	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	1,664,431.74	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	2,597,213.76	
GOV OF ITALY	2,150,000.00	2,213,529.27	
GOV OF ITALY	690,000.00	742,552.47	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,164,040.09	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,668,930.92	
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,409,062.80	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,437,719.19	



GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,121,619.14	
GOV OF ITALY	1,450,000.00	1,495,357.45	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,633,008.54	
GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,654,241.16	
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,403,161.26	
GOV OF ITALY	1,470,000.00	1,506,015.00	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,566,051.20	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,566,303.20	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,272,268.20	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,269,579.78	
GOV OF ITALY	2,410,000.00	2,585,842.75	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,283,510.34	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,278,290.96	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,486,388.40	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,413,198.74	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,945,809.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,616,692.00	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	1,879,444.00	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,774,768.91	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	2,028,364.80	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,618,187.79	
GOV OF ITALY	1,430,000.00	1,506,334.83	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,711,148.80	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,592,962.56	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,816,945.20	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,360,008.64	
GOV OF ITALY	1,390,000.00	1,476,792.99	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,656,668.67	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,429,025.00	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,737,064.17	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,885,560.57	
GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,437,082.26	
GOV OF ITALY	500,000.00	508,110.00	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	2,631,405.92	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	2,303,613.60	

GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,440,350.00	
GOV OF ITALY	1,850,000.00	2,144,002.00	
GOV OF ITALY	2,250,000.00	2,661,435.00	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,613,514.68	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,073,043.46	
GOV OF ITALY	1,840,000.00	1,912,477.60	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,088,633.14	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,645,718.70	
GOV OF ITALY	2,460,000.00	3,676,618.56	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,660,389.16	
GOV OF ITALY	1,560,000.00	2,374,263.84	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,086,163.89	
GOV OF ITALY	1,680,000.00	2,464,257.60	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	1,982,839.35	
GOV OF ITALY	810,000.00	818,778.78	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,942,271.00	
GOV OF ITALY	2,380,000.00	3,247,236.30	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,501,620.03	
GOV OF ITALY	2,160,000.00	3,363,768.00	
GOV OF ITALY	910,000.00	1,130,799.94	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,819,281.32	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,540,209.70	
GOV OF ITALY	1,320,000.00	1,706,329.68	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,722,939.72	
GOV OF ITALY	1,310,000.00	1,757,047.32	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,678,823.64	
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,368,010.40	
GOV OF ITALY	740,000.00	885,669.74	
GOV OF NETHERLANDS	1,310,000.00	1,321,053.78	
GOV OF NETHERLANDS	1,310,000.00	1,380,319.49	
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,148,220.32	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,753,465.04	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,318,138.77	
GOV OF NETHERLANDS	1,380,000.00	1,522,781.70	
GOV OF NETHERLANDS	1,260,000.00	1,314,810.00	

GOV OF NETHERLANDS	1,390,000.00	1,480,276.33
GOV OF NETHERLANDS	730,000.00	755,720.09
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,480,983.69
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,507,122.13
GOV OF NETHERLANDS	1,040,000.00	1,143,116.00
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,189,319.04
GOV OF NETHERLANDS	1,260,000.00	1,306,691.82
GOV OF NETHERLANDS	1,160,000.00	1,566,117.16
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	2,301,721.38
GOV OF NETHERLANDS	760,000.00	847,610.81
GOV OF NETHERLANDS	1,370,000.00	2,503,583.21
GOV OF NETHERLANDS	1,400,000.00	2,426,929.40
GOV OF SPAIN	2,250,000.00	2,263,124.25
GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,250,591.65
GOV OF SPAIN	2,320,000.00	2,353,204.30
GOV OF SPAIN	1,870,000.00	1,906,558.50
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,301,909.18
GOV OF SPAIN	1,340,000.00	1,354,714.54
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	1,819,370.04
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,049,865.80
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,811,933.20
GOV OF SPAIN	1,790,000.00	2,062,808.53
GOV OF SPAIN	1,500,000.00	1,535,721.00
GOV OF SPAIN	2,250,000.00	2,539,181.25
GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,316,602.30
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,121,377.70
GOV OF SPAIN	1,840,000.00	2,283,476.80
GOV OF SPAIN	2,180,000.00	2,449,012.00
GOV OF SPAIN	2,010,000.00	2,254,048.17
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,702,702.58
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,406,751.20
GOV OF SPAIN	1,700,000.00	1,879,634.06
GOV OF SPAIN	1,200,000.00	1,268,527.20
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,119,664.64
GOV OF SPAIN	1,900,000.00	2,098,555.12

	GOV OF SPAIN	1,840,000.00	2,035,154.08
	GOV OF SPAIN	1,430,000.00	2,016,870.57
	GOV OF SPAIN	2,040,000.00	3,043,571.26
	GOV OF SPAIN	1,900,000.00	2,115,118.00
	GOV OF SPAIN	2,060,000.00	2,140,302.92
	GOV OF SPAIN	1,730,000.00	1,777,152.88
	GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,370,079.20
	GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,139,359.43
	GOV OF SPAIN	1,820,000.00	2,961,096.32
	GOV OF SPAIN	1,730,000.00	2,138,643.30
	GOV OF SPAIN	1,520,000.00	1,792,583.12
	GOV OF SPAIN	1,760,000.00	2,743,106.08
	GOV OF SPAIN	1,670,000.00	2,941,468.36
	GOV OF SPAIN	1,010,000.00	1,076,856.84
	GOV OF SPAIN	1,790,000.00	3,119,465.57
	GOV OF SPAIN	1,120,000.00	2,142,471.52
	GOV OF SPAIN	1,460,000.00	2,101,618.59
	GOV OF SPAIN	1,290,000.00	1,811,380.59
	GOV OF SPAIN	950,000.00	928,720.64
	GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,995,291.05
	ユーロ 小計	507,920,000.00	607,429,029.62 (76,226,268,927)
英ポンド	UK TREASURY	670,000.00	695,106.64
	UK TREASURY	1,900,000.00	2,015,023.72
	UK TREASURY	2,070,000.00	2,093,126.04
	UK TREASURY	2,260,000.00	2,343,187.43
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,507,800.00
	UK TREASURY	2,260,000.00	2,317,658.47
	UK TREASURY	1,260,000.00	1,349,476.12
	UK TREASURY	2,240,000.00	2,332,588.60
	UK TREASURY	1,840,000.00	2,051,863.12
	UK TREASURY	780,000.00	959,636.73
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,172,120.30
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,382,650.00
	UK TREASURY	510,000.00	514,426.80

UK TREASURY	1,470,000.00	1,605,996.16
UK TREASURY	1,440,000.00	1,563,189.12
UK TREASURY	1,180,000.00	1,540,891.67
UK TREASURY	800,000.00	802,544.00
UK TREASURY	1,320,000.00	1,486,335.84
UK TREASURY	950,000.00	1,406,475.00
UK TREASURY	1,360,000.00	1,448,810.72
UK TREASURY	1,840,000.00	1,864,409.44
UK TREASURY	1,550,000.00	2,264,474.35
UK TREASURY	1,550,000.00	2,251,558.20
UK TREASURY	1,250,000.00	1,938,573.25
UK TREASURY	1,630,000.00	2,534,664.01
UK TREASURY	1,870,000.00	2,215,230.42
UK TREASURY	1,320,000.00	2,269,451.70
UK TREASURY	1,180,000.00	1,944,705.60
UK TREASURY	1,380,000.00	2,315,119.74
UK TREASURY	730,000.00	806,565.32
UK TREASURY	1,860,000.00	3,315,687.70
UK TREASURY	1,920,000.00	2,957,477.37
UK TREASURY	1,810,000.00	2,922,523.74
UK TREASURY	1,470,000.00	2,697,814.56
UK TREASURY	1,630,000.00	1,928,113.96
UK TREASURY	830,000.00	1,042,736.30
UK TREASURY	1,130,000.00	2,171,283.70
UK TREASURY	1,180,000.00	1,138,086.40
UK TREASURY	1,190,000.00	2,211,065.22
UK TREASURY	1,000,000.00	1,266,565.38
UK TREASURY	1,470,000.00	3,077,089.26
UK TREASURY	1,530,000.00	2,040,813.14
UK TREASURY	1,210,000.00	2,583,999.77
UK TREASURY	500,000.00	466,538.00
UK TREASURY	1,310,000.00	2,223,545.26
UK TREASURY	1,330,000.00	2,863,463.40
UK TREASURY	670,000.00	968,924.77
英bond 小計	65,500,000.00	87,869,386.44 (11,930,026,596)

スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	8,975,000.00	9,571,310.64
	GOV OF SWEDEN	7,450,000.00	7,894,325.45
	GOV OF SWEDEN	5,880,000.00	6,666,588.75
	GOV OF SWEDEN	5,660,000.00	6,102,384.45
	GOV OF SWEDEN	3,960,000.00	4,244,583.42
	GOV OF SWEDEN	4,530,000.00	4,885,740.90
	GOV OF SWEDEN	2,150,000.00	2,174,043.88
	GOV OF SWEDEN	3,910,000.00	6,130,952.32
スウェーデンクローナ 小計		42,515,000.00	47,669,929.81 (573,945,954)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	6,580,000.00	6,897,649.50
	GOV OF NORWAY	4,970,000.00	5,443,690.70
	GOV OF NORWAY	3,640,000.00	3,871,796.65
	GOV OF NORWAY	3,150,000.00	3,338,559.00
	GOV OF NORWAY	3,300,000.00	3,568,476.78
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,691,704.60
	GOV OF NORWAY	3,310,000.00	3,637,690.00
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,610,499.10
ノルウェークローネ 小計		31,660,000.00	34,060,066.33 (397,821,574)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,600,000.00	5,834,152.80
	GOV OF DENMARK	4,150,000.00	4,229,758.85
	GOV OF DENMARK	5,020,000.00	5,361,289.72
	GOV OF DENMARK	5,400,000.00	6,058,386.35
	GOV OF DENMARK	7,000,000.00	7,493,416.00
	GOV OF DENMARK	7,450,000.00	8,054,344.00
	GOV OF DENMARK	10,960,000.00	20,703,242.72
デンマーククローネ 小計		45,580,000.00	57,734,590.44 (973,982,540)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	1,320,000.00	1,404,480.00
	GOV OF POLAND	3,410,000.00	3,532,491.27
	GOV OF POLAND	2,340,000.00	2,337,444.25
	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,664,109.10
	GOV OF POLAND	2,870,000.00	3,032,289.89
	GOV OF POLAND	2,120,000.00	2,366,619.60

	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,136,005.72
	GOV OF POLAND	3,010,000.00	3,227,989.30
	GOV OF POLAND	800,000.00	805,143.44
	GOV OF POLAND	2,610,000.00	2,930,060.38
	GOV OF POLAND	3,950,000.00	4,312,738.77
	GOV OF POLAND	2,790,000.00	3,050,863.04
	GOV OF POLAND	3,120,000.00	3,470,688.00
	GOV OF POLAND	640,000.00	880,480.00
	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,650,462.00
	GOV OF POLAND	500,000.00	495,160.20
	ポーランドズロチ 小計	38,920,000.00	42,297,024.96 (1,191,084,222)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,500,000.00	1,534,711.80
	GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	2,246,370.88
	GOV OF AUSTRALIA	2,510,000.00	2,619,565.76
	GOV OF AUSTRALIA	2,810,000.00	3,192,197.34
	GOV OF AUSTRALIA	2,890,000.00	3,148,726.94
	GOV OF AUSTRALIA	2,080,000.00	2,074,519.60
	GOV OF AUSTRALIA	2,810,000.00	3,180,761.22
	GOV OF AUSTRALIA	1,920,000.00	1,902,120.57
	GOV OF AUSTRALIA	2,750,000.00	3,324,202.75
	GOV OF AUSTRALIA	2,560,000.00	3,251,265.77
	GOV OF AUSTRALIA	2,410,000.00	2,765,190.13
	GOV OF AUSTRALIA	2,530,000.00	2,821,808.92
	GOV OF AUSTRALIA	2,130,000.00	2,466,609.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,940,000.00	3,539,738.24
	GOV OF AUSTRALIA	2,540,000.00	2,968,443.63
	GOV OF AUSTRALIA	3,160,000.00	3,637,989.79
	GOV OF AUSTRALIA	2,090,000.00	2,108,116.72
	GOV OF AUSTRALIA	1,960,000.00	2,072,398.94
	GOV OF AUSTRALIA	1,360,000.00	1,398,676.48
	GOV OF AUSTRALIA	1,080,000.00	1,523,489.36
	GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	978,917.23
	GOV OF AUSTRALIA	970,000.00	1,315,337.06
	GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	913,126.44
	GOV OF AUSTRALIA	730,000.00	877,513.50

	GOV OF AUSTRALIA	1,130,000.00	1,436,361.15
	GOV OF AUSTRALIA	1,310,000.00	1,289,403.52
	オーストラリアドル 小計	51,730,000.00	58,587,563.60 (4,506,555,392)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	580,000.00	586,380.00
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	512,192.50
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	528,750.00
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	631,716.00
	GOV OF SINGAPORE	720,000.00	768,960.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	306,066.00
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	672,891.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	588,791.70
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	588,330.00
	GOV OF SINGAPORE	550,000.00	649,385.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	398,475.00
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	737,730.00
	GOV OF SINGAPORE	320,000.00	380,590.40
	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	731,595.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	626,402.70
	GOV OF SINGAPORE	170,000.00	201,473.80
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	445,550.00
	GOV OF SINGAPORE	550,000.00	720,500.00
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	349,318.50
		シンガポールドル 小計	9,220,000.00
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	880,246.29
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,205,888.72
	GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,235,271.00
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	833,876.12
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	986,352.89
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,671,418.75
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	637,701.80
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	872,905.77
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	799,738.42
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	895,154.66



	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	721,062.84
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	784,571.95
	GOV OF MALAYSIA	2,250,000.00	2,442,677.17
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	900,730.93
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,295,654.50
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,101,097.35
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	523,103.95
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,474,979.08
	GOV OF MALAYSIA	1,310,000.00	1,420,098.81
	GOV OF MALAYSIA	1,300,000.00	1,431,060.15
	GOV OF MALAYSIA	1,630,000.00	1,877,315.17
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,344,098.45
	GOV OF MALAYSIA	1,060,000.00	1,138,165.24
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,287,107.47
	GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,298,868.12
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	302,764.09
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,082,460.75
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	1,039,769.37
	GOV OF MALAYSIA	1,110,000.00	1,155,124.15
	GOV OF MALAYSIA	540,000.00	642,102.49
	GOV OF MALAYSIA	750,000.00	872,747.84
	GOV OF MALAYSIA	640,000.00	757,429.12
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	859,984.92
	マレーシアリングット 小計	32,880,000.00	35,771,528.33 (913,247,118)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,570,000.00	1,741,522.50
	GOV OF ISRAEL	1,280,000.00	1,297,024.00
	GOV OF ISRAEL	1,000,000.00	1,034,850.00
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	1,808,513.00
	GOV OF ISRAEL	1,660,000.00	1,748,063.00
	GOV OF ISRAEL	1,450,000.00	1,653,580.00
	GOV OF ISRAEL	700,000.00	706,755.00
	GOV OF ISRAEL	1,650,000.00	1,764,757.50
	GOV OF ISRAEL	1,360,000.00	1,910,188.00
	GOV OF ISRAEL	1,600,000.00	1,768,400.00
	GOV OF ISRAEL	1,440,000.00	1,653,552.00

	GOV OF ISRAEL	910,000.00	935,525.50	
	GOV OF ISRAEL	600,000.00	619,440.00	
	GOV OF ISRAEL	1,660,000.00	2,939,611.00	
	GOV OF ISRAEL	1,570,000.00	2,274,302.00	
	イスラエルシュケル 小計	20,060,000.00	23,856,083.50	(733,574,567)
合計			183,492,021,503	(183,492,021,503)

(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%	43.8%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 321銘柄	100.0%	41.6%
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 8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 26銘柄	100.0%	2.5%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングギット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 15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。

## R A M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 9月15日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	560,320,581
株式	30,031,356,835
派生商品評価勘定	9,014,050
未収入金	577,800
未収配当金	11,506,127
差入委託証拠金	23,715,000
流動資産合計	30,636,490,393
資産合計	
30,636,490,393	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	12,170,000
未払金	59,733,516
未払解約金	8,880,000
未払利息	1,519
流動負債合計	80,785,035
負債合計	
80,785,035	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	26,249,302,541
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,306,402,817
元本等合計	30,555,705,358
純資産合計	
30,555,705,358	
負債純資産合計	
30,636,490,393	

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

派生商品取引等損益

原則として、約定日基準で計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	30,964,130,883円
期中追加設定元本額	28,107,323,458円
期中一部解約元本額	32,822,151,800円
期末元本額	26,249,302,541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)	1,186,919,501円
DCりそな グローバルバランス	34,226,407円
つみたてバランスファンド	2,245,586,497円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	755,676,468円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	383,714,403円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	230,818,102円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	17,804,771円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,786,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,629,497円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	11,265,989円
リスクコントロール・オープン	6,587,348円
FWりそな国内株式アクティブファンド	298,394,999円
FWりそな国内株式インデックスファンド	11,529,504,280円
Smart-i TOPIXインデックス	1,005,653,875円
Smart-i 8資産バランス 安定型	125,059,266円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	294,708,166円
Smart-i 8資産バランス 成長型	324,730,295円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	416,011,979円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	374,402,317円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	212,928,226円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	140,446,271円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	373,095,796円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	62,442,427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)	2,048,645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)	841,066,928円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,685,214,888円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	51,456,676円
2. 計算日における受益権の総数	26,249,302,541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	1.1641円
(10,000口当たり純資産額)	(11,641円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 9月15日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		583,405,599
合計		583,405,599

(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 9月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	463,685,950	-	472,700,000	9,014,050
	合計	463,685,950	-	472,700,000	9,014,050

## （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	2,727.00	1,636,200	
日本水産	17,700	468.00	8,283,600	
マルハニチロ	2,600	2,462.00	6,401,200	
カネコ種苗	500	1,500.00	750,000	
サカタのタネ	2,100	3,590.00	7,539,000	
ホクト	1,400	2,205.00	3,087,000	
ホクリヨウ	300	666.00	199,800	
住石ホールディングス	3,500	124.00	434,000	
日鉄鉱業	400	4,995.00	1,998,000	
三井松島ホールディングス	700	742.00	519,400	
国際石油開発帝石	65,200	620.30	40,443,560	
石油資源開発	2,300	1,798.00	4,135,400	
K & O エナジーグループ	900	1,514.00	1,362,600	
ヒノキヤグループ	400	1,961.00	784,400	
ショーボンドホールディングス	2,800	5,220.00	14,616,000	
ミライト・ホールディングス	5,300	1,561.00	8,273,300	
タマホーム	1,000	1,345.00	1,345,000	
サンヨーホームズ	200	661.00	132,200	
日本アクア	700	658.00	460,600	
ファーストコーポレーション	500	650.00	325,000	
ベステラ	300	1,129.00	338,700	
TATERU	3,200	197.00	630,400	
キャンディル	300	749.00	224,700	
スペースバリューホールディングス	2,200	470.00	1,034,000	
ダイセキ環境ソリューション	300	700.00	210,000	
第一カッター興業	200	2,279.00	455,800	
明豊ファシリティワークス	600	713.00	427,800	
安藤・間	10,600	778.00	8,246,800	
東急建設	5,200	485.00	2,522,000	
コムシスホールディングス	6,300	2,970.00	18,711,000	

ピーアールホールディングス	1,900	769.00	1,461,100	
高松コンストラクショングループ	1,100	2,251.00	2,476,100	
東建コーポレーション	500	8,010.00	4,005,000	
ソネック	200	895.00	179,000	
ヤマウラ	800	848.00	678,400	
大成建設	13,700	3,720.00	50,964,000	
大林組	41,000	1,016.00	41,656,000	
清水建設	41,600	824.00	34,278,400	
飛島建設	1,200	1,122.00	1,346,400	
長谷工コーポレーション	15,900	1,503.00	23,897,700	
松井建設	1,600	669.00	1,070,400	
銭高組	200	4,080.00	816,000	
鹿島建設	32,200	1,316.00	42,375,200	
不動テトラ	1,100	1,535.00	1,688,500	
大末建設	500	896.00	448,000	
鉄建建設	900	2,059.00	1,853,100	
西松建設	3,200	2,094.00	6,700,800	
三井住友建設	9,900	438.00	4,336,200	
大豊建設	900	2,952.00	2,656,800	
前田建設工業	10,300	791.00	8,147,300	
佐田建設	900	437.00	393,300	
ナカノフドー建設	1,100	398.00	437,800	
奥村組	1,900	2,648.00	5,031,200	
東鉄工業	1,800	2,762.00	4,971,600	
イチケン	300	1,544.00	463,200	
富士ピー・エス	600	642.00	385,200	
浅沼組	500	4,250.00	2,125,000	
戸田建設	17,000	706.00	12,002,000	
熊谷組	1,900	2,761.00	5,245,900	
北野建設	200	2,680.00	536,000	
植木組	200	2,695.00	539,000	
矢作建設工業	1,800	857.00	1,542,600	
ピーエス三菱	1,300	604.00	785,200	
日本ハウスホールディングス	2,800	272.00	761,600	
大東建託	4,500	9,841.00	44,284,500	
新日本建設	1,700	871.00	1,480,700	



N I P P O	3,400	2,769.00	9,414,600	
東亜道路工業	300	3,360.00	1,008,000	
前田道路	3,600	1,893.00	6,814,800	
日本道路	400	7,510.00	3,004,000	
東亜建設工業	1,300	1,657.00	2,154,100	
日本国土開発	4,000	629.00	2,516,000	
若築建設	700	1,235.00	864,500	
東洋建設	4,600	414.00	1,904,400	
五洋建設	16,200	682.00	11,048,400	
世紀東急工業	2,000	802.00	1,604,000	
福田組	500	5,360.00	2,680,000	
住友林業	10,400	1,772.00	18,428,800	
日本基礎技術	1,400	454.00	635,600	
巴コーポレーション	1,800	371.00	667,800	
大和ハウス工業	40,500	2,961.00	119,920,500	
ライト工業	2,300	1,595.00	3,668,500	
積水ハウス	44,400	1,986.00	88,178,400	
日特建設	1,100	789.00	867,900	
北陸電気工事	700	1,099.00	769,300	
ユアテック	2,300	649.00	1,492,700	
日本リーテック	900	3,070.00	2,763,000	
四電工	200	2,292.00	458,400	
中電工	1,700	2,311.00	3,928,700	
関電工	5,800	873.00	5,063,400	
きんでん	9,700	1,867.00	18,109,900	
東京エネシス	1,400	749.00	1,048,600	
トーエネック	400	3,565.00	1,426,000	
住友電設	1,200	2,358.00	2,829,600	
日本電設工業	2,200	2,210.00	4,862,000	
協和エクシオ	6,200	2,717.00	16,845,400	
新日本空調	1,100	2,122.00	2,334,200	
九電工	2,900	3,050.00	8,845,000	
三機工業	3,000	1,226.00	3,678,000	
日揮ホールディングス	12,600	1,104.00	13,910,400	
中外炉工業	400	1,522.00	608,800	
ヤマト	1,300	667.00	867,100	

太平電業	1,000	2,264.00	2,264,000	
高砂熱学工業	3,400	1,555.00	5,287,000	
三晃金属工業	200	2,090.00	418,000	
朝日工業社	300	2,975.00	892,500	
明星工業	2,600	784.00	2,038,400	
大気社	2,000	2,910.00	5,820,000	
ダイダン	1,000	2,770.00	2,770,000	
日比谷総合設備	1,300	1,798.00	2,337,400	
フィル・カンパニー	200	1,970.00	394,000	
OSJBホールディングス	6,400	241.00	1,542,400	
東洋エンジニアリング	1,700	343.00	583,100	
レイズネクスト	2,200	1,320.00	2,904,000	
日本製粉	3,800	1,682.00	6,391,600	
日清製粉グループ本社	14,800	1,679.00	24,849,200	
日東富士製粉	100	6,180.00	618,000	
昭和産業	1,200	3,530.00	4,236,000	
鳥越製粉	1,200	992.00	1,190,400	
中部飼料	1,600	1,641.00	2,625,600	
フィード・ワン	8,800	187.00	1,645,600	
東洋精糖	200	1,259.00	251,800	
日本甜菜製糖	700	1,788.00	1,251,600	
三井製糖	1,100	1,926.00	2,118,600	
塩水港精糖	1,400	230.00	322,000	
日新製糖	600	1,890.00	1,134,000	
森永製菓	3,100	4,105.00	12,725,500	
中村屋	300	4,120.00	1,236,000	
江崎グリコ	3,600	4,530.00	16,308,000	
名糖産業	600	1,531.00	918,600	
井村屋グループ	700	2,392.00	1,674,400	
不二家	800	2,306.00	1,844,800	
山崎製パン	9,800	1,776.00	17,404,800	
第一屋製パン	300	992.00	297,600	
モロゾフ	200	5,780.00	1,156,000	
亀田製菓	700	5,250.00	3,675,000	
寿スピリッツ	1,300	5,030.00	6,539,000	
カルビー	6,000	3,295.00	19,770,000	

森永乳業	2,400	5,230.00	12,552,000	
六甲バター	900	1,827.00	1,644,300	
ヤクルト本社	9,000	5,680.00	51,120,000	
明治ホールディングス	8,700	7,950.00	69,165,000	
雪印メグミルク	3,200	2,354.00	7,532,800	
プリマハム	2,000	2,935.00	5,870,000	
日本ハム	5,000	4,670.00	23,350,000	
林兼産業	400	578.00	231,200	
丸大食品	1,400	1,859.00	2,602,600	
S Foods	1,000	2,847.00	2,847,000	
柿安本店	500	2,625.00	1,312,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,400	709.00	5,955,600	
サッポロホールディングス	4,500	1,934.00	8,703,000	
アサヒグループホールディングス	28,600	3,779.00	108,079,400	
キリンホールディングス	55,600	1,982.00	110,199,200	
宝ホールディングス	9,700	1,101.00	10,679,700	
オエノンホールディングス	3,700	420.00	1,554,000	
養命酒製造	400	1,862.00	744,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,000	1,782.00	17,820,000	
サントリー食品インターナショナル	8,800	3,975.00	34,980,000	
ダイドーグループホールディングス	700	5,300.00	3,710,000	
伊藤園	4,000	6,930.00	27,720,000	
キーコーヒー	1,300	2,286.00	2,971,800	
ユニカフェ	400	1,008.00	403,200	
ジャパンフーズ	200	1,265.00	253,000	
日清オイリオグループ	1,700	3,170.00	5,389,000	
不二製油グループ本社	3,200	3,215.00	10,288,000	
かどや製油	100	3,710.00	371,000	
J-オイルミルズ	700	3,870.00	2,709,000	
キッコーマン	9,400	5,670.00	53,298,000	
味の素	29,000	1,983.00	57,507,000	
キューピー	7,300	2,076.00	15,154,800	
ハウス食品グループ本社	4,900	3,515.00	17,223,500	
カゴメ	5,400	3,395.00	18,333,000	
焼津水産化学工業	600	946.00	567,600	

アリアケジャパン	1,200	7,520.00	9,024,000	
ピエトロ	200	1,728.00	345,600	
エバラ食品工業	300	2,290.00	687,000	
やまみ	100	2,107.00	210,700	
ニチレイ	6,200	2,739.00	16,981,800	
東洋水産	6,700	5,580.00	37,386,000	
イトアンド	500	1,934.00	967,000	
大冷	200	2,300.00	460,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	932.00	652,400	
日清食品ホールディングス	5,600	9,730.00	54,488,000	
永谷園ホールディングス	600	2,309.00	1,385,400	
一正蒲鉾	500	1,047.00	523,500	
フジッコ	1,400	2,053.00	2,874,200	
ロック・フィールド	1,400	1,420.00	1,988,000	
日本たばこ産業	70,300	1,981.50	139,299,450	
ケンコーマヨネーズ	700	1,868.00	1,307,600	
わらべや日洋ホールディングス	900	1,531.00	1,377,900	
なとり	700	1,971.00	1,379,700	
イフジ産業	200	940.00	188,000	
ピックルスコーポレーション	300	2,700.00	810,000	
北の達人コーポレーション	4,600	566.00	2,603,600	
ユーグレナ	5,700	903.00	5,147,100	
ミヨシ油脂	500	1,140.00	570,000	
理研ビタミン	1,200	2,196.00	2,635,200	
片倉工業	1,700	1,209.00	2,055,300	
グンゼ	900	4,095.00	3,685,500	
東洋紡	5,100	1,607.00	8,195,700	
ユニチカ	3,700	382.00	1,413,400	
富士紡ホールディングス	600	3,605.00	2,163,000	
倉敷紡績	1,300	1,967.00	2,557,100	
シキボウ	700	975.00	682,500	
日本毛織	4,200	1,000.00	4,200,000	
ダイトウボウ	1,900	115.00	218,500	
トーア紡コーポレーション	500	500.00	250,000	
ダイドーリミテッド	1,600	200.00	320,000	
帝国繊維	1,400	2,637.00	3,691,800	

帝人	10,400	1,690.00	17,576,000
東レ	92,600	500.90	46,383,340
サカイオーベックス	300	2,013.00	603,900
住江織物	300	1,830.00	549,000
日本フェルト	700	469.00	328,300
イチカワ	200	1,296.00	259,200
日東製網	100	1,500.00	150,000
アツギ	1,100	543.00	597,300
ダイニック	500	810.00	405,000
セーレン	3,100	1,534.00	4,755,400
ソトー	500	958.00	479,000
東海染工	200	1,129.00	225,800
小松マテーレ	2,100	867.00	1,820,700
ワコールホールディングス	3,200	1,958.00	6,265,600
ホギメディカル	1,500	3,585.00	5,377,500
クラウディアホールディングス	300	317.00	95,100
T S Iホールディングス	3,900	328.00	1,279,200
マツオカコーポレーション	400	2,110.00	844,000
ワールド	1,800	1,421.00	2,557,800
三陽商会	700	610.00	427,000
ナイガイ	500	401.00	200,500
オンワードホールディングス	7,700	280.00	2,156,000
ルックホールディングス	400	856.00	342,400
キムラタン	7,000	27.00	189,000
ゴールドウイン	2,300	7,880.00	18,124,000
デサント	2,500	1,842.00	4,605,000
キング	600	595.00	357,000
ヤマトインターナショナル	1,100	356.00	391,600
特種東海製紙	800	4,535.00	3,628,000
王子ホールディングス	53,500	500.00	26,750,000
日本製紙	5,700	1,341.00	7,643,700
三菱製紙	1,400	359.00	502,600
北越コーポレーション	7,600	380.00	2,888,000
中越パルプ工業	500	1,493.00	746,500
巴川製紙所	400	949.00	379,600
大王製紙	5,600	1,358.00	7,604,800

阿波製紙	300	478.00	143,400	
レンゴー	12,100	794.00	9,607,400	
トモク	800	1,700.00	1,360,000	
ザ・パック	1,000	3,065.00	3,065,000	
クラレ	20,100	1,140.00	22,914,000	
旭化成	84,800	954.00	80,899,200	
共和レザー	700	630.00	441,000	
昭和電工	9,700	2,116.00	20,525,200	
住友化学	94,000	378.00	35,532,000	
住友精化	600	3,440.00	2,064,000	
日産化学	7,100	5,420.00	38,482,000	
ラサ工業	500	1,765.00	882,500	
クレハ	1,100	5,060.00	5,566,000	
多木化学	500	6,270.00	3,135,000	
テイカ	900	1,398.00	1,258,200	
石原産業	2,300	768.00	1,766,400	
片倉コープアグリ	300	1,243.00	372,900	
日本曹達	1,900	3,130.00	5,947,000	
東ソー	19,800	1,797.00	35,580,600	
トクヤマ	3,700	2,744.00	10,152,800	
セントラル硝子	2,600	2,199.00	5,717,400	
東亜合成	8,000	1,166.00	9,328,000	
大阪ソーダ	1,300	2,635.00	3,425,500	
関東電化工業	3,000	770.00	2,310,000	
デンカ	4,700	3,230.00	15,181,000	
信越化学工業	22,000	14,200.00	312,400,000	
日本カーバイド工業	400	1,259.00	503,600	
堺化学工業	800	2,079.00	1,663,200	
第一稀元素化学工業	1,400	835.00	1,169,000	
エア・ウォーター	11,900	1,510.00	17,969,000	
大陽日酸	12,300	1,754.00	21,574,200	
日本化学工業	400	2,394.00	957,600	
東邦アセチレン	200	1,259.00	251,800	
日本パーカライジング	6,500	1,024.00	6,656,000	
高压ガス工業	2,000	848.00	1,696,000	
チタン工業	200	1,748.00	349,600	

四国化成工業	1,900	1,122.00	2,131,800	
戸田工業	300	2,464.00	739,200	
ステラ ケミファ	700	3,100.00	2,170,000	
保土谷化学工業	500	4,840.00	2,420,000	
日本触媒	2,000	5,850.00	11,700,000	
大日精化工業	1,100	2,279.00	2,506,900	
カネカ	3,300	2,975.00	9,817,500	
三菱瓦斯化学	11,900	2,030.00	24,157,000	
三井化学	11,900	2,755.00	32,784,665	
J S R	11,900	2,519.00	29,976,100	
東京応化工業	2,200	5,310.00	11,682,000	
大阪有機化学工業	1,200	2,736.00	3,283,200	
三菱ケミカルホールディングス	85,500	685.10	58,576,050	
K Hネオケム	2,100	2,608.00	5,476,800	
ダイセル	16,700	829.00	13,844,300	
住友ベークライト	2,000	3,085.00	6,170,000	
積水化学工業	27,100	1,752.00	47,479,200	
日本ゼオン	11,500	1,170.00	13,455,000	
アイカ工業	3,800	3,805.00	14,459,000	
宇部興産	6,500	1,956.00	12,714,000	
積水樹脂	2,300	2,172.00	4,995,600	
タキロンシーアイ	2,800	706.00	1,976,800	
旭有機材	700	1,356.00	949,200	
ニチバン	700	1,760.00	1,232,000	
リケンテクノス	3,200	418.00	1,337,600	
大倉工業	600	1,555.00	933,000	
積水化成成品工業	1,700	582.00	989,400	
群栄化学工業	300	2,487.00	746,100	
タイガースポリマー	700	417.00	291,900	
ミライアル	500	1,067.00	533,500	
ダイキアクシス	500	848.00	424,000	
ダイキョーニシカワ	2,700	590.00	1,593,000	
竹本容器	500	977.00	488,500	
森六ホールディングス	700	1,819.00	1,273,300	
日本化薬	7,900	1,008.00	7,963,200	
カーリットホールディングス	1,400	515.00	721,000	

日本精化	1,000	1,599.00	1,599,000	
扶桑化学工業	1,300	3,540.00	4,602,000	
トリケミカル研究所	300	11,550.00	3,465,000	
A D E K A	5,900	1,598.00	9,428,200	
日油	4,800	4,225.00	20,280,000	
新日本理化	2,000	163.00	326,000	
ハリマ化成グループ	1,100	1,003.00	1,103,300	
花王	31,300	8,112.00	253,905,600	
第一工業製薬	500	4,510.00	2,255,000	
石原ケミカル	300	2,133.00	639,900	
日華化学	400	879.00	351,600	
ニイタカ	300	3,200.00	960,000	
三洋化成工業	800	5,040.00	4,032,000	
有機合成薬品工業	1,000	346.00	346,000	
大日本塗料	1,400	979.00	1,370,600	
日本ペイントホールディングス	10,600	9,680.00	102,608,000	
関西ペイント	14,400	2,632.00	37,900,800	
神東塗料	900	185.00	166,500	
中国塗料	3,600	1,044.00	3,758,400	
日本特殊塗料	1,000	973.00	973,000	
藤倉化成	1,700	525.00	892,500	
太陽ホールディングス	900	5,590.00	5,031,000	
D I C	5,400	2,763.00	14,920,200	
サカタインクス	2,800	1,062.00	2,973,600	
東洋インキ S C ホールディングス	2,700	2,015.00	5,440,500	
T & K T O K A	1,000	803.00	803,000	
富士フイルムホールディングス	25,000	5,007.00	125,175,000	
資生堂	26,000	6,090.00	158,340,000	
ライオン	17,000	2,208.00	37,536,000	
高砂香料工業	800	2,165.00	1,732,000	
マンダム	2,900	1,865.00	5,408,500	
ミルボン	1,700	5,660.00	9,622,000	
ファンケル	5,300	3,445.00	18,258,500	
コーセー	2,500	12,460.00	31,150,000	
コタ	800	1,310.00	1,048,000	
シーボン	200	1,980.00	396,000	



ポーラ・オルビスホールディングス	5,600	2,050.00	11,480,000	
ノエビアホールディングス	1,100	5,150.00	5,665,000	
アジュバンコスメジャパン	300	990.00	297,000	
エステー	800	2,149.00	1,719,200	
アグロ カネショウ	500	1,674.00	837,000	
コニシ	2,100	1,477.00	3,101,700	
長谷川香料	2,300	2,084.00	4,793,200	
星光PMC	700	677.00	473,900	
小林製薬	3,700	9,790.00	36,223,000	
荒川化学工業	1,200	1,257.00	1,508,400	
メック	900	1,841.00	1,656,900	
日本高純度化学	400	2,700.00	1,080,000	
タカラバイオ	3,400	2,823.00	9,598,200	
JCU	1,600	3,360.00	5,376,000	
新田ゼラチン	800	698.00	558,400	
OATアグリオ	200	1,244.00	248,800	
デクセリアルズ	3,400	1,132.00	3,848,800	
アース製薬	900	7,560.00	6,804,000	
北興化学工業	1,200	678.00	813,600	
大成ラミック	400	2,746.00	1,098,400	
クミアイ化学工業	5,400	1,005.00	5,427,000	
日本農薬	2,300	514.00	1,182,200	
アキレス	900	1,804.00	1,623,600	
有沢製作所	2,100	993.00	2,085,300	
日東電工	9,000	6,680.00	60,120,000	
レック	1,400	1,626.00	2,276,400	
三光合成	1,500	274.00	411,000	
きもと	2,200	167.00	367,400	
藤森工業	1,200	4,200.00	5,040,000	
前澤化成工業	800	1,033.00	826,400	
未来工業	700	2,080.00	1,456,000	
ウェーブロックホールディングス	500	794.00	397,000	
JSP	800	1,606.00	1,284,800	
エフピコ	1,400	8,240.00	11,536,000	
天馬	900	1,839.00	1,655,100	
信越ポリマー	2,300	899.00	2,067,700	

東リ	3,200	261.00	835,200	
ニフコ	4,800	2,974.00	14,275,200	
バルカー	1,100	1,918.00	2,109,800	
ユニ・チャーム	27,700	4,518.00	125,148,600	
ショーエイコーポレーション	200	1,236.00	247,200	
協和キリン	13,100	2,848.00	37,308,800	
武田薬品工業	108,700	3,878.00	421,538,600	
アステラス製薬	113,300	1,616.00	183,092,800	
大日本住友製薬	9,700	1,390.00	13,483,000	
塩野義製薬	16,400	5,784.00	94,857,600	
わかもと製薬	1,500	272.00	408,000	
あすか製薬	1,500	1,358.00	2,037,000	
日本新薬	3,400	8,860.00	30,124,000	
ピオフェルミン製薬	200	2,481.00	496,200	
中外製薬	40,900	4,768.00	195,011,200	
科研製薬	2,200	4,820.00	10,604,000	
エーザイ	15,600	9,326.00	145,485,600	
ロート製薬	6,700	3,575.00	23,952,500	
小野薬品工業	30,000	3,276.00	98,280,000	
久光製薬	3,500	5,230.00	18,305,000	
持田製薬	1,800	3,965.00	7,137,000	
参天製薬	24,300	2,078.00	50,495,400	
扶桑薬品工業	500	2,797.00	1,398,500	
日本ケミファ	200	2,564.00	512,800	
ツムラ	4,000	3,240.00	12,960,000	
日医工	3,700	1,222.00	4,521,400	
キッセイ薬品工業	2,300	2,390.00	5,497,000	
生化学工業	2,500	1,154.00	2,885,000	
栄研化学	2,300	2,021.00	4,648,300	
日水製薬	500	1,178.00	589,000	
鳥居薬品	800	2,945.00	2,356,000	
JCRファーマ	900	12,120.00	10,908,000	
東和薬品	1,700	2,174.00	3,695,800	
富士製薬工業	900	1,207.00	1,086,300	
沢井製薬	2,700	5,660.00	15,282,000	
ゼリア新薬工業	2,400	2,015.00	4,836,000	

第一三共	37,400	9,805.00	366,707,000	
キョーリン製薬ホールディングス	2,900	2,172.00	6,298,800	
大幸薬品	1,600	2,332.00	3,731,200	
ダイト	800	3,465.00	2,772,000	
大塚ホールディングス	27,100	4,519.00	122,464,900	
大正製薬ホールディングス	2,800	6,780.00	18,984,000	
ペプチドリーム	6,600	4,300.00	28,380,000	
日本コークス工業	11,000	62.00	682,000	
ニチレキ	1,500	1,689.00	2,533,500	
ユシロ化学工業	700	1,309.00	916,300	
ビービー・カストロール	500	1,215.00	607,500	
富士石油	3,400	192.00	652,800	
MORESCO	500	973.00	486,500	
出光興産	14,500	2,425.00	35,162,500	
E N E O Sホールディングス	196,500	405.10	79,602,150	
コスモエネルギーホールディングス	3,800	1,636.00	6,216,800	
横浜ゴム	7,600	1,687.00	12,821,200	
TOYO TIRE	6,900	1,812.00	12,502,800	
ブリヂストン	34,700	3,510.00	121,797,000	
住友ゴム工業	11,700	1,014.00	11,863,800	
藤倉コンポジット	1,100	360.00	396,000	
オカモト	800	4,230.00	3,384,000	
フコク	600	668.00	400,800	
ニッタ	1,500	2,434.00	3,651,000	
住友理工	2,500	600.00	1,500,000	
三ツ星ベルト	1,700	1,741.00	2,959,700	
バンドー化学	2,300	623.00	1,432,900	
日東紡績	1,900	4,335.00	8,236,500	
A G C	12,000	3,165.00	37,980,000	
日本板硝子	6,200	443.00	2,746,600	
石塚硝子	200	1,913.00	382,600	
日本山村硝子	500	906.00	453,000	
日本電気硝子	4,800	2,121.00	10,180,800	
オハラ	500	1,255.00	627,500	
住友大阪セメント	2,500	3,545.00	8,862,500	
太平洋セメント	8,300	2,880.00	23,904,000	

日本ヒューム	1,300	814.00	1,058,200
日本コンクリート工業	2,800	297.00	831,600
三谷セキサン	600	5,820.00	3,492,000
アジアパイルホールディングス	1,900	484.00	919,600
東海カーボン	12,800	1,114.00	14,259,200
日本カーボン	700	3,850.00	2,695,000
東洋炭素	800	1,724.00	1,379,200
ノリタケカンパニーリミテド	700	3,525.00	2,467,500
TOTO	9,300	4,825.00	44,872,500
日本碍子	15,700	1,569.00	24,633,300
日本特殊陶業	9,900	1,953.00	19,334,700
ダントーホールディングス	1,000	347.00	347,000
MARUWA	500	9,270.00	4,635,000
品川リフラクトリーズ	300	2,407.00	722,100
黒崎播磨	300	3,120.00	936,000
ヨータイ	1,000	705.00	705,000
イソライト工業	700	450.00	315,000
東京窯業	1,700	332.00	564,400
ニッカトー	600	693.00	415,800
フジインコーポレーテッド	1,200	3,590.00	4,308,000
クミネ工業	500	1,068.00	534,000
エーアンドエーマテリアル	200	1,104.00	220,800
ニチアス	3,600	2,551.00	9,183,600
ニチハ	1,800	3,060.00	5,508,000
日本製鉄	57,800	1,125.50	65,053,900
神戸製鋼所	23,600	430.00	10,148,000
中山製鋼所	1,800	356.00	640,800
合同製鐵	700	2,167.00	1,516,900
ジェイ エフ イー ホールディングス	34,900	835.00	29,141,500
東京製鐵	6,300	746.00	4,699,800
共英製鋼	1,500	1,418.00	2,127,000
大和工業	2,700	2,653.00	7,163,100
東京鐵鋼	500	1,640.00	820,000
大阪製鐵	700	1,075.00	752,500
淀川製鋼所	1,700	1,870.00	3,179,000
丸一鋼管	4,200	2,810.00	11,802,000

モリ工業	400	2,474.00	989,600
大同特殊鋼	2,100	3,415.00	7,171,500
日本高周波鋼業	500	351.00	175,500
日本冶金工業	1,100	1,628.00	1,790,800
山陽特殊製鋼	900	1,013.00	911,700
愛知製鋼	700	2,646.00	1,852,200
日立金属	13,900	1,714.00	23,824,600
日本金属	300	624.00	187,200
大平洋金属	900	1,797.00	1,617,300
新日本電工	8,300	210.00	1,743,000
栗本鐵工所	600	1,999.00	1,199,400
虹技	200	1,333.00	266,600
日本鑄鉄管	100	1,208.00	120,800
三菱製鋼	1,000	580.00	580,000
日亜鋼業	1,900	285.00	541,500
日本精線	200	3,390.00	678,000
エンビプロ・ホールディングス	500	565.00	282,500
シンニッタン	2,000	222.00	444,000
新家工業	300	1,095.00	328,500
大紀アルミニウム工業所	2,100	561.00	1,178,100
日本軽金属ホールディングス	32,600	189.00	6,161,400
三井金属鉱業	3,500	2,737.00	9,579,500
東邦亜鉛	700	2,102.00	1,471,400
三菱マテリアル	8,500	2,308.00	19,618,000
住友金属鉱山	16,500	3,598.00	59,367,000
D O W Aホールディングス	3,300	3,335.00	11,005,500
古河機械金属	2,300	1,124.00	2,585,200
エス・サイエンス	5,300	47.00	249,100
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,300	919.00	1,194,700
東邦チタニウム	2,300	713.00	1,639,900
U A C J	2,000	1,994.00	3,988,000
C Kサンエツ	300	3,370.00	1,011,000
古河電気工業	4,000	2,614.00	10,456,000
住友電気工業	48,300	1,304.50	63,007,350
フジクラ	15,600	312.00	4,867,200
昭和電線ホールディングス	1,500	1,139.00	1,708,500

東京特殊電線	200	2,380.00	476,000
タツタ電線	2,600	635.00	1,651,000
カナレ電気	200	1,739.00	347,800
平河ヒューテック	600	1,010.00	606,000
リヨービ	1,600	1,287.00	2,059,200
アーレスティ	1,700	358.00	608,600
アサヒホールディングス	2,300	3,600.00	8,280,000
稲葉製作所	700	1,344.00	940,800
宮地エンジニアリンググループ	400	1,618.00	647,200
トーカロ	3,600	1,070.00	3,852,000
アルファC o	500	956.00	478,000
SUMCO	16,500	1,448.00	23,892,000
川田テクノロジーズ	300	5,010.00	1,503,000
RS Technologies	400	3,415.00	1,366,000
信和	700	718.00	502,600
東洋製罐グループホールディングス	8,200	1,167.00	9,569,400
ホッカンホールディングス	700	1,587.00	1,110,900
コロナ	700	1,022.00	715,400
横河ブリッジホールディングス	2,400	1,943.00	4,663,200
駒井ハルテック	200	1,573.00	314,600
高田機工	100	2,497.00	249,700
三和ホールディングス	12,200	1,176.00	14,347,200
文化シャッター	3,800	822.00	3,123,600
三協立山	1,700	1,068.00	1,815,600
アルインコ	900	976.00	878,400
東洋シャッター	300	770.00	231,000
LIXILグループ	19,100	2,060.00	39,346,000
日本フィルコン	900	564.00	507,600
ノーリツ	2,700	1,451.00	3,917,700
長府製作所	1,300	2,118.00	2,753,400
リンナイ	2,500	9,970.00	24,925,000
ダイニチ工業	700	726.00	508,200
日東精工	1,600	461.00	737,600
三洋工業	200	1,946.00	389,200
岡部	2,600	794.00	2,064,400
ジーテクト	1,600	1,260.00	2,016,000

東プレ	2,400	1,242.00	2,980,800
高周波熱錬	2,500	524.00	1,310,000
東京製綱	900	548.00	493,200
サンコール	1,000	425.00	425,000
モリテック スチール	1,000	309.00	309,000
パイオラックス	1,900	1,599.00	3,038,100
エイチワン	1,300	584.00	759,200
日本発條	13,900	719.00	9,994,100
中央発條	200	2,817.00	563,400
アドバネクス	200	1,457.00	291,400
立川ブラインド工業	600	1,312.00	787,200
三益半導体工業	1,000	2,367.00	2,367,000
日本ドライケミカル	300	1,591.00	477,300
日本製鋼所	3,900	1,582.00	6,169,800
三浦工業	5,600	4,340.00	24,304,000
タクマ	4,400	1,747.00	7,686,800
ツガミ	2,700	1,266.00	3,418,200
オークマ	1,500	5,350.00	8,025,000
芝浦機械	1,500	2,280.00	3,420,000
アマダ	16,000	1,052.00	16,832,000
アイダエンジニアリング	3,400	758.00	2,577,200
滝澤鉄工所	400	1,063.00	425,200
F U J I	5,600	2,019.00	11,306,400
牧野フライス製作所	1,500	4,135.00	6,202,500
オーエスジー	6,400	1,728.00	11,059,200
ダイジェット工業	100	1,435.00	143,500
旭ダイヤモンド工業	3,400	525.00	1,785,000
D M G 森精機	8,200	1,569.00	12,865,800
ソディック	2,800	764.00	2,139,200
ディスコ	1,800	24,470.00	44,046,000
日東工器	700	2,015.00	1,410,500
日進工具	500	2,295.00	1,147,500
パンチ工業	1,200	414.00	496,800
富士ダイス	600	671.00	402,600
豊和工業	700	833.00	583,100
O K K	500	400.00	200,000

石川製作所	300	1,861.00	558,300
東洋機械金属	900	410.00	369,000
津田駒工業	200	812.00	162,400
エンシュウ	300	926.00	277,800
島精機製作所	2,000	1,695.00	3,390,000
オプトラン	1,600	2,125.00	3,400,000
N C ホールディングス	400	603.00	241,200
イワキポンプ	800	961.00	768,800
フリュー	1,300	1,088.00	1,414,400
ヤマシンフィルタ	2,800	1,054.00	2,951,200
日阪製作所	1,600	867.00	1,387,200
やまびこ	2,500	1,238.00	3,095,000
平田機工	600	6,040.00	3,624,000
ペガサスミシン製造	1,300	297.00	386,100
マルマエ	500	916.00	458,000
タツモ	500	1,397.00	698,500
ナブテスコ	7,600	3,760.00	28,576,000
三井海洋開発	1,400	1,741.00	2,437,400
レオン自動機	1,300	1,087.00	1,413,100
S M C	4,100	57,100.00	234,110,000
ホソカワミクロン	500	5,740.00	2,870,000
ユニオンツール	500	3,140.00	1,570,000
オイレス工業	1,700	1,543.00	2,623,100
日精エー・エス・ビー機械	400	4,125.00	1,650,000
サトーホールディングス	1,800	2,142.00	3,855,600
技研製作所	1,100	3,855.00	4,240,500
日本エアテック	400	1,312.00	524,800
カワタ	400	923.00	369,200
日精樹脂工業	1,100	865.00	951,500
オカダアイヨン	400	1,032.00	412,800
ワイエイシイホールディングス	600	674.00	404,400
小松製作所	59,200	2,418.50	143,175,200
住友重機械工業	7,500	2,554.00	19,155,000
日立建機	5,200	3,730.00	19,396,000
日工	1,800	730.00	1,314,000
巴工業	500	1,899.00	949,500



井関農機	1,300	1,334.00	1,734,200	
TOWA	1,300	1,114.00	1,448,200	
丸山製作所	300	1,350.00	405,000	
北川鉄工所	600	1,500.00	900,000	
ローツェ	600	4,645.00	2,787,000	
タカキタ	500	703.00	351,500	
クボタ	69,300	1,869.00	129,521,700	
荏原実業	300	2,794.00	838,200	
三菱化工機	400	1,789.00	715,600	
月島機械	2,400	1,289.00	3,093,600	
帝国電機製作所	1,100	1,124.00	1,236,400	
東京機械製作所	500	289.00	144,500	
新東工業	3,100	744.00	2,306,400	
澁谷工業	1,100	3,625.00	3,987,500	
アイチ コーポレーション	2,300	865.00	1,989,500	
小森コーポレーション	3,300	740.00	2,442,000	
鶴見製作所	1,000	1,822.00	1,822,000	
住友精密工業	200	2,285.00	457,000	
日本ギア工業	500	298.00	149,000	
酒井重工業	200	2,405.00	481,000	
荏原製作所	5,400	2,856.00	15,422,400	
石井鐵工所	200	2,725.00	545,000	
西島製作所	1,300	828.00	1,076,400	
北越工業	1,300	1,053.00	1,368,900	
ダイキン工業	16,600	19,640.00	326,024,000	
オルガノ	500	5,610.00	2,805,000	
トーヨーカネツ	600	2,282.00	1,369,200	
栗田工業	7,100	3,465.00	24,601,500	
椿本チエイン	1,900	2,546.00	4,837,400	
大同工業	600	594.00	356,400	
木村化工機	1,100	425.00	467,500	
アネスト岩田	2,000	832.00	1,664,000	
ダイフク	6,700	9,660.00	64,722,000	
サムコ	300	2,478.00	743,400	
加藤製作所	700	1,128.00	789,600	
油研工業	200	1,510.00	302,000	

タダノ	6,300	851.00	5,361,300	
フジテック	4,700	2,236.00	10,509,200	
C K D	3,600	1,593.00	5,734,800	
キトー	1,000	1,242.00	1,242,000	
平和	3,600	1,847.00	6,649,200	
理想科学工業	1,200	1,455.00	1,746,000	
S A N K Y O	2,900	3,005.00	8,714,500	
日本金銭機械	1,400	573.00	802,200	
マースグループホールディングス	800	1,747.00	1,397,600	
フクシマガリレイ	800	3,610.00	2,888,000	
オーイズミ	500	406.00	203,000	
ダイコク電機	600	1,073.00	643,800	
竹内製作所	2,200	2,167.00	4,767,400	
アマノ	3,400	2,446.00	8,316,400	
J U K I	1,800	466.00	838,800	
サンデンホールディングス	1,700	325.00	552,500	
蛇の目ミシン工業	1,200	642.00	770,400	
マックス	2,000	1,548.00	3,096,000	
グローリー	3,400	2,386.00	8,112,400	
新晃工業	1,200	1,485.00	1,782,000	
大和冷機工業	2,100	934.00	1,961,400	
セガサミーホールディングス	13,000	1,303.00	16,939,000	
日本ピストンリング	500	1,034.00	517,000	
リケン	600	2,651.00	1,590,600	
T P R	1,800	1,382.00	2,487,600	
ツバキ・ナカシマ	2,500	907.00	2,267,500	
ホシザキ	4,100	8,220.00	33,702,000	
大豊工業	1,100	550.00	605,000	
日本精工	24,600	907.00	22,312,200	
N T N	30,200	229.00	6,915,800	
ジェイテクト	12,500	930.00	11,625,000	
不二越	1,200	3,720.00	4,464,000	
日本トムソン	3,900	402.00	1,567,800	
T H K	8,100	2,728.00	22,096,800	
ユーシン精機	1,000	736.00	736,000	
前澤給装工業	500	2,110.00	1,055,000	

イーグル工業	1,600	824.00	1,318,400
前澤工業	900	462.00	415,800
日本ピラー工業	1,300	1,546.00	2,009,800
キット	5,300	632.00	3,349,600
マキタ	17,000	4,990.00	84,830,000
日立造船	10,400	440.00	4,576,000
三菱重工業	21,900	2,600.50	56,950,950
I H I	9,400	1,613.00	15,162,200
スター精密	2,000	1,427.00	2,854,000
日清紡ホールディングス	8,000	765.00	6,120,000
イビデン	8,000	3,575.00	28,600,000
コニカミノルタ	28,500	326.00	9,291,000
ブラザー工業	16,000	1,741.00	27,856,000
ミネベアミツミ	24,200	2,087.00	50,505,400
日立製作所	62,800	3,768.00	236,630,400
三菱電機	130,600	1,493.50	195,051,100
富士電機	7,900	3,515.00	27,768,500
東洋電機製造	500	1,087.00	543,500
安川電機	14,100	4,000.00	56,400,000
シンフォニアテクノロジー	1,700	1,113.00	1,892,100
明電舎	2,400	1,699.00	4,077,600
オリジン	400	1,315.00	526,000
山洋電気	600	4,930.00	2,958,000
デンヨー	1,100	2,381.00	2,619,100
東芝テック	1,600	4,720.00	7,552,000
芝浦メカトロニクス	200	3,120.00	624,000
マブチモーター	3,600	4,125.00	14,850,000
日本電産	31,400	9,756.00	306,338,400
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	800	356.00	284,800
トレックス・セミコンダクター	700	1,216.00	851,200
東光高岳	700	1,029.00	720,300
ダブル・スコープ	2,100	871.00	1,829,100
宮越ホールディングス	500	760.00	380,000
ダイヘン	1,400	4,285.00	5,999,000
ヤーマン	2,100	1,824.00	3,830,400
JVCケンウッド	10,600	162.00	1,717,200

ミマキエンジニアリング	1,200	399.00	478,800
I - P E X	600	2,288.00	1,372,800
日新電機	3,100	1,160.00	3,596,000
大崎電気工業	2,600	603.00	1,567,800
オムロン	11,700	8,120.00	95,004,000
日東工業	1,900	2,015.00	3,828,500
I D E C	1,900	1,996.00	3,792,400
正興電機製作所	300	1,035.00	310,500
不二電機工業	200	1,309.00	261,800
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,400	1,886.00	8,298,400
サクサホールディングス	300	1,439.00	431,700
メルコホールディングス	500	2,418.00	1,209,000
テクノメディカ	300	1,843.00	552,900
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	912.00	273,600
日本電気	15,800	5,600.00	88,480,000
富士通	12,600	13,440.00	169,344,000
沖電気工業	5,300	1,081.00	5,729,300
岩崎通信機	600	838.00	502,800
電気興業	600	2,655.00	1,593,000
サンケン電気	1,400	2,517.00	3,523,800
ナカヨ	300	1,449.00	434,700
アイホン	700	1,489.00	1,042,300
ルネサスエレクトロニクス	55,800	785.00	43,803,000
セイコーエプソン	16,200	1,319.00	21,367,800
ワコム	8,800	684.00	6,019,200
アルバック	2,400	3,925.00	9,420,000
アクセル	500	863.00	431,500
E I Z O	1,000	4,040.00	4,040,000
ジャパンディスプレイ	37,800	58.00	2,192,400
日本信号	3,300	1,084.00	3,577,200
京三製作所	3,100	473.00	1,466,300
能美防災	1,700	2,226.00	3,784,200
ホーチキ	900	1,306.00	1,175,400
星和電機	600	566.00	339,600
エレコム	1,500	4,895.00	7,342,500

パナソニック	149,200	982.70	146,618,840
シャープ	15,100	1,346.00	20,324,600
アンリツ	8,400	2,288.00	19,219,200
富士通ゼネラル	3,500	2,945.00	10,307,500
ソニー	81,800	8,058.00	659,144,400
T D K	6,300	11,790.00	74,277,000
帝国通信工業	600	1,199.00	719,400
タムラ製作所	4,400	549.00	2,415,600
アルプスアルパイン	11,600	1,670.00	19,372,000
池上通信機	400	854.00	341,600
日本電波工業	1,200	357.00	428,400
鈴木	600	679.00	407,400
日本トリム	200	3,790.00	758,000
ローランド ディー . ジー .	800	1,288.00	1,030,400
フォスター電機	1,400	1,261.00	1,765,400
S M K	300	2,561.00	768,300
ヨコオ	800	2,696.00	2,156,800
ティアック	900	118.00	106,200
ホシデン	3,600	996.00	3,585,600
ヒロセ電機	2,000	12,520.00	25,040,000
日本航空電子工業	3,000	1,480.00	4,440,000
T O A	1,400	806.00	1,128,400
マクセルホールディングス	2,800	1,120.00	3,136,000
古野電気	1,700	981.00	1,667,700
ユニデンホールディングス	400	1,579.00	631,600
スミダコーポレーション	1,100	762.00	838,200
アイコム	700	2,754.00	1,927,800
リオン	500	2,329.00	1,164,500
本多通信工業	1,100	454.00	499,400
船井電機	1,300	468.00	608,400
横河電機	12,000	1,759.00	21,108,000
新電元工業	500	2,043.00	1,021,500
アズビル	8,200	3,465.00	28,413,000
東亜ディーケーケー	600	856.00	513,600
日本光電工業	5,400	3,430.00	18,522,000
チノー	500	1,352.00	676,000

共和電業	1,400	425.00	595,000	
日本電子材料	500	2,080.00	1,040,000	
堀場製作所	2,600	5,680.00	14,768,000	
アドバンテスト	9,700	5,070.00	49,179,000	
小野測器	500	530.00	265,000	
エスペック	1,200	1,847.00	2,216,400	
キーエンス	11,800	45,140.00	532,652,000	
日置電機	600	3,915.00	2,349,000	
シスメックス	9,300	9,550.00	88,815,000	
日本マイクロニクス	2,300	1,066.00	2,451,800	
メガチップス	1,200	2,564.00	3,076,800	
O B A R A G R O U P	800	3,765.00	3,012,000	
澤藤電機	200	1,850.00	370,000	
原田工業	600	888.00	532,800	
コーセル	1,700	937.00	1,592,900	
イリソ電子工業	1,100	4,290.00	4,719,000	
オブテックスグループ	2,100	1,481.00	3,110,100	
千代田インテグレ	500	1,610.00	805,000	
アイ・オー・データ機器	400	1,053.00	421,200	
レーザーテック	5,700	8,290.00	47,253,000	
スタンレー電気	9,200	3,250.00	29,900,000	
岩崎電気	500	1,482.00	741,000	
ウシオ電機	7,200	1,333.00	9,597,600	
岡谷電機産業	1,000	333.00	333,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,200	295.00	354,000	
エノモト	400	1,076.00	430,400	
日本セラミック	1,300	2,662.00	3,460,600	
遠藤照明	700	631.00	441,700	
古河電池	900	1,095.00	985,500	
双信電機	600	415.00	249,000	
山一電機	900	1,349.00	1,214,100	
図研	800	2,584.00	2,067,200	
日本電子	2,600	3,235.00	8,411,000	
カシオ計算機	11,600	1,764.00	20,462,400	
ファナック	12,300	20,955.00	257,746,500	
日本シイエムケイ	3,100	499.00	1,546,900	

エンプラス	700	2,283.00	1,598,100	
大真空	500	1,697.00	848,500	
ローム	5,400	7,950.00	42,930,000	
浜松ホトニクス	9,400	5,060.00	47,564,000	
三井ハイテック	1,400	1,986.00	2,780,400	
新光電気工業	4,400	1,700.00	7,480,000	
京セラ	18,400	6,247.00	114,944,800	
太陽誘電	5,800	3,150.00	18,270,000	
村田製作所	38,400	6,615.00	254,016,000	
双葉電子工業	2,100	931.00	1,955,100	
北陸電気工業	500	925.00	462,500	
ニチコン	4,400	825.00	3,630,000	
日本ケミコン	1,000	1,496.00	1,496,000	
K O A	2,000	1,102.00	2,204,000	
市光工業	2,000	501.00	1,002,000	
小糸製作所	7,800	5,640.00	43,992,000	
ミツバ	2,400	407.00	976,800	
S C R E E Nホールディングス	2,300	5,580.00	12,834,000	
キャノン電子	1,200	1,475.00	1,770,000	
キャノン	64,900	1,780.00	115,522,000	
リコー	33,200	744.00	24,700,800	
象印マホービン	3,500	1,705.00	5,967,500	
M U T O Hホールディングス	200	1,500.00	300,000	
東京エレクトロン	8,300	25,840.00	214,472,000	
トヨタ紡織	3,800	1,531.00	5,817,800	
芦森工業	300	905.00	271,500	
ユニプレス	2,500	936.00	2,340,000	
豊田自動織機	10,600	6,700.00	71,020,000	
モリタホールディングス	2,300	1,953.00	4,491,900	
三櫻工業	1,700	630.00	1,071,000	
デンソー	28,800	4,555.00	131,184,000	
東海理化電機製作所	3,400	1,617.00	5,497,800	
三井E & Sホールディングス	4,700	425.00	1,997,500	
川崎重工業	10,200	1,578.00	16,095,600	
名村造船所	4,200	160.00	672,000	
サノヤスホールディングス	1,500	163.00	244,500	

日本車輛製造	500	2,892.00	1,446,000	
三菱ロジスネクスト	1,700	980.00	1,666,000	
近畿車輛	200	1,370.00	274,000	
日産自動車	154,100	398.20	61,362,620	
いすゞ自動車	37,900	1,028.00	38,961,200	
トヨタ自動車	145,800	7,066.00	1,030,222,800	
日野自動車	16,300	713.00	11,621,900	
三菱自動車工業	48,300	262.00	12,654,600	
エフテック	900	518.00	466,200	
レシップホールディングス	500	615.00	307,500	
G M B	200	643.00	128,600	
ファルテック	200	614.00	122,800	
武蔵精密工業	2,900	1,157.00	3,355,300	
日産車体	2,600	944.00	2,454,400	
新明和工業	3,500	939.00	3,286,500	
極東開発工業	2,400	1,391.00	3,338,400	
日信工業	1,800	2,247.00	4,044,600	
トピー工業	1,100	1,182.00	1,300,200	
ティラド	500	1,293.00	646,500	
曙ブレーキ工業	7,100	164.00	1,164,400	
タチエス	2,100	944.00	1,982,400	
N O K	7,000	1,182.00	8,274,000	
フタバ産業	3,600	560.00	2,016,000	
K Y B	1,500	2,191.00	3,286,500	
大同メタル工業	2,500	540.00	1,350,000	
プレス工業	6,500	307.00	1,995,500	
ミクニ	1,600	274.00	438,400	
太平洋工業	2,700	1,040.00	2,808,000	
ケーヒン	2,100	2,592.00	5,443,200	
河西工業	1,800	366.00	658,800	
アイシン精機	10,800	3,480.00	37,584,000	
マツダ	38,400	669.00	25,689,600	
今仙電機製作所	1,200	718.00	861,600	
本田技研工業	102,900	2,699.50	277,778,550	
スズキ	25,900	4,412.00	114,270,800	
S U B A R U	40,600	2,208.00	89,644,800	



安永	600	1,117.00	670,200
ヤマハ発動機	18,500	1,701.00	31,468,500
ショーワ	2,100	2,294.00	4,817,400
T B K	1,600	442.00	707,200
エクセディ	1,800	1,437.00	2,586,600
豊田合成	4,200	2,410.00	10,122,000
愛三工業	2,000	495.00	990,000
盟和産業	200	927.00	185,400
日本プラスト	1,000	442.00	442,000
ヨロズ	1,200	1,008.00	1,209,600
エフ・シー・シー	2,100	2,045.00	4,294,500
シマノ	4,900	21,060.00	103,194,000
テイ・エス テック	3,000	3,325.00	9,975,000
ジャムコ	700	701.00	490,700
テルモ	37,000	4,318.00	159,766,000
クリエートメディック	400	1,018.00	407,200
日機装	4,200	1,116.00	4,687,200
日本エム・ディ・エム	800	2,198.00	1,758,400
島津製作所	15,600	3,290.00	51,324,000
J M S	1,100	915.00	1,006,500
クボテック	300	349.00	104,700
長野計器	900	869.00	782,100
ブイ・テクノロジー	600	4,160.00	2,496,000
東京計器	800	929.00	743,200
愛知時計電機	200	4,455.00	891,000
インターアクション	700	2,004.00	1,402,800
オーバル	1,100	232.00	255,200
東京精密	2,400	3,290.00	7,896,000
マニー	5,200	2,811.00	14,617,200
ニコン	19,900	761.00	15,143,900
トプコン	6,600	1,001.00	6,606,600
オリンパス	72,300	2,157.50	155,987,250
理研計器	1,200	2,696.00	3,235,200
タムロン	1,100	1,719.00	1,890,900
H O Y A	25,900	10,910.00	282,569,000
シード	600	701.00	420,600

ノーリツ鋼機	900	1,626.00	1,463,400
エー・アンド・デイ	1,200	659.00	790,800
朝日インテック	14,800	3,050.00	45,140,000
シチズン時計	15,300	332.00	5,079,600
リズム時計工業	400	642.00	256,800
大研医器	900	558.00	502,200
メニコン	1,900	6,740.00	12,806,000
シンシア	100	395.00	39,500
松風	600	1,515.00	909,000
セイコーホールディングス	1,800	1,594.00	2,869,200
ニプロ	9,000	1,240.00	11,160,000
中本パックス	300	1,550.00	465,000
スノーピーク	800	1,915.00	1,532,000
パラマウントベッドホールディングス	1,400	4,335.00	6,069,000
トランザクション	700	1,124.00	786,800
粧美堂	400	400.00	160,000
ニホンフラッシュ	1,200	1,397.00	1,676,400
前田工織	1,400	2,565.00	3,591,000
永大産業	1,700	308.00	523,600
アートネイチャー	1,400	641.00	897,400
バンダイナムコホールディングス	13,500	6,924.00	93,474,000
アイフィスジャパン	300	860.00	258,000
共立印刷	2,100	138.00	289,800
S H O E I	1,100	3,505.00	3,855,500
フランスベッドホールディングス	1,800	888.00	1,598,400
パイロットコーポレーション	2,300	3,230.00	7,429,000
萩原工業	700	1,542.00	1,079,400
トッパン・フォームズ	2,800	976.00	2,732,800
フジシールインターナショナル	2,900	1,979.00	5,739,100
タカラトミー	5,900	854.00	5,038,600
廣濟堂	900	680.00	612,000
エステールホールディングス	300	661.00	198,300
タカノ	500	624.00	312,000
プロネクサス	1,100	1,117.00	1,228,700
ホクシン	700	119.00	83,300
ウッドワン	400	1,230.00	492,000

大建工業	900	1,755.00	1,579,500	
凸版印刷	18,400	1,555.00	28,612,000	
大日本印刷	17,100	2,186.00	37,380,600	
共同印刷	400	2,645.00	1,058,000	
N I S S H A	2,700	1,265.00	3,415,500	
光村印刷	100	1,722.00	172,200	
T A K A R A & C O M P A N Y	600	2,299.00	1,379,400	
アシックス	11,600	1,459.00	16,924,400	
ツツミ	400	2,088.00	835,200	
小松ウオール工業	400	1,806.00	722,400	
ヤマハ	7,800	5,280.00	41,184,000	
河合楽器製作所	400	2,737.00	1,094,800	
クリナップ	1,200	510.00	612,000	
ピジョン	8,400	4,600.00	38,640,000	
オリバー	300	2,516.00	754,800	
兼松サステック	100	1,612.00	161,200	
キングジム	1,100	882.00	970,200	
リンテック	3,100	2,481.00	7,691,100	
イトーキ	2,600	362.00	941,200	
任天堂	8,000	59,730.00	477,840,000	
三菱鉛筆	2,200	1,309.00	2,879,800	
タカラスタANDARD	2,700	1,356.00	3,661,200	
コクヨ	6,300	1,292.00	8,139,600	
ナカバヤシ	1,300	633.00	822,900	
グローブライド	600	3,225.00	1,935,000	
オカムラ	4,600	750.00	3,450,000	
美津濃	1,200	2,003.00	2,403,600	
東京電力ホールディングス	104,300	312.00	32,541,600	
中部電力	40,000	1,348.50	53,940,000	
関西電力	49,500	1,071.50	53,039,250	
中国電力	18,800	1,325.00	24,910,000	
北陸電力	11,900	777.00	9,246,300	
東北電力	32,600	1,096.00	35,729,600	
四国電力	11,800	797.00	9,404,600	
九州電力	26,900	979.00	26,335,100	
北海道電力	12,200	458.00	5,587,600	

沖縄電力	2,500	1,712.00	4,280,000	
電源開発	10,400	1,680.00	17,472,000	
エフオン	700	631.00	441,700	
イーレックス	1,900	1,116.00	2,120,400	
レノバ	2,200	1,272.00	2,798,400	
東京瓦斯	25,100	2,359.00	59,210,900	
大阪瓦斯	25,300	2,057.00	52,042,100	
東邦瓦斯	6,400	4,750.00	30,400,000	
北海道瓦斯	700	1,590.00	1,113,000	
広島ガス	2,700	367.00	990,900	
西部瓦斯	1,500	2,690.00	4,035,000	
静岡ガス	3,700	890.00	3,293,000	
メタウォーター	600	4,560.00	2,736,000	
SBSホールディングス	1,000	2,003.00	2,003,000	
東武鉄道	13,600	3,365.00	45,764,000	
相鉄ホールディングス	4,200	2,948.00	12,381,600	
東急	32,900	1,453.00	47,803,700	
京浜急行電鉄	16,800	1,629.00	27,367,200	
小田急電鉄	19,400	2,605.00	50,537,000	
京王電鉄	6,800	6,570.00	44,676,000	
京成電鉄	9,100	3,130.00	28,483,000	
富士急行	1,800	3,750.00	6,750,000	
新京成電鉄	300	2,335.00	700,500	
東日本旅客鉄道	23,000	6,972.00	160,356,000	
西日本旅客鉄道	11,600	5,780.00	67,048,000	
東海旅客鉄道	10,900	16,800.00	183,120,000	
西武ホールディングス	17,100	1,303.00	22,281,300	
鴻池運輸	2,100	1,146.00	2,406,600	
西日本鉄道	3,600	3,100.00	11,160,000	
ハマキョウレックス	1,000	3,250.00	3,250,000	
サカイ引越センター	700	5,050.00	3,535,000	
近鉄グループホールディングス	12,400	4,765.00	59,086,000	
阪急阪神ホールディングス	16,500	3,560.00	58,740,000	
南海電気鉄道	5,900	2,368.00	13,971,200	
京阪ホールディングス	5,500	4,560.00	25,080,000	
神戸電鉄	300	3,910.00	1,173,000	

名古屋鉄道	10,200	2,964.00	30,232,800	
山陽電気鉄道	900	2,135.00	1,921,500	
日本通運	4,300	6,230.00	26,789,000	
ヤマトホールディングス	21,700	2,594.00	56,289,800	
山九	3,400	4,540.00	15,436,000	
丸運	700	237.00	165,900	
丸全昭和運輸	1,000	3,275.00	3,275,000	
センコーグループホールディングス	6,800	969.00	6,589,200	
トナミホールディングス	300	6,080.00	1,824,000	
ニッコンホールディングス	4,400	2,311.00	10,168,400	
日本石油輸送	100	2,653.00	265,300	
福山通運	1,600	5,090.00	8,144,000	
セイノーホールディングス	9,300	1,588.00	14,768,400	
エスライン	400	977.00	390,800	
神奈川中央交通	300	4,275.00	1,282,500	
日立物流	2,300	3,595.00	8,268,500	
丸和運輸機関	1,300	3,665.00	4,764,500	
C & F ロジホールディングス	1,300	1,567.00	2,037,100	
九州旅客鉄道	10,800	2,322.00	25,077,600	
S Gホールディングス	13,000	4,555.00	59,215,000	
日本郵船	10,300	1,865.00	19,209,500	
商船三井	7,800	2,278.00	17,768,400	
川崎汽船	3,800	1,263.00	4,799,400	
N S ユナイテッド海運	700	1,467.00	1,026,900	
明治海運	1,300	346.00	449,800	
飯野海運	5,900	376.00	2,218,400	
共栄タンカー	200	793.00	158,600	
乾汽船	700	879.00	615,300	
日本航空	21,900	2,206.00	48,311,400	
A N Aホールディングス	22,600	2,787.00	62,986,200	
パスコ	200	1,440.00	288,000	
トランコム	300	7,270.00	2,181,000	
日新	1,100	1,566.00	1,722,600	
三菱倉庫	3,900	3,070.00	11,973,000	
三井倉庫ホールディングス	1,400	1,834.00	2,567,600	
住友倉庫	4,400	1,364.00	6,001,600	

澁澤倉庫	700	2,158.00	1,510,600
東陽倉庫	2,200	339.00	745,800
日本トランスシティ	2,700	535.00	1,444,500
ケイヒン	200	1,339.00	267,800
中央倉庫	800	1,100.00	880,000
川西倉庫	200	1,130.00	226,000
安田倉庫	1,000	950.00	950,000
ファイズホールディングス	300	1,089.00	326,700
東洋埠頭	400	1,450.00	580,000
宇徳	1,100	480.00	528,000
上組	6,900	2,133.00	14,717,700
サンリツ	300	635.00	190,500
キムラユニティー	300	1,088.00	326,400
キューソー流通システム	300	1,543.00	462,900
近鉄エクスプレス	2,600	2,067.00	5,374,200
東海運	700	317.00	221,900
エーアイティー	900	979.00	881,100
内外トランスライン	400	1,164.00	465,600
日本コンセプト	400	1,461.00	584,400
N E C ネットズエスアイ	3,600	1,930.00	6,948,000
クロスキャット	300	1,388.00	416,400
システナ	4,600	1,808.00	8,316,800
デジタルアーツ	600	7,820.00	4,692,000
日鉄ソリューションズ	1,900	3,020.00	5,738,000
キューブシステム	700	1,270.00	889,000
エイジア	200	2,188.00	437,600
コア	500	1,383.00	691,500
ラクーンホールディングス	600	2,061.00	1,236,600
ソリトンシステムズ	600	1,892.00	1,135,200
ソフトクリエイイトホールディングス	600	2,723.00	1,633,800
T I S	12,800	2,060.00	26,368,000
J N S ホールディングス	500	694.00	347,000
電算システム	400	3,625.00	1,450,000
グリー	7,900	465.00	3,673,500
コーエーテクモホールディングス	2,600	4,400.00	11,440,000
三菱総合研究所	500	4,140.00	2,070,000

ボルテージ	300	576.00	172,800
電算	100	2,278.00	227,800
A G S	700	848.00	593,600
ファインデックス	1,100	1,275.00	1,402,500
ブレインパッド	300	4,095.00	1,228,500
K L a b	2,300	926.00	2,129,800
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,500	952.00	1,428,000
イーブックイニシアティブジャパン	200	3,195.00	639,000
ネクソン	32,300	2,588.00	83,592,400
アイスタイル	3,600	320.00	1,152,000
エムアップホールディングス	400	3,280.00	1,312,000
エイチーム	900	916.00	824,400
エニグモ	1,200	1,590.00	1,908,000
テクノスジャパン	1,000	930.00	930,000
e n i s h	700	672.00	470,400
コロブラ	4,200	936.00	3,931,200
オルトプラス	800	551.00	440,800
ブロードリーフ	6,400	518.00	3,315,200
クロス・マーケティンググループ	600	351.00	210,600
デジタルハーツホールディングス	700	1,100.00	770,000
システム情報	1,000	1,300.00	1,300,000
メディアドゥ	400	7,050.00	2,820,000
じげん	3,200	349.00	1,116,800
ブイキューブ	700	1,590.00	1,113,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	829.00	248,700
サイバーリンクス	200	2,195.00	439,000
ディー・エル・イー	1,000	464.00	464,000
フィックスターズ	1,400	1,036.00	1,450,400
C A R T A H O L D I N G S	500	1,202.00	601,000
オブティム	700	3,045.00	2,131,500
セレス	400	2,173.00	869,200
S H I F T	500	12,490.00	6,245,000
ティーガイア	1,100	2,076.00	2,283,600
セック	200	3,135.00	627,000
日本アジアグループ	1,300	297.00	386,100

テクマトリックス	1,800	2,073.00	3,731,400	
プロシップ	400	1,518.00	607,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,100	2,317.00	7,182,700	
GMOペイメントゲートウェイ	2,700	10,570.00	28,539,000	
ザッパラス	600	437.00	262,200	
システムリサーチ	300	1,805.00	541,500	
インターネットイニシアティブ	1,900	4,195.00	7,970,500	
さくらインターネット	1,400	783.00	1,096,200	
ヴィンクス	400	1,262.00	504,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	8,630.00	2,589,000	
SRAホールディングス	700	2,348.00	1,643,600	
システムインテグレータ	400	739.00	295,600	
朝日ネット	900	921.00	828,900	
eBASE	1,500	1,304.00	1,956,000	
アバント	1,200	1,006.00	1,207,200	
アドソル日進	500	2,476.00	1,238,000	
フリービット	700	959.00	671,300	
コムチュア	1,400	2,593.00	3,630,200	
サイバーコム	200	1,859.00	371,800	
アステリア	800	745.00	596,000	
アイル	700	1,415.00	990,500	
マークラインズ	500	2,155.00	1,077,500	
メディカル・データ・ビジョン	1,500	1,883.00	2,824,500	
gumi	1,600	1,091.00	1,745,600	
ショーケース	300	1,145.00	343,500	
モバイルファクトリー	300	1,264.00	379,200	
テラスカイ	500	4,500.00	2,250,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,332.00	666,000	
PCIホールディングス	500	1,236.00	618,000	
パイブドHD	200	1,760.00	352,000	
アイビーシー	200	1,010.00	202,000	
ネオジャパン	200	2,338.00	467,600	
PR TIMES	200	2,484.00	496,800	
ランドコンピュータ	200	1,032.00	206,400	
ダブルスタンダード	200	4,610.00	922,000	



オーブンドア	600	1,370.00	822,000
マイネット	400	1,301.00	520,400
アカツキ	500	4,340.00	2,170,000
ベネフィットジャパン	100	1,909.00	190,900
U b i c o mホールディングス	300	1,966.00	589,800
L I N E	3,200	5,370.00	17,184,000
カナミックネットワーク	1,200	780.00	936,000
ノムラシステムコーポレーション	600	414.00	248,400
チェンジ	900	9,520.00	8,568,000
シンクロ・フード	500	361.00	180,500
オークネット	700	1,290.00	903,000
セグエグループ	300	1,295.00	388,500
エイトレッド	200	2,088.00	417,600
A O I T Y O H o l d i n g s	1,300	419.00	544,700
マクロミル	2,600	823.00	2,139,800
ピーグリー	300	1,563.00	468,900
オロ	400	3,305.00	1,322,000
ユーザーローカル	100	4,420.00	442,000
テモナ	300	1,376.00	412,800
ニーズウェル	200	757.00	151,400
サインポスト	300	1,375.00	412,500
ソルクシーズ	500	968.00	484,000
フェイス	400	1,043.00	417,200
プロトコーポレーション	1,100	1,264.00	1,390,400
ハイマックス	200	2,319.00	463,800
野村総合研究所	18,200	2,895.00	52,689,000
サイバネットシステム	900	851.00	765,900
C Eホールディングス	700	632.00	442,400
日本システム技術	200	1,832.00	366,400
インテージホールディングス	1,600	905.00	1,448,000
東邦システムサイエンス	300	954.00	286,200
ソースネクスト	6,100	301.00	1,836,100
インフォコム	1,400	3,755.00	5,257,000
H E R O Z	200	3,875.00	775,000
ラクスル	1,000	4,255.00	4,255,000
F I G	1,400	261.00	365,400

システムサポート	300	1,859.00	557,700
イーソル	700	1,232.00	862,400
アルテリア・ネットワークス	1,400	1,822.00	2,550,800
東海ソフト	100	1,280.00	128,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	1,199.00	239,800
東名	100	1,366.00	136,600
ヴィッツ	100	3,725.00	372,500
トピラスシステムズ	100	2,042.00	204,200
Link-U	100	2,264.00	226,400
フォーカスシステムズ	800	902.00	721,600
クレスコ	800	1,305.00	1,044,000
フジ・メディア・ホールディングス	12,300	1,068.00	13,136,400
オービック	4,400	18,430.00	81,092,000
ジャストシステム	2,100	6,840.00	14,364,000
TDCソフト	1,100	970.00	1,067,000
Zホールディングス	176,000	660.00	116,160,000
トレンドマイクロ	6,800	6,240.00	42,432,000
IDホールディングス	500	1,424.00	712,000
日本オラクル	2,600	12,190.00	31,694,000
アルファシステムズ	400	3,820.00	1,528,000
フューチャー	1,500	1,968.00	2,952,000
CAC Holdings	800	1,381.00	1,104,800
SBテクノロジー	500	3,385.00	1,692,500
トーセ	300	946.00	283,800
オービックビジネスコンサルタント	1,300	5,710.00	7,423,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,800	3,865.00	22,417,000
アイティフォー	1,600	848.00	1,356,800
東計電算	200	4,560.00	912,000
エクスネット	200	969.00	193,800
大塚商会	6,900	5,290.00	36,501,000
サイボウズ	1,500	3,085.00	4,627,500
ソフトブレーン	1,000	868.00	868,000
電通国際情報サービス	800	5,730.00	4,584,000
ACCESS	1,200	925.00	1,110,000
デジタルガレージ	2,300	3,525.00	8,107,500

EMシステムズ	1,800	864.00	1,555,200
ウェザーニューズ	400	5,290.00	2,116,000
C I J	900	872.00	784,800
ビジネスエンジニアリング	100	3,265.00	326,500
日本エンタープライズ	1,300	299.00	388,700
WOWOW	600	2,866.00	1,719,600
スカラ	900	869.00	782,100
インテリジェント ウェイブ	700	758.00	530,600
I M A G I C A G R O U P	1,100	392.00	431,200
ネットワンシステムズ	4,900	4,360.00	21,364,000
システムソフト	2,700	100.00	270,000
アルゴグラフィックス	1,100	3,490.00	3,839,000
マーベラス	2,000	779.00	1,558,000
エイベックス	2,200	1,026.00	2,257,200
日本ユニシス	4,000	3,140.00	12,560,000
兼松エレクトロニクス	700	4,095.00	2,866,500
都築電気	400	1,648.00	659,200
東京放送ホールディングス	7,800	1,842.00	14,367,600
日本テレビホールディングス	10,700	1,224.00	13,096,800
朝日放送グループホールディングス	1,300	725.00	942,500
テレビ朝日ホールディングス	3,500	1,705.00	5,967,500
スカパー J S A Tホールディングス	8,400	455.00	3,822,000
テレビ東京ホールディングス	1,100	2,344.00	2,578,400
日本BS放送	400	1,115.00	446,000
ビジョン	1,600	836.00	1,337,600
スマートバリュー	300	1,094.00	328,200
U S E N - N E X T H O L D I N G S	500	1,224.00	612,000
ワイヤレスゲート	500	794.00	397,000
コネクシオ	700	1,204.00	842,800
日本通信	10,000	238.00	2,380,000
クロップス	200	824.00	164,800
日本電信電話	171,300	2,260.00	387,138,000
K D D I	93,500	2,805.00	262,267,500
ソフトバンク	116,500	1,278.50	148,945,250
光通信	1,300	24,070.00	31,291,000
N T T ドコモ	91,700	2,738.00	251,074,600

エムティーアイ	1,200	739.00	886,800
GMOインターネット	4,600	2,669.00	12,277,400
ファイバーゲート	400	1,824.00	729,600
アйдママーケティングコミュニケーション	400	483.00	193,200
KADOKAWA	3,500	2,589.00	9,061,500
学研ホールディングス	1,700	1,605.00	2,728,500
ゼンリン	2,600	1,148.00	2,984,800
昭文社ホールディングス	600	488.00	292,800
インプレスホールディングス	1,000	165.00	165,000
アイネット	700	1,577.00	1,103,900
松竹	800	15,210.00	12,168,000
東宝	7,600	4,200.00	31,920,000
東映	500	17,200.00	8,600,000
エヌ・ティ・ティ・データ	34,100	1,260.00	42,966,000
ピー・シー・エー	200	4,585.00	917,000
ビジネスブレイン太田昭和	400	1,383.00	553,200
D T S	2,900	2,258.00	6,548,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,500	6,750.00	37,125,000
シーイーシー	1,400	1,543.00	2,160,200
カブコン	6,000	5,750.00	34,500,000
アイ・エス・ビー	300	2,430.00	729,000
ジャステック	800	1,371.00	1,096,800
S C S K	3,000	5,530.00	16,590,000
日本システムウエア	400	1,988.00	795,200
アイネス	1,300	1,531.00	1,990,300
T K C	1,100	6,030.00	6,633,000
富士ソフト	1,400	4,820.00	6,748,000
N S D	4,100	1,883.00	7,720,300
コナミホールディングス	4,700	4,440.00	20,868,000
福井コンピュータホールディングス	500	2,909.00	1,454,500
J B C Cホールディングス	900	1,685.00	1,516,500
ミロク情報サービス	1,100	2,151.00	2,366,100
ソフトバンクグループ	101,700	6,407.00	651,591,900
ハウスイ	100	922.00	92,200
高千穂交易	500	986.00	493,000
カワニシホールディングス	200	1,399.00	279,800

伊藤忠食品	300	5,480.00	1,644,000
エレマテック	1,200	957.00	1,148,400
JALUX	400	1,632.00	652,800
あらた	1,000	5,040.00	5,040,000
トーメンデバイス	200	3,920.00	784,000
東京エレクトロン デバイス	500	2,986.00	1,493,000
フィールズ	1,000	347.00	347,000
双日	71,100	250.00	17,775,000
アルフレッサ ホールディングス	14,300	2,295.00	32,818,500
横浜冷凍	3,400	914.00	3,107,600
神栄	200	539.00	107,800
ラサ商事	700	970.00	679,000
アルコニックス	1,400	1,508.00	2,111,200
神戸物産	4,400	5,280.00	23,232,000
ハイパー	200	564.00	112,800
あい ホールディングス	1,800	1,876.00	3,376,800
ディーブイエックス	500	915.00	457,500
ダイワボウホールディングス	1,100	6,390.00	7,029,000
マクニカ・富士エレホールディングス	3,100	1,898.00	5,883,800
ラクト・ジャパン	600	3,720.00	2,232,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,400	1,080.00	2,592,000
八洲電機	1,000	976.00	976,000
メディアスホールディングス	700	871.00	609,700
レスターホールディングス	1,300	2,193.00	2,850,900
ジューテックホールディングス	300	1,015.00	304,500
大光	500	684.00	342,000
OCHIホールディングス	400	1,531.00	612,400
TOKAIホールディングス	6,800	1,031.00	7,010,800
黒谷	300	534.00	160,200
Cominix	200	721.00	144,200
三洋貿易	1,300	1,019.00	1,324,700
ビューティガレージ	200	2,707.00	541,400
ウイン・パートナーズ	900	987.00	888,300
ミタチ産業	400	605.00	242,000
シップヘルスケアホールディングス	2,100	5,050.00	10,605,000
明治電機工業	400	1,415.00	566,000

デリカフーズホールディングス	500	682.00	341,000	
スターティアホールディングス	300	634.00	190,200	
コメダホールディングス	2,800	1,901.00	5,322,800	
ピーバンドットコム	100	961.00	96,100	
アセンテック	300	1,975.00	592,500	
富士興産	400	687.00	274,800	
協栄産業	100	1,384.00	138,400	
小野建	1,200	1,139.00	1,366,800	
南陽	300	1,649.00	494,700	
佐島電機	900	843.00	758,700	
エコートレーディング	300	580.00	174,000	
伯東	800	1,135.00	908,000	
コンドーテック	1,000	1,272.00	1,272,000	
中山福	700	479.00	335,300	
ナガイレーベン	1,700	2,727.00	4,635,900	
三菱食品	1,400	2,791.00	3,907,400	
松田産業	900	1,510.00	1,359,000	
第一興商	1,900	3,430.00	6,517,000	
メディバルホールディングス	13,900	2,113.00	29,370,700	
S P K	600	1,383.00	829,800	
萩原電気ホールディングス	500	2,139.00	1,069,500	
アズワン	800	14,400.00	11,520,000	
スズデン	400	1,171.00	468,400	
尾家産業	400	1,580.00	632,000	
シモジマ	800	1,296.00	1,036,800	
ドウシシャ	1,200	2,147.00	2,576,400	
小津産業	300	1,815.00	544,500	
高速	800	1,549.00	1,239,200	
たけびし	500	1,499.00	749,500	
リックス	300	1,566.00	469,800	
丸文	1,100	486.00	534,600	
ハビネット	1,100	1,326.00	1,458,600	
橋本総業ホールディングス	300	2,500.00	750,000	
日本ライフライン	3,800	1,468.00	5,578,400	
タカショー	800	656.00	524,800	
マルカ	400	2,017.00	806,800	

I D O M	3,500	631.00	2,208,500
進和	800	2,143.00	1,714,400
エスケイジャパン	300	302.00	90,600
ダイترون	500	1,469.00	734,500
シークス	1,600	1,165.00	1,864,000
田中商事	400	737.00	294,800
オーハシテクニカ	700	1,385.00	969,500
白銅	500	1,264.00	632,000
ダイコー通産	100	1,304.00	130,400
伊藤忠商事	90,000	2,732.00	245,880,000
丸紅	133,900	659.40	88,293,660
高島	200	1,898.00	379,600
長瀬産業	7,200	1,508.00	10,857,600
蝶理	800	1,615.00	1,292,000
豊田通商	14,400	3,185.00	45,864,000
三共生興	1,900	426.00	809,400
兼松	4,800	1,338.00	6,422,400
ツカモトコーポレーション	200	1,262.00	252,400
三井物産	111,400	1,912.00	212,996,800
日本紙パルプ商事	700	3,735.00	2,614,500
カメイ	1,700	1,129.00	1,919,300
東都水産	200	3,470.00	694,000
O U Gホールディングス	200	2,839.00	567,800
スターゼン	500	4,030.00	2,015,000
山善	5,000	1,057.00	5,285,000
椿本興業	200	3,505.00	701,000
住友商事	81,200	1,333.50	108,280,200
内田洋行	500	5,210.00	2,605,000
三菱商事	84,400	2,564.00	216,401,600
第一実業	600	3,670.00	2,202,000
キャノンマーケティングジャパン	3,200	1,988.00	6,361,600
西華産業	700	1,358.00	950,600
佐藤商事	1,100	935.00	1,028,500
菱洋エレクトロ	1,300	2,832.00	3,681,600
東京産業	1,200	512.00	614,400
ユアサ商事	1,200	3,225.00	3,870,000

神鋼商事	300	1,749.00	524,700
トルク	700	317.00	221,900
阪和興業	2,400	2,253.00	5,407,200
正栄食品工業	800	4,265.00	3,412,000
カナデン	1,000	1,450.00	1,450,000
菱電商事	900	1,470.00	1,323,000
フルサト工業	700	1,354.00	947,800
岩谷産業	2,900	4,130.00	11,977,000
ナイス	500	1,448.00	724,000
昭光通商	400	620.00	248,000
ニチモウ	200	1,992.00	398,400
極東貿易	400	1,378.00	551,200
イワキ	1,700	505.00	858,500
三愛石油	3,200	963.00	3,081,600
稲畑産業	2,800	1,371.00	3,838,800
G S Iクレオス	300	1,807.00	542,100
明和産業	1,200	489.00	586,800
クワザワ	500	531.00	265,500
ヤマエ久野	900	1,242.00	1,117,800
ワキタ	2,700	989.00	2,670,300
東邦ホールディングス	4,100	2,342.00	9,602,200
サンゲツ	3,500	1,653.00	5,785,500
ミツウロコグループホールディングス	1,900	1,301.00	2,471,900
シナネンホールディングス	500	3,265.00	1,632,500
伊藤忠エネクス	2,800	984.00	2,755,200
サンリオ	3,600	1,931.00	6,951,600
サンワテクノス	900	904.00	813,600
リョーサン	1,400	2,081.00	2,913,400
新光商事	2,000	864.00	1,728,000
トーホー	600	1,925.00	1,155,000
三信電気	700	1,831.00	1,281,700
東陽テクニカ	1,400	986.00	1,380,400
モスフードサービス	1,700	2,981.00	5,067,700
加賀電子	1,300	2,229.00	2,897,700
ソーダニッカ	1,300	535.00	695,500
立花エレテック	900	1,739.00	1,565,100



フォーバル	600	920.00	552,000	
PALTAC	2,100	5,750.00	12,075,000	
三谷産業	1,700	351.00	596,700	
太平洋興発	500	623.00	311,500	
西本Wismettacホールディングス	300	1,905.00	571,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,527.00	152,700	
コア商事ホールディングス	100	1,880.00	188,000	
国際紙パルプ商事	3,000	286.00	858,000	
ヤマタネ	600	1,290.00	774,000	
丸紅建材リース	100	1,742.00	174,200	
日鉄物産	900	3,270.00	2,943,000	
泉州電業	400	3,070.00	1,228,000	
トラスコ中山	2,900	2,578.00	7,476,200	
オートバックスセブン	4,800	1,410.00	6,768,000	
モリト	900	684.00	615,600	
加藤産業	1,900	3,685.00	7,001,500	
北恵	300	1,082.00	324,600	
イノテック	700	1,029.00	720,300	
イエローハット	2,400	1,698.00	4,075,200	
J Kホールディングス	1,200	788.00	945,600	
日伝	1,200	2,321.00	2,785,200	
北沢産業	900	273.00	245,700	
杉本商事	700	1,813.00	1,269,100	
因幡電機産業	3,700	2,636.00	9,753,200	
東テク	400	2,429.00	971,600	
ミスミグループ本社	16,100	3,020.00	48,622,000	
アルテック	900	264.00	237,600	
タキヒヨー	400	1,740.00	696,000	
蔵王産業	200	1,460.00	292,000	
スズケン	5,400	4,135.00	22,329,000	
ジェコス	900	939.00	845,100	
グローセル	1,300	405.00	526,500	
ローソン	3,300	5,120.00	16,896,000	
サンエー	1,100	4,590.00	5,049,000	
カワチ薬品	1,000	2,826.00	2,826,000	
エービーシー・マート	2,000	5,420.00	10,840,000	

ハードオフコーポレーション	500	666.00	333,000	
アスクル	1,300	3,655.00	4,751,500	
ゲオホールディングス	2,300	1,675.00	3,852,500	
アダストリア	1,800	1,646.00	2,962,800	
ジーフット	800	507.00	405,600	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	480.00	96,000	
くら寿司	800	5,380.00	4,304,000	
キャンドウ	600	2,112.00	1,267,200	
パルグループホールディングス	1,300	1,155.00	1,501,500	
エディオン	5,900	1,057.00	6,236,300	
サーラコーポレーション	2,600	573.00	1,489,800	
ワッツ	600	906.00	543,600	
ハローズ	500	4,370.00	2,185,000	
フジオフードグループ本社	1,100	1,386.00	1,524,600	
あみやき亭	300	2,965.00	889,500	
ひらまつ	2,300	249.00	572,700	
大黒天物産	300	5,460.00	1,638,000	
ハニーズホールディングス	1,100	1,018.00	1,119,800	
ファーマライズホールディングス	300	759.00	227,700	
アルペン	1,000	1,922.00	1,922,000	
ハブ	400	701.00	280,400	
クオールホールディングス	1,900	1,240.00	2,356,000	
ジンスホールディングス	700	8,140.00	5,698,000	
ビックカメラ	7,600	1,075.00	8,170,000	
D C Mホールディングス	7,400	1,257.00	9,301,800	
ペッパーフードサービス	1,100	405.00	445,500	
MonotaRO	9,100	4,490.00	40,859,000	
東京一番フーズ	300	600.00	180,000	
D Dホールディングス	500	827.00	413,500	
きちりホールディングス	300	659.00	197,700	
アークランドサービスホールディングス	1,100	2,120.00	2,332,000	
J . フロント リテイリング	15,400	750.00	11,550,000	
ドトール・日レスホールディングス	1,800	1,677.00	3,018,600	
マツモトキヨシホールディングス	5,300	3,515.00	18,629,500	
ブロンコビリー	700	2,374.00	1,661,800	
Z O Z O	8,800	2,746.00	24,164,800	

トレジャー・ファクトリー	400	780.00	312,000	
物語コーポレーション	300	10,410.00	3,123,000	
ココカラファイン	1,300	6,320.00	8,216,000	
三越伊勢丹ホールディングス	22,500	579.00	13,027,500	
H a m e e	500	2,041.00	1,020,500	
ウエルシアホールディングス	7,700	4,205.00	32,378,500	
クリエイトSDホールディングス	2,200	3,600.00	7,920,000	
丸善CHIホールディングス	1,500	373.00	559,500	
ミサワ	300	764.00	229,200	
ティーライフ	200	1,302.00	260,400	
エー・ピーカンパニー	200	437.00	87,400	
チムニー	400	1,463.00	585,200	
シュッピン	900	863.00	776,700	
オイシックス・ラ・大地	1,300	2,969.00	3,859,700	
ネクステージ	2,200	1,160.00	2,552,000	
ジョイフル本田	3,800	1,502.00	5,707,600	
鳥貴族	400	1,470.00	588,000	
麒麟堂ホールディングス	500	3,520.00	1,760,000	
ホットランド	1,000	1,197.00	1,197,000	
すかいらーくホールディングス	14,400	1,497.00	21,556,800	
SFPホールディングス	700	1,414.00	989,800	
綿半ホールディングス	500	2,865.00	1,432,500	
ヨシックス	200	1,831.00	366,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,700	1,171.00	4,332,700	
ゴルフダイジェスト・オンライン	700	630.00	441,000	
B E E N O S	600	1,751.00	1,050,600	
あさひ	1,000	1,802.00	1,802,000	
日本調剤	800	1,676.00	1,340,800	
コスモス薬品	1,100	17,420.00	19,162,000	
トーエル	600	800.00	480,000	
オンリー	200	515.00	103,000	
セブン&アイ・ホールディングス	50,300	3,345.00	168,253,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,900	627.00	4,326,300	
ツルハホールディングス	2,800	14,310.00	40,068,000	
サンマルクホールディングス	1,000	1,657.00	1,657,000	

フェリシモ	300	1,046.00	313,800	
トリドールホールディングス	3,200	1,505.00	4,816,000	
T O K Y O B A S E	1,200	394.00	472,800	
ウイルプラスホールディングス	200	557.00	111,400	
J Mホールディングス	1,000	3,080.00	3,080,000	
サツドラホールディングス	200	2,020.00	404,000	
アレンザホールディングス	600	1,470.00	882,000	
串カツ田中ホールディングス	300	1,782.00	534,600	
パロックジャパンリミテッド	900	621.00	558,900	
クスリのアオキホールディングス	1,200	9,070.00	10,884,000	
力の源ホールディングス	600	702.00	421,200	
スシローグローバルホールディングス	7,100	2,604.00	18,488,400	
L I X I L ビバ	400	2,591.00	1,036,400	
メディカルシステムネットワーク	1,200	469.00	562,800	
はるやまホールディングス	600	729.00	437,400	
ノジマ	2,300	2,774.00	6,380,200	
カッパ・クリエイト	1,800	1,561.00	2,809,800	
ライトオン	1,000	550.00	550,000	
ジーンズメイト	300	215.00	64,500	
良品計画	17,100	1,681.00	28,745,100	
三城ホールディングス	1,300	294.00	382,200	
アドヴァン	2,000	1,290.00	2,580,000	
アルビス	500	2,620.00	1,310,000	
コナカ	1,500	284.00	426,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,633.00	326,600	
G - 7ホールディングス	800	2,669.00	2,135,200	
イオン北海道	1,700	823.00	1,399,100	
コジマ	2,200	506.00	1,113,200	
ヒマラヤ	400	933.00	373,200	
コーナン商事	1,800	3,725.00	6,705,000	
エコス	500	2,039.00	1,019,500	
ワタミ	1,500	1,055.00	1,582,500	
マルシェ	300	624.00	187,200	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	28,300	2,300.00	65,090,000	
西松屋チェーン	2,800	1,237.00	3,463,600	

ゼンショーホールディングス	6,200	2,515.00	15,593,000	
幸楽苑ホールディングス	800	1,768.00	1,414,400	
ハークスレイ	300	985.00	295,500	
サイゼリヤ	1,900	2,103.00	3,995,700	
V Tホールディングス	5,300	415.00	2,199,500	
魚力	400	1,835.00	734,000	
ポブラ	300	417.00	125,100	
フジ・コーポレーション	300	2,257.00	677,100	
ユナイテッドアローズ	1,300	1,656.00	2,152,800	
ハイデイ日高	1,900	1,868.00	3,549,200	
京都きもの友禅	800	241.00	192,800	
コロワイド	4,300	1,836.00	7,894,800	
ピーシーデボコーポレーション	1,700	637.00	1,082,900	
壱番屋	900	5,590.00	5,031,000	
トップカルチャー	500	405.00	202,500	
P L A N T	300	821.00	246,300	
スギホールディングス	2,600	7,340.00	19,084,000	
薬王堂ホールディングス	600	2,496.00	1,497,600	
ヴィア・ホールディングス	1,600	355.00	568,000	
スクロール	2,000	857.00	1,714,000	
ヨンドシーホールディングス	1,300	1,834.00	2,384,200	
ファミリーマート	8,600	2,345.00	20,167,000	
木曽路	1,700	2,540.00	4,318,000	
S R Sホールディングス	1,500	989.00	1,483,500	
千趣会	2,300	382.00	878,600	
タカキュー	1,000	138.00	138,000	
リテールパートナーズ	1,700	1,772.00	3,012,400	
ケーヨー	2,600	875.00	2,275,000	
上新電機	1,500	2,296.00	3,444,000	
日本瓦斯	2,000	4,390.00	8,780,000	
ロイヤルホールディングス	2,200	1,901.00	4,182,200	
東天紅	100	1,048.00	104,800	
いなげや	1,600	1,861.00	2,977,600	
島忠	2,400	2,860.00	6,864,000	
チヨダ	1,400	999.00	1,398,600	
ライフコーポレーション	1,000	4,325.00	4,325,000	

リンガーハット	1,600	2,543.00	4,068,800
MrMaxHD	1,800	777.00	1,398,600
テンアライド	1,200	414.00	496,800
AOKIホールディングス	2,600	599.00	1,557,400
オークワ	2,000	1,315.00	2,630,000
コメリ	2,000	3,070.00	6,140,000
青山商事	2,700	609.00	1,644,300
しまむら	1,500	8,600.00	12,900,000
はせがわ	700	300.00	210,000
高島屋	9,400	875.00	8,225,000
松屋	2,600	713.00	1,853,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,100	716.00	4,367,600
近鉄百貨店	500	3,190.00	1,595,000
丸井グループ	11,800	2,039.00	24,060,200
アクシアル リテイリング	1,100	4,600.00	5,060,000
井筒屋	600	177.00	106,200
イオン	49,500	2,680.50	132,684,750
イズミ	2,600	3,845.00	9,997,000
平和堂	2,600	2,160.00	5,616,000
フジ	1,600	1,818.00	2,908,800
ヤオコー	1,500	7,800.00	11,700,000
ゼビオホールディングス	1,600	796.00	1,273,600
ケーズホールディングス	12,400	1,397.00	17,322,800
Olympicグループ	700	968.00	677,600
日産東京販売ホールディングス	1,900	250.00	475,000
シルバーライフ	200	2,050.00	410,000
一家ダイニングプロジェクト	100	609.00	60,900
Genky DrugStores	600	3,530.00	2,118,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	599.00	179,700
ブックオフグループホールディングス	800	946.00	756,800
アインホールディングス	1,600	6,960.00	11,136,000
元気寿司	300	2,490.00	747,000
ヤマダ電機	39,200	526.00	20,619,200
アークランドサカモト	2,000	2,046.00	4,092,000
ニトリホールディングス	5,600	20,920.00	117,152,000
グルメ杵屋	900	1,089.00	980,100

愛眼	1,000	232.00	232,000	
ケーユーホールディングス	700	778.00	544,600	
吉野家ホールディングス	4,200	2,013.00	8,454,600	
松屋フーズホールディングス	600	3,590.00	2,154,000	
サガミホールディングス	1,700	1,385.00	2,354,500	
関西スーパーマーケット	1,100	1,257.00	1,382,700	
王将フードサービス	900	6,020.00	5,418,000	
プレナス	1,400	1,800.00	2,520,000	
ミニストップ	1,000	1,510.00	1,510,000	
アークス	2,600	2,639.00	6,861,400	
パローホールディングス	2,800	2,809.00	7,865,200	
藤久	100	2,073.00	207,300	
ベルク	600	7,070.00	4,242,000	
大庄	700	1,258.00	880,600	
ファーストリテイリング	1,700	65,910.00	112,047,000	
サンドラッグ	4,800	3,880.00	18,624,000	
サクスパー ホールディングス	1,100	552.00	607,200	
ヤマザワ	300	1,774.00	532,200	
やまや	300	2,255.00	676,500	
ベルーナ	2,800	950.00	2,660,000	
島根銀行	300	710.00	213,000	
じもとホールディングス	8,600	116.00	997,600	
めぶきフィナンシャルグループ	66,900	256.00	17,126,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,700	1,247.00	2,119,900	
九州フィナンシャルグループ	28,200	491.00	13,846,200	
ゆうちょ銀行	36,500	865.00	31,572,500	
富山第一銀行	3,100	306.00	948,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	73,600	399.00	29,366,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,600	755.00	6,493,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,300	471.00	3,438,300	
三十三フィナンシャルグループ	1,200	1,372.00	1,646,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,200	2,241.00	4,930,200	
新生銀行	9,500	1,482.00	14,079,000	
あおぞら銀行	7,700	1,901.00	14,637,700	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	881,400	447.50	394,426,500	
りそなホールディングス	138,300	398.30	55,084,890	

三井住友トラスト・ホールディングス	24,400	3,097.00	75,566,800	
三井住友フィナンシャルグループ	89,100	3,123.00	278,259,300	
千葉銀行	43,000	626.00	26,918,000	
群馬銀行	24,700	369.00	9,114,300	
武蔵野銀行	1,900	1,681.00	3,193,900	
千葉興業銀行	3,500	255.00	892,500	
筑波銀行	5,300	208.00	1,102,400	
七十七銀行	4,400	1,640.00	7,216,000	
青森銀行	1,000	2,575.00	2,575,000	
秋田銀行	800	1,639.00	1,311,200	
山形銀行	1,400	1,307.00	1,829,800	
岩手銀行	800	2,516.00	2,012,800	
東邦銀行	11,500	234.00	2,691,000	
東北銀行	600	1,050.00	630,000	
みちのく銀行	800	1,221.00	976,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,900	1,953.00	21,287,700	
静岡銀行	31,400	770.00	24,178,000	
十六銀行	1,600	2,007.00	3,211,200	
スルガ銀行	13,200	403.00	5,319,600	
八十二銀行	31,100	427.00	13,279,700	
山梨中央銀行	1,500	859.00	1,288,500	
大垣共立銀行	2,500	2,377.00	5,942,500	
福井銀行	1,100	1,734.00	1,907,400	
北國銀行	1,300	3,070.00	3,991,000	
清水銀行	500	1,889.00	944,500	
富山銀行	200	2,929.00	585,800	
滋賀銀行	2,600	2,571.00	6,684,600	
南都銀行	2,100	2,031.00	4,265,100	
百五銀行	11,600	326.00	3,781,600	
京都銀行	4,600	5,260.00	24,196,000	
紀陽銀行	4,600	1,617.00	7,438,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,600	1,107.00	9,520,200	
広島銀行	19,000	615.00	11,685,000	
山陰合同銀行	7,600	578.00	4,392,800	
中国銀行	11,100	1,028.00	11,410,800	
鳥取銀行	400	1,251.00	500,400	



伊予銀行	18,400	707.00	13,008,800	
百十四銀行	1,400	1,821.00	2,549,400	
四国銀行	2,000	768.00	1,536,000	
阿波銀行	2,100	2,530.00	5,313,000	
大分銀行	700	2,434.00	1,703,800	
宮崎銀行	900	2,425.00	2,182,500	
佐賀銀行	800	1,425.00	1,140,000	
沖縄銀行	1,200	3,140.00	3,768,000	
琉球銀行	3,000	906.00	2,718,000	
セブン銀行	43,000	263.00	11,309,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,750,800	141.00	246,862,800	
高知銀行	500	784.00	392,000	
山口フィナンシャルグループ	16,100	716.00	11,527,600	
長野銀行	400	1,300.00	520,000	
名古屋銀行	1,000	2,388.00	2,388,000	
北洋銀行	19,400	236.00	4,578,400	
愛知銀行	500	3,385.00	1,692,500	
中京銀行	500	2,044.00	1,022,000	
大光銀行	400	1,373.00	549,200	
愛媛銀行	1,800	1,185.00	2,133,000	
トマト銀行	500	1,099.00	549,500	
京葉銀行	5,500	497.00	2,733,500	
栃木銀行	6,200	199.00	1,233,800	
北日本銀行	400	1,888.00	755,200	
東和銀行	2,300	736.00	1,692,800	
福島銀行	1,200	257.00	308,400	
大東銀行	700	682.00	477,400	
トモニホールディングス	10,000	344.00	3,440,000	
フィデアホールディングス	12,400	117.00	1,450,800	
池田泉州ホールディングス	14,800	186.00	2,752,800	
F P G	4,000	618.00	2,472,000	
マーキュリアインベストメント	500	630.00	315,000	
S B Iホールディングス	14,400	2,690.00	38,736,000	
日本アジア投資	1,100	261.00	287,100	
ジャフコ	2,000	4,195.00	8,390,000	
大和証券グループ本社	103,400	471.50	48,753,100	

野村ホールディングス	226,700	528.40	119,788,280
岡三証券グループ	11,000	355.00	3,905,000
丸三証券	3,800	429.00	1,630,200
東洋証券	4,600	118.00	542,800
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	14,800	272.00	4,025,600
光世証券	300	619.00	185,700
水戸証券	3,700	212.00	784,400
いちよし証券	2,400	458.00	1,099,200
松井証券	7,400	958.00	7,089,200
マネックスグループ	9,400	268.00	2,519,200
極東証券	1,700	592.00	1,006,400
岩井コスモホールディングス	1,200	1,282.00	1,538,400
藍澤証券	2,300	690.00	1,587,000
マネーパートナーズグループ	1,300	210.00	273,000
スパークス・グループ	5,900	206.00	1,215,400
小林洋行	300	267.00	80,100
かんぽ生命保険	4,600	1,720.00	7,912,000
S O M P Oホールディングス	24,200	3,872.00	93,702,400
アニコム ホールディングス	1,100	4,200.00	4,620,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	33,700	3,000.00	101,100,000
第一生命ホールディングス	72,900	1,587.50	115,728,750
東京海上ホールディングス	45,600	5,019.00	228,866,400
T & Dホールディングス	38,500	1,143.00	44,005,500
アドバンスクリエイト	300	2,298.00	689,400
全国保証	3,600	4,190.00	15,084,000
ジェイリース	400	553.00	221,200
イントラスト	500	874.00	437,000
日本モーゲージサービス	600	1,094.00	656,400
C a s a	400	1,258.00	503,200
アルヒ	2,000	1,679.00	3,358,000
プレミアグループ	700	2,047.00	1,432,900
クレディセゾン	9,000	1,221.00	10,989,000
芙蓉総合リース	1,400	7,070.00	9,898,000
みずほリース	2,000	2,694.00	5,388,000
東京センチュリー	2,600	5,760.00	14,976,000

日本証券金融	5,700	534.00	3,043,800
アイフル	19,600	277.00	5,429,200
リコーリース	1,000	2,824.00	2,824,000
イオンフィナンシャルサービス	7,900	990.00	7,821,000
アコム	25,900	436.00	11,292,400
ジャックス	1,400	1,782.00	2,494,800
オリエントコーポレーション	34,700	118.00	4,094,600
日立キャピタル	3,000	2,614.00	7,842,000
アプラスフィナンシャル	6,000	77.00	462,000
オリックス	79,900	1,410.00	112,659,000
三菱UFJリース	32,700	544.00	17,788,800
九州リースサービス	600	620.00	372,000
日本取引所グループ	37,000	2,904.00	107,448,000
イー・ギャランティ	1,400	2,247.00	3,145,800
アサックス	700	745.00	521,500
NECキャピタルソリューション	500	1,874.00	937,000
いちご	16,400	307.00	5,034,800
日本駐車場開発	12,600	134.00	1,688,400
スター・マイカ・ホールディングス	700	1,315.00	920,500
ADワークスグループ	2,300	157.00	361,100
ヒューリック	27,300	992.00	27,081,600
三栄建築設計	500	1,431.00	715,500
野村不動産ホールディングス	7,800	2,122.00	16,551,600
三重交通グループホールディングス	2,600	474.00	1,232,400
サムティ	1,800	1,484.00	2,671,200
ディア・ライフ	1,800	582.00	1,047,600
コーセーアールイー	400	576.00	230,400
日本商業開発	800	1,710.00	1,368,000
プレサンスコーポレーション	2,100	1,420.00	2,982,000
THEグローバル社	600	193.00	115,800
ハウスコム	200	1,318.00	263,600
日本管理センター	700	1,268.00	887,600
サンセイランディック	400	741.00	296,400
エストラスト	200	674.00	134,800
フージャースホールディングス	2,600	650.00	1,690,000
オープンハウス	4,100	3,760.00	15,416,000

東急不動産ホールディングス	35,000	487.00	17,045,000	
飯田グループホールディングス	10,700	2,205.00	23,593,500	
イーランド	200	805.00	161,000	
ムゲンエステート	800	489.00	391,200	
ビーロッド	600	710.00	426,000	
ファーストブラザーズ	200	900.00	180,000	
ハウスドゥ	600	1,127.00	676,200	
シーアールイー	300	1,492.00	447,600	
プロパティエージェント	200	1,309.00	261,800	
ケイアイスター不動産	400	2,458.00	983,200	
アグレ都市デザイン	200	590.00	118,000	
グッドコムアセット	300	2,217.00	665,100	
ジェイ・エス・ビー	200	3,020.00	604,000	
テンポイノベーション	300	779.00	233,700	
グローバル・リンク・マネジメント	200	640.00	128,000	
パーク24	6,900	1,885.00	13,006,500	
パラカ	300	1,750.00	525,000	
三井不動産	63,500	2,005.50	127,349,250	
三菱地所	90,300	1,621.00	146,376,300	
平和不動産	2,400	2,825.00	6,780,000	
東京建物	12,700	1,349.00	17,132,300	
ダイビル	3,300	1,193.00	3,936,900	
京阪神ビルディング	2,100	1,618.00	3,397,800	
住友不動産	29,000	3,114.00	90,306,000	
テーオーシー	2,500	691.00	1,727,500	
東京楽天地	200	4,365.00	873,000	
レオパレス21	16,900	170.00	2,873,000	
スターツコーポレーション	1,800	2,407.00	4,332,600	
フジ住宅	1,500	537.00	805,500	
空港施設	1,300	445.00	578,500	
明和地所	700	531.00	371,700	
ゴールドクレスト	1,000	1,442.00	1,442,000	
エスリード	500	1,314.00	657,000	
日神グループホールディングス	1,900	401.00	761,900	
日本エスコン	2,300	829.00	1,906,700	
タカラレーベン	5,900	341.00	2,011,900	

AVANTIA	700	780.00	546,000	
イオンモール	6,500	1,478.00	9,607,000	
毎日コムネット	300	777.00	233,100	
ファースト住建	500	1,012.00	506,000	
ランド	68,600	10.00	686,000	
カチタス	3,200	2,850.00	9,120,000	
トーセイ	1,800	997.00	1,794,600	
穴吹興産	300	1,527.00	458,100	
サンフロンティア不動産	1,800	883.00	1,589,400	
エフ・ジェー・ネクスト	1,100	869.00	955,900	
インテリックス	400	491.00	196,400	
ランドビジネス	400	390.00	156,000	
サンネクスタグループ	400	913.00	365,200	
グランディハウス	1,000	360.00	360,000	
日本空港ビルデング	4,100	4,790.00	19,639,000	
日本工営	800	2,911.00	2,328,800	
LIFULL	4,400	472.00	2,076,800	
ミクシィ	2,400	2,669.00	6,405,600	
ジェイエイシーリクルートメント	800	1,358.00	1,086,400	
日本M&Aセンター	9,500	5,230.00	49,685,000	
メンバーズ	400	1,749.00	699,600	
中広	200	538.00	107,600	
UTグループ	2,000	3,705.00	7,410,000	
アイティメディア	500	2,339.00	1,169,500	
タケエイ	1,400	990.00	1,386,000	
E・Jホールディングス	200	2,358.00	471,600	
ビーネックスグループ	1,600	1,155.00	1,848,000	
コシダカホールディングス	3,000	451.00	1,353,000	
アルトナー	300	880.00	264,000	
パソナグループ	1,400	1,585.00	2,219,000	
CDS	300	1,351.00	405,300	
リンクアンドモチベーション	2,300	412.00	947,600	
GCA	1,600	660.00	1,056,000	
エス・エム・エス	3,900	2,911.00	11,352,900	
サニーサイドアップグループ	400	781.00	312,400	
パーソルホールディングス	12,500	1,810.00	22,625,000	

リニカル	600	801.00	480,600	
クックパッド	3,900	376.00	1,466,400	
エスクリ	400	371.00	148,400	
アイ・ケイ・ケイ	600	606.00	363,600	
学情	400	1,161.00	464,400	
スタジオアリス	600	1,689.00	1,013,400	
シミックホールディングス	600	1,356.00	813,600	
エプロ	300	1,007.00	302,100	
N J S	300	1,840.00	552,000	
総合警備保障	5,000	5,110.00	25,550,000	
カカクコム	9,200	2,601.00	23,929,200	
アイロムグループ	400	2,055.00	822,000	
セントケア・ホールディング	800	775.00	620,000	
サイネックス	200	884.00	176,800	
ルネサンス	700	1,009.00	706,300	
ディップ	1,700	2,257.00	3,836,900	
デジタルホールディングス	900	1,342.00	1,207,800	
新日本科学	1,400	705.00	987,000	
ツクイ	2,900	619.00	1,795,100	
キャリアデザインセンター	300	1,072.00	321,600	
ベネフィット・ワン	4,500	2,538.00	11,421,000	
エムスリー	27,500	6,110.00	168,025,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,000	294.00	294,000	
プラス	200	466.00	93,200	
アウトソーシング	7,100	968.00	6,872,800	
ウェルネット	1,300	620.00	806,000	
ワールドホールディングス	400	1,909.00	763,600	
ディー・エヌ・エー	5,300	1,838.00	9,741,400	
博報堂DYホールディングス	17,400	1,469.00	25,560,600	
ぐるなび	2,200	748.00	1,645,600	
タカミヤ	1,300	548.00	712,400	
ジャパンベストレスキューシステム	1,000	1,003.00	1,003,000	
ファンコミュニケーションズ	3,400	484.00	1,645,600	
ライク	400	1,781.00	712,400	
ビジネス・ブレークスルー	500	397.00	198,500	
エスプール	3,200	758.00	2,425,600	

W D Bホールディングス	600	2,953.00	1,771,800	
手間いらず	100	5,520.00	552,000	
ティア	700	449.00	314,300	
C D G	100	1,769.00	176,900	
バリューコマース	800	3,400.00	2,720,000	
インフォーマート	12,600	890.00	11,214,000	
J Pホールディングス	3,900	317.00	1,236,300	
エコナックホールディングス	2,200	97.00	213,400	
E P Sホールディングス	1,700	1,067.00	1,813,900	
レッグス	300	1,079.00	323,700	
プレステージ・インターナショナル	4,700	956.00	4,493,200	
アミューズ	700	2,507.00	1,754,900	
ドリームインキュベータ	400	1,474.00	589,600	
クイック	800	1,273.00	1,018,400	
T A C	700	237.00	165,900	
ケネディクス	10,700	573.00	6,131,100	
電通グループ	14,000	3,235.00	45,290,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	500	630.00	315,000	
ぴあ	400	3,330.00	1,332,000	
イオンファンタジー	500	1,806.00	903,000	
シーティーエス	1,400	924.00	1,293,600	
ネクシィーズグループ	400	1,100.00	440,000	
H . U . グループホールディングス	3,500	2,730.00	9,555,000	
アルプス技研	1,100	1,918.00	2,109,800	
サニックス	2,200	265.00	583,000	
ダイオーズ	200	1,034.00	206,800	
日本空調サービス	1,300	747.00	971,100	
オリエンタルランド	13,300	14,665.00	195,044,500	
ダスキン	3,100	2,854.00	8,847,400	
明光ネットワークジャパン	1,600	755.00	1,208,000	
ファルコホールディングス	700	1,514.00	1,059,800	
秀英予備校	300	456.00	136,800	
田谷	200	577.00	115,400	
ラウンドワン	3,500	852.00	2,982,000	
リゾートトラスト	5,700	1,607.00	9,159,900	
ビー・エム・エル	1,600	2,963.00	4,740,800	

ワタベウェディング	200	266.00	53,200	
りらいあコミュニケーションズ	2,300	1,273.00	2,927,900	
リソー教育	5,700	291.00	1,658,700	
早稲田アカデミー	500	1,008.00	504,000	
ユー・エス・エス	14,000	1,894.00	26,516,000	
東京個別指導学院	400	573.00	229,200	
サイバーエージェント	7,700	5,600.00	43,120,000	
楽天	58,200	1,175.00	68,385,000	
クリーク・アンド・リバー社	700	1,300.00	910,000	
テー・オー・ダブリュー	2,000	337.00	674,000	
山田コンサルティンググループ	800	1,144.00	915,200	
セントラルスポーツ	500	2,513.00	1,256,500	
フルキャストホールディングス	1,100	1,672.00	1,839,200	
エン・ジャパン	2,200	3,075.00	6,765,000	
リソルホールディングス	100	3,580.00	358,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,500	6,320.00	15,800,000	
アトラ	300	288.00	86,400	
インターワークス	200	343.00	68,600	
アイ・アールジャパンホールディングス	500	11,570.00	5,785,000	
K e e P e r 技研	500	2,801.00	1,400,500	
ファーストロジック	200	788.00	157,600	
三機サービス	200	1,125.00	225,000	
G u n o s y	800	930.00	744,000	
デザインワン・ジャパン	400	299.00	119,600	
イー・ガーディアン	500	3,080.00	1,540,000	
リブセンス	700	289.00	202,300	
ジャパンマテリアル	3,800	1,438.00	5,464,400	
ベクトル	1,600	1,039.00	1,662,400	
ウチヤマホールディングス	600	308.00	184,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,100	1,104.00	1,214,400	
キャリアリンク	400	940.00	376,000	
I B J	1,000	1,099.00	1,099,000	
アサンテ	500	1,613.00	806,500	
N・フィールド	900	679.00	611,100	
バリューHR	500	1,552.00	776,000	
M & A キャピタルパートナーズ	1,000	3,980.00	3,980,000	



ライドオンエクスプレスホールディングス	500	2,333.00	1,166,500	
E R Iホールディングス	300	641.00	192,300	
アピスト	200	3,275.00	655,000	
シグマクシス	900	1,599.00	1,439,100	
ウィルグループ	800	927.00	741,600	
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,800	376.00	676,800	
リクルートホールディングス	89,400	4,328.00	386,923,200	
エラン	900	2,504.00	2,253,600	
土木管理総合試験所	600	370.00	222,000	
ネットマーケティング	500	647.00	323,500	
日本郵政	102,300	766.60	78,423,180	
ベルシステム24ホールディングス	2,100	1,712.00	3,595,200	
鎌倉新書	900	894.00	804,600	
S M N	300	908.00	272,400	
一蔵	100	380.00	38,000	
L I T A L I C O	400	2,792.00	1,116,800	
グローバルキッズCOMPANY	200	797.00	159,400	
エアトリ	700	1,391.00	973,700	
ハイアス・アンド・カンパニー	800	294.00	235,200	
アトラエ	400	2,987.00	1,194,800	
ストライク	500	4,805.00	2,402,500	
ソラスト	3,400	1,360.00	4,624,000	
セラク	400	1,869.00	747,600	
インソース	500	2,729.00	1,364,500	
ベйкаレント・コンサルティング	800	11,350.00	9,080,000	
Orchestra Holdings	300	2,300.00	690,000	
アイモバイル	400	1,125.00	450,000	
キャリアインデックス	500	510.00	255,000	
MS - J a p a n	400	837.00	334,800	
船場	200	919.00	183,800	
グレイステクノロジー	600	4,700.00	2,820,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,400	3,605.00	5,047,000	
フルテック	200	1,352.00	270,400	
グリーンズ	300	552.00	165,600	
ツナググループ・ホールディングス	200	459.00	91,800	

GameWith	400	661.00	264,400
ソウルドアウト	300	1,598.00	479,400
MS&Consulting	200	744.00	148,800
エル・ティー・エス	100	4,500.00	450,000
ミダック	200	2,097.00	419,400
日総工産	800	853.00	682,400
キュービーネットホールディングス	500	1,850.00	925,000
RPAホールディングス	900	867.00	780,300
スプリックス	400	903.00	361,200
マネジメントソリューションズ	600	1,385.00	831,000
プロレド・パートナーズ	200	4,755.00	951,000
and factory	100	985.00	98,500
ピアラ	100	2,196.00	219,600
ギークス	100	1,286.00	128,600
カーブスホールディングス	3,400	701.00	2,383,400
フォーラムエンジニアリング	600	827.00	496,200
アドバンテッジリスクマネジメント	600	789.00	473,400
リログループ	6,800	2,425.00	16,490,000
東祥	800	1,366.00	1,092,800
エイチ・アイ・エス	1,900	1,963.00	3,729,700
ラックランド	400	2,310.00	924,000
共立メンテナンス	2,100	4,225.00	8,872,500
イチネンホールディングス	1,400	1,280.00	1,792,000
建設技術研究所	800	1,999.00	1,599,200
スペース	800	803.00	642,400
長大	500	1,295.00	647,500
燦ホールディングス	500	1,143.00	571,500
スバル興業	100	7,700.00	770,000
東京テアトル	500	1,329.00	664,500
タナベ経営	200	1,500.00	300,000
ナガワ	400	7,300.00	2,920,000
よみうりランド	300	4,185.00	1,255,500
東京都競馬	800	5,210.00	4,168,000
常磐興産	500	1,513.00	756,500
カナモト	2,200	2,453.00	5,396,600
東京ドーム	5,100	764.00	3,896,400

西尾レントオール	1,200	2,386.00	2,863,200	
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	2,721.00	3,265,200	
乃村工藝社	5,300	797.00	4,224,100	
藤田観光	500	1,662.00	831,000	
KNT-CTホールディングス	800	1,045.00	836,000	
日本管財	1,300	2,017.00	2,622,100	
トーカイ	1,200	2,112.00	2,534,400	
白洋舎	100	2,454.00	245,400	
セコム	13,200	9,866.00	130,231,200	
セントラル警備保障	600	3,555.00	2,133,000	
丹青社	2,400	719.00	1,725,600	
メイテック	1,500	5,490.00	8,235,000	
応用地質	1,500	1,252.00	1,878,000	
船井総研ホールディングス	2,600	2,346.00	6,099,600	
進学会ホールディングス	500	465.00	232,500	
オオバ	900	808.00	727,200	
いであ	300	2,004.00	601,200	
学究社	400	1,141.00	456,400	
ベネッセホールディングス	4,200	2,639.00	11,083,800	
イオンディライト	1,500	2,978.00	4,467,000	
ナック	700	976.00	683,200	
ニチイ学館	1,200	1,663.00	1,995,600	
ダイセキ	2,100	2,614.00	5,489,400	
ステップ	500	1,589.00	794,500	
合 計	15,449,100		30,031,356,835	

## (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 9月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	9,437,551,838
コール・ローン	121,762,533
株式	55,941,262,222
投資証券	1,359,372,115
派生商品評価勘定	125,019,162
未収入金	428,266
未収配当金	76,610,625
差入委託証拠金	1,934,441,660
流動資産合計	68,996,448,421
資産合計	
68,996,448,421	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	385,572
未払金	5,030,515
未払解約金	148,000
未払利息	330
流動負債合計	5,564,417
負債合計	
5,564,417	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	49,503,216,612
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,487,667,392
元本等合計	68,990,884,004
純資産合計	68,990,884,004
負債純資産合計	68,996,448,421

## 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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	32,884,970,029円
期中追加設定元本額	52,559,855,877円
期中一部解約元本額	35,941,609,294円
期末元本額	49,503,216,612円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,842,491,190円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,772,791,429円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,293,033,226円
DCりそな グローバルバランス	35,506,771円
つみたてバランスファンド	1,227,751,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	684,654,904円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	352,045,428円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	213,694,174円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	16,842,669円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,051,318円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,313,285円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	10,686,115円

リスクコントロール・オープン	35,911,290円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	145,963,123円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	182,810,003円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	21,183,943,154円
Smart-i 先進国株式インデックス	3,342,381,881円
Smart-i 8資産バランス 安定型	129,454,691円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	265,641,778円
Smart-i 8資産バランス 成長型	286,992,541円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,020,037,757円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,794,914,387円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,020,794,874円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	688,523,343円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,806,260,481円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	299,156,691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)	396,345,963円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,387,097,249円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	45,440,190円
2. 計算日における受益権の総数	49,503,216,612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	1.3937円
(10,000口当たり純資産額)	(13,937円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 9月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		561,052,888
投資証券		107,521,793
合計		453,531,095

（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 9月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,516,821,897	-	11,641,841,059	125,019,162
合計		11,516,821,897	-	11,641,841,059	125,019,162

(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ではありません。

(通貨関連)

(2020年 9月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	97,657,172	-	97,271,600	385,572
	米ドル	97,657,172	-	97,271,600	385,572
合計		97,657,172	-	97,271,600	385,572

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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



上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	14.63	105,116.55	
	CABOT OIL & GAS CORP	5,423	18.61	100,922.03	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	49.56	124,593.84	
	CHEVRON CORP	24,268	77.29	1,875,673.72	
	CONCHO RESOURCES INC	2,677	47.00	125,819.00	
	CONOCOPHILLIPS	14,168	33.52	474,911.36	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	31.06	51,466.42	
	EOG RESOURCES INC	7,783	39.17	304,860.11	
	EXXON MOBIL CORP	54,942	36.66	2,014,173.72	
	HALLIBURTON CO	11,937	14.33	171,057.21	
	HESS CORP	3,020	43.84	132,396.80	
	KINDER MORGAN INC	27,151	13.06	354,592.06	
	MARATHON PETROLEUM CORP	8,739	32.02	279,822.78	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	11.30	34,498.90	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,822	10.17	99,889.74	
	ONEOK INC	4,830	27.30	131,859.00	
	PHILLIPS 66	5,838	58.37	340,764.06	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,821	93.35	169,990.35	
	SCHLUMBERGER LTD	18,563	18.03	334,690.89	
	VALERO ENERGY CORP	5,488	47.51	260,734.88	
	WILLIAMS COS INC	16,239	20.85	338,583.15	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,908	303.97	883,944.76	
	ALBEMARLE CORP	1,183	98.17	116,135.11	
	AMCOR PLC	17,805	11.15	198,525.75	
	AVERY DENNISON CORP	928	121.81	113,039.68	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	24.19	40,784.34		
BALL CORP	4,409	83.28	367,181.52		

CELANESE CORP	1,332	109.41	145,734.12
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	33.69	99,621.33
CORTEVA INC	10,203	28.97	295,580.91
CROWN HOLDINGS INC	1,510	75.74	114,367.40
DOW INC	9,910	50.09	496,391.90
DUPONT DE NEMOURS INC	9,759	59.43	579,977.37
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	81.00	152,199.00
ECOLAB INC	3,374	204.89	691,298.86
FMC CORP	1,444	110.53	159,605.32
FREEPORT-MCMORAN INC	19,809	16.36	324,075.24
INTERNATIONAL PAPER CO	4,150	40.79	169,278.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,182	122.98	145,362.36
LINDE PLC	6,850	251.25	1,721,062.50
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,676	76.49	281,177.24
MARTIN MARIETTA MATERIALS	693	216.48	150,020.64
MOSAIC CO/THE	3,288	18.13	59,611.44
NEWMONT CORP	10,613	67.38	715,103.94
NUCOR CORP	3,362	46.73	157,106.26
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	105.93	138,980.16
PPG INDUSTRIES INC	3,178	130.21	413,807.38
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	84.50	122,187.00
SEALED AIR CORP	1,397	39.27	54,860.19
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,079	717.60	774,290.40
STEEL DYNAMICS INC	2,352	30.09	70,771.68
VULCAN MATERIALS CO	1,832	130.34	238,782.88
WESTROCK CO	2,274	34.34	78,089.16
3M CO	7,509	168.46	1,264,966.14
AERCAP HOLDINGS NV	853	28.84	24,600.52
ALLEGION PLC	1,026	99.14	101,717.64
AMETEK INC	3,087	101.39	312,990.93
BOEING CO/THE	6,999	165.35	1,157,284.65
CARRIER GLOBAL CORP	11,040	29.15	321,816.00
CATERPILLAR INC	7,081	153.51	1,087,004.31
CUMMINS INC	1,966	210.58	414,000.28
DEERE & CO	3,900	218.33	851,487.00

DOVER CORP	1,600	113.69	181,904.00
EATON CORP PLC	5,290	103.18	545,822.20
EMERSON ELECTRIC CO	7,898	68.19	538,564.62
FASTENAL CO	7,657	44.33	339,434.81
FORTIVE CORP	4,092	77.63	317,661.96
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	83.77	157,655.14
GENERAL DYNAMICS CORP	3,232	147.47	476,623.04
GENERAL ELECTRIC CO	114,945	6.15	706,911.75
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	40.45	61,645.80
HEICO CORP	242	110.02	26,624.84
HEICO CORP-CLASS A	819	90.84	74,397.96
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,145	168.47	1,540,658.15
HOWMET AEROSPACE INC	3,134	18.39	57,634.26
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	146.85	42,439.65
IDEX CORP	845	184.10	155,564.50
ILLINOIS TOOL WORKS	4,145	198.22	821,621.90
INGERSOLL-RAND INC	3,920	36.32	142,374.40
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	94.03	166,903.25
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	39.02	109,256.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	19.40	44,620.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,914	42.51	421,444.14
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,858	181.63	519,098.54
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	276.48	129,945.60
LOCKHEED MARTIN CORP	3,293	393.75	1,296,618.75
MASCO CORP	3,079	59.40	182,892.60
NORDSON CORP	746	195.10	145,544.60
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,082	338.45	704,652.90
OTIS WORLDWIDE CORP	5,512	59.99	330,664.88
OWENS CORNING	860	66.40	57,104.00
PACCAR INC	4,610	86.35	398,096.55
PARKER HANNIFIN CORP	1,716	211.44	362,831.04
PENTAIR PLC	1,289	44.80	57,747.20
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	19,760	61.97	1,224,527.20
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,550	224.66	348,223.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,378	396.26	546,046.28

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	42.90	72,157.80
SMITH (A.O.) CORP	1,507	49.86	75,139.02
SNAP-ON INC	437	152.83	66,786.71
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,069	162.35	335,902.15
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	406	321.74	130,626.44
TEXTRON INC	3,103	39.33	122,040.99
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,195	118.99	380,173.05
TRANSDIGM GROUP INC	689	507.30	349,529.70
UNITED RENTALS INC	983	176.58	173,578.14
WABTEC CORP	2,019	68.00	137,292.00
WW GRAINGER INC	506	354.34	179,296.04
XYLEM INC	1,998	84.21	168,251.58
CINTAS CORP	1,181	327.81	387,143.61
COPART INC	2,853	103.85	296,298.31
COSTAR GROUP INC	524	814.71	426,908.04
EQUIFAX INC	1,644	163.32	268,498.08
IHS MARKIT LTD	5,054	77.95	393,959.30
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	15.36	41,978.88
REPUBLIC SERVICES INC	3,015	96.76	291,731.40
ROBERT HALF INTL INC	1,565	53.50	83,727.50
ROLLINS INC	2,014	54.29	109,340.06
TRANSUNION	2,592	86.80	224,985.60
VERISK ANALYTICS INC	2,060	185.08	381,264.80
WASTE CONNECTIONS INC	3,522	101.35	356,954.70
WASTE MANAGEMENT INC	5,564	116.36	647,427.04
AMERCO	106	373.74	39,616.44
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	100.71	149,655.06
CSX CORP	10,096	78.96	797,180.16
DELTA AIR LINES INC	1,316	32.82	43,191.12
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,870	91.21	170,562.70
FEDEX CORP	3,279	236.34	774,958.86
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	132.02	153,935.32
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	187.22	245,819.86
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	43.37	45,278.28
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,384	220.29	745,461.36

OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,297	193.15	250,515.55
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	40.06	36,374.48
UBER TECHNOLOGIES INC	12,797	37.95	485,646.15
UNION PACIFIC CORP	8,850	198.84	1,759,734.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,197	160.14	1,472,807.58
XPO LOGISTICS INC	977	87.23	85,223.71
APTIV PLC	3,602	85.89	309,375.78
AUTOLIV INC	743	79.00	58,697.00
BORGWARNER INC	2,199	42.82	94,161.18
FORD MOTOR CO	52,187	7.12	371,571.44
GENERAL MOTORS CO	17,042	31.18	531,369.56
LEAR CORP	775	121.78	94,379.50
TESLA INC	9,615	419.62	4,034,646.30
DR HORTON INC	4,656	72.72	338,584.32
GARMIN LTD	1,968	99.70	196,209.60
HASBRO INC	1,788	77.18	137,997.84
LENNAR CORP-A	3,733	79.00	294,907.00
LULULEMON ATHLETICA INC	1,638	313.82	514,037.16
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	100.46	56,659.44
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	17.83	98,671.22
NIKE INC -CL B	16,152	119.28	1,926,610.56
NVR INC	40	4,142.22	165,688.80
PELOTON INTERACTIVE INC-A	2,689	82.01	220,524.89
PULTEGROUP INC	3,683	45.67	168,202.61
RALPH LAUREN CORP	478	80.59	38,522.02
VF CORP	4,481	73.21	328,054.01
WHIRLPOOL CORP	714	177.80	126,949.20
ARAMARK	2,216	28.69	63,577.04
CARNIVAL CORP	6,635	17.85	118,434.75
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	355	1,267.19	449,852.45
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	91.61	164,531.56
DOMINO'S PIZZA INC	438	388.52	170,171.76
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,758	92.31	346,900.98
LAS VEGAS SANDS CORP	3,893	53.10	206,718.30
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,715	104.68	388,886.20

MCDONALD'S CORP	9,683	220.56	2,135,682.48
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	19.40	69,840.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	23.06	105,799.28
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,461	70.94	174,583.34
STARBUCKS CORP	15,283	86.63	1,323,966.29
VAIL RESORTS INC	557	219.14	122,060.98
WYNN RESORTS LTD	1,017	83.80	85,224.60
YUM! BRANDS INC	4,053	92.87	376,402.11
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,224	79.12	808,922.88
ALPHABET INC-CL A	3,892	1,508.83	5,872,366.36
ALPHABET INC-CL C	3,924	1,519.28	5,961,654.72
ALTICE USA INC- A	2,974	26.45	78,662.30
CABLE ONE INC	68	1,799.66	122,376.88
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,904	609.70	1,160,868.80
COMCAST CORP-CLASS A	59,369	45.27	2,687,634.63
DISCOVERY INC - A	1,722	23.77	40,931.94
DISCOVERY INC-C	3,336	21.59	72,024.24
DISH NETWORK CORP-A	2,183	32.66	71,296.78
ELECTRONIC ARTS INC	3,889	126.18	490,714.02
FACEBOOK INC-A	31,154	266.15	8,291,637.10
FOX CORP - CLASS A	3,877	28.66	111,114.82
FOX CORP- CLASS B	1,836	28.70	52,693.20
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	121.29	136,572.54
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	18.16	66,992.24
LIBERTY BROADBAND-A	223	138.11	30,798.53
LIBERTY BROADBAND-C	1,523	139.26	212,092.98
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	37.26	80,220.78
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	35.55	62,461.35
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	35.56	33,639.76
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	58.66	91,744.24
MATCH GROUP INC	3,380	108.26	365,918.80
NETFLIX INC	5,727	476.26	2,727,541.02
NEWS CORP - CLASS A	2,810	15.31	43,021.10
OMNICOM GROUP	2,439	53.83	131,291.37
PINTEREST INC- CLASS A	5,740	36.32	208,476.80

ROKU INC	1,447	157.73	228,235.31
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.64	58,582.68
SNAP INC - A	12,546	24.13	302,734.98
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,602	156.48	250,680.96
TWITTER INC	10,694	38.77	414,606.38
VIACOMCBS INC - CLASS B	8,010	29.73	238,137.30
WALT DISNEY CO/THE	23,512	131.25	3,085,950.00
ZILLOW GROUP INC - C	1,987	87.18	173,226.66
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	157.31	147,399.47
AMAZON.COM INC	5,483	3,102.97	17,013,584.51
AUTOZONE INC	311	1,241.66	386,156.26
BEST BUY CO INC	3,104	107.70	334,300.80
BOOKING HOLDINGS INC	535	1,784.59	954,755.65
BURLINGTON STORES INC	893	206.45	184,359.85
CARMAX INC	1,819	104.80	190,631.20
DOLLAR GENERAL CORP	3,308	202.11	668,579.88
DOLLAR TREE INC	3,180	88.92	282,765.60
EBAY INC	8,607	52.30	450,146.10
EXPEDIA GROUP INC	1,497	95.92	143,592.24
GENUINE PARTS CO	1,957	103.02	201,610.14
HOME DEPOT INC	13,939	280.65	3,911,980.35
LKQ CORP	2,845	32.34	92,007.30
LOWE'S COS INC	9,824	165.19	1,622,826.56
MERCADOLIBRE INC	587	1,036.77	608,583.99
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	983	478.12	469,991.96
ROSS STORES INC	4,714	93.77	442,031.78
TARGET CORP	6,536	148.44	970,203.84
TIFFANY & CO	1,214	113.19	137,412.66
TJX COMPANIES INC	15,687	55.47	870,157.89
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,305	138.14	180,272.70
ULTA BEAUTY INC	726	234.14	169,985.64
WAYFAIR INC- CLASS A	864	266.70	230,428.80
COSTCO WHOLESALE CORP	5,743	342.92	1,969,389.56
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	3.81	381.00
KROGER CO	10,508	32.84	345,082.72

SYSCO CORP	6,442	64.57	415,959.94
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,956	35.11	349,555.16
WALMART INC	18,404	137.32	2,527,237.28
ALTRIA GROUP INC	24,223	43.00	1,041,589.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,379	47.50	350,502.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,118	79.49	327,339.82
BUNGE LTD	1,423	46.25	65,813.75
CAMPBELL SOUP CO	1,995	45.82	91,410.90
COCA-COLA CO/THE	52,919	50.71	2,683,522.49
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,797	44.33	123,991.01
CONAGRA BRANDS INC	6,526	34.59	225,734.34
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,218	195.31	433,197.58
GENERAL MILLS INC	7,972	58.76	468,434.72
HERSHEY CO/THE	1,965	144.50	283,942.50
HORMEL FOODS CORP	3,241	50.25	162,860.25
INGREDION INC	744	80.16	59,639.04
JM SMUCKER CO/THE	1,257	113.46	142,619.22
KELLOGG CO	3,449	65.42	225,633.58
KEURIG DR PEPPER INC	4,730	28.81	136,271.30
KRAFT HEINZ CO/THE	8,943	31.87	285,013.41
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	65.61	85,293.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,642	200.10	328,564.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	35.01	51,219.63
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	18,603	58.01	1,079,160.03
MONSTER BEVERAGE CORP	5,211	82.89	431,939.79
PEPSICO INC	17,997	136.67	2,459,649.99
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	20,237	81.94	1,658,219.78
TYSON FOODS INC-CL A	3,944	65.31	257,582.64
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	92.72	298,836.56
CLOROX COMPANY	1,647	217.46	358,156.62
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,572	77.15	815,629.80
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,925	217.41	635,924.25
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	148.50	657,706.50
PROCTER & GAMBLE CO/THE	32,028	138.63	4,440,041.64
ABBOTT LABORATORIES	22,970	105.69	2,427,699.30



ABIOMED INC	494	275.70	136,195.80
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,007	323.46	325,724.22
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,693	94.60	160,157.80
ANTHEM INC	3,302	265.60	877,011.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,716	83.19	558,704.04
BECTON DICKINSON AND CO	3,794	235.90	895,004.60
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,762	41.12	771,493.44
CARDINAL HEALTH INC	3,200	47.05	150,560.00
CENTENE CORP	7,685	58.22	447,420.70
CERNER CORP	4,098	71.94	294,810.12
CIGNA CORP	4,837	171.85	831,238.45
COOPER COS INC/THE	727	334.55	243,217.85
CVS HEALTH CORP	17,084	57.97	990,359.48
DANAHER CORP	8,300	207.93	1,725,819.00
DAVITA INC	653	87.79	57,326.87
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	45.90	94,003.20
DEXCOM INC	1,222	393.61	480,991.42
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,153	82.95	676,291.35
HCA HEALTHCARE INC	3,581	135.72	486,013.32
HENRY SCHEIN INC	1,305	63.73	83,167.65
HOLOGIC INC	2,888	60.65	175,157.20
HUMANA INC	1,738	403.63	701,508.94
IDEXX LABORATORIES INC	1,129	365.56	412,717.24
INSULET CORP	689	218.11	150,277.79
INTUITIVE SURGICAL INC	1,524	716.34	1,091,702.16
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,325	183.13	242,647.25
MASIMO CORP	701	220.99	154,913.99
MCKESSON CORP	2,170	150.90	327,453.00
MEDTRONIC PLC	17,446	106.97	1,866,198.62
MOLINA HEALTHCARE INC	807	179.28	144,678.96
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,464	112.72	165,022.08
RESMED INC	1,937	174.43	337,870.91
STERIS PLC	1,157	167.17	193,415.69
STRYKER CORP	4,428	205.51	909,998.28
TELADOC HEALTH INC	964	193.36	186,399.04

TELEFLEX INC	632	371.88	235,028.16
UNITEDHEALTH GROUP INC	12,296	308.57	3,794,176.72
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	116.88	123,659.04
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	994	173.15	172,111.10
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,787	267.63	478,254.81
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	995	277.87	276,480.65
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,759	140.59	387,887.81
ABBVIE INC	22,952	90.49	2,076,926.48
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,121	99.42	409,709.82
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,965	108.72	322,354.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,233	131.00	161,523.00
AMGEN INC	7,649	246.75	1,887,390.75
AVANTOR INC	6,265	21.94	137,454.10
BEIGENE LTD-ADR	500	250.17	125,085.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	508.84	125,174.64
BIOGEN INC	2,151	278.29	598,601.79
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,957	75.34	147,440.38
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	29,433	59.70	1,757,150.10
CATALENT INC	2,108	83.91	176,882.28
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	27.64	150,029.92
ELI LILLY & CO	11,211	149.00	1,670,439.00
EXACT SCIENCES CORP	1,627	77.60	126,255.20
GILEAD SCIENCES INC	16,392	66.34	1,087,445.28
ILLUMINA INC	1,933	353.65	683,605.45
INCYTE CORP	2,513	93.15	234,085.95
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,802	53.74	96,839.48
IQVIA HOLDINGS INC	2,542	161.65	410,914.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	140.41	105,728.73
JOHNSON & JOHNSON	34,128	148.35	5,062,888.80
MERCK & CO. INC.	32,760	84.16	2,757,081.60
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	321	978.99	314,255.79
MODERNA INC	3,691	63.67	235,005.97
MYLAN NV	4,542	15.77	71,627.34
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	106.03	102,212.92
PERKINELMER INC	1,224	117.73	144,101.52

PERRIGO CO PLC	1,855	50.14	93,009.70
PFIZER INC	72,105	37.01	2,668,606.05
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,323	564.20	746,436.60
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	138.50	112,600.50
SEATTLE GENETICS INC	1,643	171.79	282,250.97
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	9.09	116,524.71
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,133	434.10	2,228,235.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,394	264.80	898,731.20
WATERS CORP	843	205.28	173,051.04
ZOETIS INC	6,212	160.86	999,262.32
BANK OF AMERICA CORP	101,165	25.75	2,604,998.75
CITIGROUP INC	27,032	48.15	1,301,590.80
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	27.99	158,843.25
COMERICA INC	1,325	41.00	54,325.00
EAST WEST BANCORP INC	1,540	35.21	54,223.40
FIFTH THIRD BANCORP	7,761	22.25	172,721.05
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,273	107.90	245,256.70
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	10.12	90,999.04
JPMORGAN CHASE & CO	39,445	102.47	4,041,929.15
KEYCORP	12,976	12.81	166,222.56
M & T BANK CORP	1,428	104.24	148,854.72
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	10.59	36,249.57
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,541	114.18	632,671.38
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	12.06	153,970.02
SIGNATURE BANK	590	93.51	55,170.90
SVB FINANCIAL GROUP	685	250.68	171,715.80
TRUIST FINANCIAL CORP	17,581	39.76	699,020.56
US BANCORP	17,697	37.87	670,185.39
WELLS FARGO & CO	50,605	24.81	1,255,510.05
ZIONS BANCORPORATION	1,197	32.27	38,627.19
ALLY FINANCIAL INC	3,571	24.41	87,168.11
AMERICAN EXPRESS CO	8,992	107.27	964,571.84
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	156.03	261,506.28
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	45.42	70,628.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	10,702	35.96	384,843.92

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	18,044	219.94	3,968,597.36
BLACKROCK INC	1,996	547.38	1,092,570.48
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	8,940	52.67	470,869.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,102	74.64	455,453.28
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	25.53	31,912.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	89.94	111,435.66
CME GROUP INC	4,720	166.08	783,897.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,228	57.99	245,181.72
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,051	53.00	161,703.00
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	19.85	111,120.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	333.42	174,378.66
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	20.37	55,773.06
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,294	201.34	864,553.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,216	100.46	724,919.36
INVESCO LTD	2,612	10.68	27,896.16
KKR & CO INC	6,932	35.19	243,937.08
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	461.85	240,162.00
MOODY'S CORP	2,233	288.68	644,622.44
MORGAN STANLEY	15,561	51.15	795,945.15
MSCI INC	1,140	342.37	390,301.80
NASDAQ INC	1,296	126.99	164,579.04
NORTHERN TRUST CORP	2,230	80.50	179,515.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	75.98	129,393.94
S&P GLOBAL INC	3,155	353.09	1,113,998.95
SCHWAB (CHARLES) CORP	15,394	35.73	550,027.62
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	50.31	87,338.16
STATE STREET CORP	4,767	64.43	307,137.81
SYNCHRONY FINANCIAL	6,195	26.96	167,017.20
T ROWE PRICE GROUP INC	3,050	127.41	388,600.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,033	38.61	117,104.13
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	54.07	39,687.38
VOYA FINANCIAL INC	1,741	49.11	85,500.51
AFLAC INC	9,192	37.07	340,747.44
ALLEGHANY CORP	197	539.00	106,183.00
ALLSTATE CORP	4,209	94.95	399,644.55

AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	68.60	53,233.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	11,606	29.40	341,216.40
AON PLC	3,057	201.96	617,391.72
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,552	31.04	141,294.08
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,584	102.61	265,144.24
ASSURANT INC	506	119.45	60,441.70
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	36.43	46,266.10
BROWN & BROWN INC	2,686	45.17	121,326.62
CHUBB LTD	5,944	120.88	718,510.72
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	77.67	134,679.78
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	224.28	32,744.88
EVEREST RE GROUP LTD	550	209.70	115,335.00
FNF GROUP	3,124	33.68	105,216.32
GLOBE LIFE INC	921	83.23	76,654.83
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,020	38.89	156,337.80
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	35.34	72,800.40
LOEWS CORP	2,906	36.10	104,906.60
MARKEL CORP	155	1,046.40	162,192.00
MARSH & MCLENNAN COS	6,717	117.80	791,262.60
METLIFE INC	10,331	38.84	401,256.04
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	41.32	155,528.48
PROGRESSIVE CORP	7,716	96.26	742,742.16
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,308	69.76	370,286.08
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	104.46	49,096.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	174.32	97,967.84
TRAVELERS COS INC/THE	3,388	114.46	387,790.48
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,732	206.20	357,138.40
WR BERKLEY CORP	1,291	63.85	82,430.35
CBRE GROUP INC - A	4,736	48.78	231,022.08
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	3.80	76,380.00
JONES LANG LASALLE INC	468	105.94	49,579.92
ACCENTURE PLC-CL A	8,268	238.83	1,974,646.44
ADOBE INC	6,244	485.91	3,034,022.04
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	108.19	234,880.49
ANSYS INC	1,132	321.60	364,051.20

AUTODESK INC	2,868	229.83	659,152.44
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,614	136.57	766,703.98
AVALARA INC	1,064	119.18	126,807.52
BLACK KNIGHT INC	1,644	83.57	137,389.08
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	83.73	129,027.93
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,262	136.03	171,669.86
CADENCE DESIGN SYS INC	3,685	103.23	380,402.55
CDK GLOBAL INC	1,236	44.44	54,927.84
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	121.00	201,344.00
CITRIX SYSTEMS INC	1,273	135.40	172,364.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,112	69.29	492,790.48
COUPA SOFTWARE INC	887	248.43	220,357.41
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1,914	128.50	245,949.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	98.02	69,790.24
DATADOG INC - CLASS A	1,771	84.39	149,454.69
DOCUSIGN INC	2,288	202.95	464,349.60
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	20.18	54,385.10
DYNATRACE INC	2,449	39.72	97,274.28
EPAM SYSTEMS INC	745	324.62	241,841.90
FAIR ISAAC CORP	389	424.63	165,181.07
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,041	146.23	1,175,835.43
FISERV INC	7,440	97.17	722,944.80
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	235.04	262,539.68
FORTINET INC	1,600	118.01	188,816.00
GARTNER INC	1,196	132.56	158,541.76
GLOBAL PAYMENTS INC	3,914	170.19	666,123.66
GODADDY INC - CLASS A	2,217	74.73	165,676.41
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	106.03	96,275.24
INTL BUSINESS MACHINES CORP	11,543	122.09	1,409,284.87
INTUIT INC	3,395	318.31	1,080,662.45
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	158.47	133,590.21
LEIDOS HOLDINGS INC	1,476	88.34	130,389.84
MASTERCARD INC-CLASS A	11,575	338.60	3,919,295.00
MICROSOFT CORP	93,149	205.41	19,133,736.09
MONGODB INC	644	211.03	135,903.32

NORTONLIFELOCK INC	6,268	21.26	133,257.68
OKTA INC	1,540	194.69	299,822.60
ORACLE CORP	26,641	59.46	1,584,073.86
PALO ALTO NETWORKS INC	1,280	245.73	314,534.40
PAYCHEX INC	4,283	77.62	332,446.46
PAYCOM SOFTWARE INC	550	272.64	149,952.00
PAYPAL HOLDINGS INC	14,458	186.96	2,703,067.68
PTC INC	1,110	85.40	94,794.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	975	262.06	255,508.50
SALESFORCE.COM INC	11,655	246.64	2,874,589.20
SERVICENOW INC	2,482	458.06	1,136,904.92
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,137	25.69	131,969.53
SPLUNK INC	2,092	183.67	384,237.64
SQUARE INC - A	4,746	144.40	685,322.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	60.50	187,429.00
SYNOPSYS INC	1,988	205.54	408,613.52
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	546	427.51	233,420.46
TWILIO INC - A	1,613	225.91	364,392.83
TYLER TECHNOLOGIES INC	433	330.05	142,911.65
VERISIGN INC	1,385	202.00	279,770.00
VISA INC-CLASS A SHARES	21,845	204.98	4,477,788.10
VMWARE INC-CLASS A	1,126	140.82	158,563.32
WESTERN UNION CO	5,513	22.57	124,428.41
WIX.COM LTD	747	254.55	190,148.85
WORKDAY INC-CLASS A	2,288	208.41	476,842.08
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,086	403.51	841,721.86
ZSCALER INC	963	130.10	125,286.30
AMPHENOL CORP-CL A	3,944	106.78	421,140.32
APPLE INC	224,180	115.35	25,860,283.90
ARISTA NETWORKS INC	777	205.53	159,696.81
ARROW ELECTRONICS INC	902	79.99	72,150.98
CDW CORP/DE	1,592	113.15	180,134.80
CISCO SYSTEMS INC	54,877	40.37	2,215,384.49
COGNEX CORP	1,928	63.75	122,910.00
CORNING INC	10,238	32.74	335,192.12

DELL TECHNOLOGIES -C	3,296	66.85	220,337.60
F5 NETWORKS INC	613	121.64	74,565.32
FLIR SYSTEMS INC	1,041	35.08	36,518.28
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	14,447	9.37	135,368.39
HP INC	19,172	19.33	370,594.76
IPG PHOTONICS CORP	259	162.88	42,185.92
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	23.12	104,802.96
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,546	94.23	239,909.58
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,283	156.00	356,148.00
NETAPP INC	2,471	45.38	112,133.98
SEAGATE TECHNOLOGY	3,159	47.65	150,526.35
TE CONNECTIVITY LTD	4,399	99.58	438,052.42
TRIMBLE INC	3,417	50.43	172,319.31
WESTERN DIGITAL CORP	4,100	38.94	159,654.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	603	251.26	151,509.78
AT&T INC	92,649	29.14	2,699,791.86
CENTURYLINK INC	12,971	10.87	140,994.77
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	21.69	28,327.14
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	21.35	74,789.05
T-MOBILE US INC	7,333	112.27	823,275.91
VERIZON COMMUNICATIONS INC	53,764	60.32	3,243,044.48
AES CORP	7,346	17.95	131,860.70
ALLIANT ENERGY CORP	2,711	52.33	141,866.63
AMEREN CORPORATION	3,331	76.98	256,420.38
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,546	80.34	525,905.64
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,418	142.88	345,483.84
ATMOS ENERGY CORP	1,353	93.32	126,261.96
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	19.54	133,262.80
CMS ENERGY CORP	3,883	61.42	238,493.86
CONSOLIDATED EDISON INC	4,473	74.22	331,986.06
DOMINION ENERGY INC	10,988	80.73	887,061.24
DTE ENERGY COMPANY	2,584	120.38	311,061.92
DUKE ENERGY CORP	9,636	84.38	813,085.68
EDISON INTERNATIONAL	5,098	51.65	263,311.70
ENERGY CORP	2,701	96.72	261,240.72



ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	39.82	98,156.30
EVERGY INC	2,522	52.79	133,136.38
EVERSOURCE ENERGY	4,479	82.91	371,353.89
EXELON CORP	12,893	36.26	467,500.18
FIRSTENERGY CORP	5,919	29.66	175,557.54
NEXTERA ENERGY INC	6,365	281.92	1,794,420.80
NISOURCE INC	4,230	22.38	94,667.40
NRG ENERGY INC	3,312	31.54	104,460.48
OGE ENERGY CORP	1,432	30.23	43,289.36
P G & E CORP	14,486	9.64	139,645.04
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	72.09	110,009.34
PPL CORP	10,335	27.92	288,553.20
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,746	52.48	354,030.08
SEMPRA ENERGY	3,870	119.15	461,110.50
SOUTHERN CO/THE	13,859	52.86	732,586.74
UGI CORP	1,566	32.63	51,098.58
VISTRA CORP	4,854	18.87	91,594.98
WEC ENERGY GROUP INC	4,196	97.18	407,767.28
XCEL ENERGY INC	6,948	69.54	483,163.92
ADVANCED MICRO DEVICES	15,200	77.90	1,184,080.00
ANALOG DEVICES INC	4,806	114.62	550,863.72
APPLIED MATERIALS INC	11,930	56.46	673,567.80
BROADCOM INC	5,183	362.20	1,877,282.60
INTEL CORP	54,829	49.41	2,709,100.89
KLA CORP	2,030	178.08	361,502.40
LAM RESEARCH CORP	1,892	305.42	577,854.64
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,745	39.22	342,978.90
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,911	66.35	193,144.85
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,220	102.21	329,116.20
MICRON TECHNOLOGY INC	14,492	49.03	710,542.76
NVIDIA CORP	7,959	514.89	4,098,009.51
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,648	125.70	458,553.60
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	22.01	119,404.25
QORVO INC	1,251	122.84	153,672.84
QUALCOMM INC	14,584	113.46	1,654,700.64

	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,194	137.79	302,311.26
	TERADYNE INC	1,812	76.82	139,197.84
	TEXAS INSTRUMENTS INC	11,899	138.53	1,648,368.47
	XILINX INC	3,193	101.72	324,791.96
	米ドル 小計	3,947,026		378,082,772.59 (39,978,472,373)
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	14.85	36,590.40
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,284	23.78	387,233.52
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	5.40	55,819.80
	ENBRIDGE INC	26,796	40.72	1,091,133.12
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	19.00	54,663.00
	INTER PIPELINE LTD	3,471	13.34	46,303.14
	KEYERA CORP	2,259	21.46	48,478.14
	PARKLAND CORP	1,790	33.47	59,911.30
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,181	31.31	193,527.11
	SUNCOR ENERGY INC	20,962	17.82	373,542.84
	TC ENERGY CORP	12,551	60.03	753,436.53
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	114.00	389,994.00
	B2GOLD CORP	10,119	9.11	92,184.09
	BARRICK GOLD CORP	23,822	39.46	940,016.12
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	47.92	80,170.16
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	12.65	116,544.45
	FRANCO-NEVADA CORP	2,617	194.23	508,299.91
	KINROSS GOLD CORP	19,092	12.22	233,304.24
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	71.62	224,958.42
	LUNDIN MINING CORP	7,300	8.34	60,882.00
	NUTRIEN LTD	7,998	52.40	419,095.20
	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	47.75	97,887.50
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	17.92	132,679.68
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,261	70.96	444,280.56
	YAMANA GOLD INC	9,288	8.32	77,276.16
	CAE INC	3,196	19.69	62,929.24
	WSP GLOBAL INC	1,340	89.88	120,439.20
	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,068	75.96	81,125.28
	THOMSON REUTERS CORP	1,971	102.37	201,771.27

AIR CANADA	840	18.07	15,178.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,415	140.74	1,325,067.10
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,833	402.42	737,635.86
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,272	64.13	209,833.36
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	27.08	48,744.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	74.42	307,056.92
QUEBECOR INC -CL B	1,274	32.96	41,991.04
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	24.70	141,555.70
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	133.32	66,660.00
DOLLARAMA INC	3,451	49.54	170,962.54
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,716	44.67	523,353.72
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	38.06	100,021.68
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	68.26	144,301.64
METRO INC	2,930	60.33	176,766.90
WESTON (GEORGE) LTD	817	96.18	78,579.06
SAPUTO INC	3,667	32.34	118,590.78
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	20.96	68,685.92
CANOPY GROWTH CORP	1,137	21.67	24,638.79
CRONOS GROUP INC	1,000	7.12	7,120.00
BANK OF MONTREAL	8,502	81.36	691,722.72
BANK OF NOVA SCOTIA	16,021	55.32	886,281.72
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,942	102.76	610,599.92
NATIONAL BANK OF CANADA	4,616	72.80	336,044.80
ROYAL BANK OF CANADA	18,589	97.87	1,819,305.43
TORONTO-DOMINION BANK	23,679	63.38	1,500,775.02
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,959	43.68	784,449.12
CI FINANCIAL CORP	775	18.04	13,981.00
IGM FINANCIAL INC	81	32.25	2,612.25
ONEX CORPORATION	908	62.43	56,686.44
TMX GROUP LTD	540	136.10	73,494.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	391.36	127,583.36
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	26.34	113,999.52
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	46.10	57,809.40
INTACT FINANCIAL CORP	2,057	140.88	289,790.16
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,548	19.31	512,641.88

	POWER CORP OF CANADA	8,338	26.13	217,871.94
	SUN LIFE FINANCIAL INC	8,077	55.33	446,900.41
	BLACKBERRY LTD	1,407	6.35	8,934.45
	CGI INC	2,689	90.71	243,919.19
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	275	1,508.19	414,752.25
	OPEN TEXT CORP	3,074	55.91	171,867.34
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,406	1,231.22	1,731,095.32
	BCE INC	2,440	55.75	136,030.00
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	53.26	275,513.98
	TELUS CORP	4,085	23.82	97,304.70
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	18.56	166,074.88
	ALTAGAS LTD	2,930	16.45	48,198.50
	ATCO LTD -CLASS I	863	39.47	34,062.61
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	32.27	31,850.49
	EMERA INC	2,818	54.05	152,312.90
	FORTIS INC	6,487	52.86	342,902.82
	HYDRO ONE LTD	4,991	27.39	136,703.49
	カナダドル 小計	485,587		24,225,292.20 (1,942,868,434)
ユーロ	ENI SPA	35,538	7.47	265,682.08
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.84	65,534.04
	NESTE OYJ	5,733	46.16	264,635.28
	OMV AG	1,475	26.90	39,677.50
	REPSOL SA	16,357	6.26	102,492.96
	TENARIS SA	5,062	4.52	22,885.30
	TOTAL SE	32,497	32.02	1,040,716.42
	VOPAK	762	47.42	36,134.04
	AIR LIQUIDE SA	6,272	141.10	884,979.20
	AKZO NOBEL	2,659	86.32	229,524.88
	ARCELORMITTAL	8,506	10.78	91,762.72
	ARKEMA	822	98.66	81,098.52
	BASF SE	12,212	55.00	671,660.00
	COVESTRO AG	2,528	43.76	110,625.28
	CRH PLC	10,365	31.86	330,228.90
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	23.64	42,386.52

FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	41.84	2,343.04
HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	54.70	118,370.80
KONINKLIJKE DSM NV	2,331	136.50	318,181.50
LANXESS AG	745	51.70	38,516.50
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	31.80	72,694.80
SOLVAY SA	925	78.92	73,001.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	13.27	115,661.32
SYMRISE AG	1,815	117.20	212,718.00
THYSSENKRUPP AG	2,040	5.76	11,758.56
UMICORE	2,388	39.24	93,705.12
UPM-KYMMENE OYJ	6,116	26.32	160,973.12
VOESTALPINE AG	712	21.90	15,592.80
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	21.11	60,691.25
AIRBUS SE	7,861	71.32	560,646.52
ALSTOM	2,236	45.95	102,744.20
ANDRITZ AG	1,260	27.00	34,020.00
BOUYGUES SA	3,499	32.21	112,702.79
BRENTAG AG	1,535	55.18	84,701.30
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	6.83	111,178.74
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7,237	36.04	260,821.48
DASSAULT AVIATION SA	11	818.50	9,003.50
EIFFAGE	1,313	77.58	101,862.54
FERROVIAL SA	7,014	21.90	153,606.60
GEA GROUP AG	1,676	31.18	52,257.68
HOCHTIEF AG	17	73.60	1,251.20
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	70.15	143,807.50
KION GROUP AG	740	76.08	56,299.20
KNORR-BREMSE AG	691	101.28	69,984.48
KONE OYJ-B	4,561	72.38	330,125.18
LEGRAND SA	3,715	70.12	260,495.80
LEONARDO SPA	3,148	5.51	17,364.36
MTU AERO ENGINES AG	622	158.90	98,835.80
PRYSMIAN SPA	2,867	24.61	70,556.87
SAFRAN SA	4,327	97.48	421,795.96
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,324	107.05	784,034.20

SIEMENS AG-REG	10,012	116.84	1,169,802.08
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	22.22	50,972.68
THALES SA	1,244	68.82	85,612.08
VINCI SA	6,890	77.78	535,904.20
WARTSILA OYJ ABP	2,705	6.87	18,588.76
BUREAU VERITAS SA	4,564	19.78	90,298.74
RANDSTAD NV	825	46.16	38,082.00
TELEPERFORMANCE	832	259.10	215,571.20
WOLTERS KLUWER	3,691	71.30	263,168.30
ADP	314	87.35	27,427.90
AENA SME SA	754	120.90	91,158.60
ATLANTIA SPA	8,066	14.53	117,239.31
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	8.65	12,173.36
DEUTSCHE POST AG-REG	13,231	38.34	507,276.54
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	35.62	13,713.70
GETLINK	4,655	12.23	56,930.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,522	63.86	288,774.92
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	49.50	30,640.50
CONTINENTAL AG	1,275	95.18	121,354.50
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,398	46.00	524,364.99
FAURECIA	800	42.50	34,000.00
FERRARI NV	1,758	161.40	283,741.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,480	9.98	124,587.84
MICHELIN (CGDE)	2,383	96.04	228,863.32
PEUGEOT SA	8,853	16.19	143,330.07
PIRELLI & C SPA	1,734	3.86	6,696.70
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	54.40	96,560.00
RENAULT SA	1,817	24.68	44,843.56
VALEO SA	2,418	29.87	72,225.66
VOLKSWAGEN AG	462	157.60	72,811.20
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,502	148.40	371,296.80
ADIDAS AG	2,525	275.70	696,142.50
ESSILORLUXOTTICA	3,854	110.50	425,867.00
HERMES INTERNATIONAL	437	739.80	323,292.60
KERING	1,018	577.00	587,386.00

LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,640	420.25	1,529,710.00
MONCLER SPA	2,414	35.21	84,996.94
PUMA SE	750	74.72	56,040.00
SEB SA	151	138.70	20,943.70
ACCOR SA	2,330	25.18	58,669.40
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,046	128.10	262,092.60
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	31.09	25,058.54
SODEXO	1,088	65.96	71,764.48
BOLLORE	3,240	3.25	10,555.92
JC DECAUX SA	60	16.22	973.20
PUBLICIS GROUPE	3,613	28.97	104,668.61
SCOUT24 AG	1,621	76.10	123,358.10
SES	2,232	6.10	13,624.12
TELENET GROUP HOLDING NV	192	31.80	6,105.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	73.72	80,723.40
VIVENDI	11,862	24.46	290,144.52
DELIVERY HERO SE	1,478	90.00	133,020.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,775	22.71	335,540.25
JUST EAT TAKEAWAY	1,360	90.72	123,379.20
PROSUS NV	6,414	81.24	521,073.36
ZALANDO SE	2,148	73.24	157,319.52
CARREFOUR SA	7,042	14.53	102,320.26
COLRUYT SA	290	53.00	15,370.00
JERONIMO MARTINS	2,258	13.93	31,465.23
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	14,664	25.73	377,304.72
METRO AG	1,970	8.90	17,533.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,177	47.65	484,934.05
DANONE	8,264	57.34	473,857.76
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	9.13	82,333.87
HEINEKEN HOLDING NV	1,282	68.90	88,329.80
HEINEKEN NV	3,455	77.78	268,729.90
KERRY GROUP PLC-A	2,069	113.90	235,659.10
PERNOD RICARD SA	2,853	142.40	406,267.20
REMY COINTREAU	264	150.50	39,732.00
BEIERSDORF AG	1,128	98.04	110,589.12

HENKEL AG & CO KGAA	966	78.30	75,637.80
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	90.30	216,358.80
L'OREAL	3,296	281.40	927,494.40
UNILEVER NV	18,967	51.42	975,283.14
BIOMERIEUX	402	122.60	49,285.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	93.00	22,785.00
DIASORIN SPA	256	155.40	39,782.40
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	72.16	213,304.96
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,777	38.43	222,010.11
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,089	39.67	479,631.07
ORPEA	501	99.94	50,069.94
SARTORIUS AG-VORZUG	502	328.00	164,656.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,463	37.87	131,161.12
ARGENX SE	674	194.00	130,756.00
BAYER AG-REG	12,953	55.39	717,466.67
EUROFINS SCIENTIFIC	153	657.00	100,521.00
GALAPAGOS NV	507	114.50	58,051.50
GRIFOLS SA	3,329	23.52	78,298.08
IPSEN	158	90.90	14,362.20
MERCK KGAA	1,798	123.00	221,154.00
ORION OYJ-CLASS B	739	38.50	28,451.50
QIAGEN N.V.	2,679	42.20	113,053.80
RECORDATI SPA	830	45.14	37,466.20
SANOFI	14,824	87.06	1,290,577.44
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	282.80	84,274.40
UCB SA	1,446	95.80	138,526.80
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.30	31,589.80
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	91,083	2.49	226,796.67
BANCO SANTANDER SA	221,323	1.81	401,479.92
BANKINTER SA	2,829	4.54	12,843.66
BNP PARIBAS	14,918	36.57	545,551.26
CAIXABANK S.A	52,513	2.01	106,023.74
COMMERZBANK AG	13,866	4.80	66,667.72
CREDIT AGRICOLE SA	16,523	8.64	142,791.76
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	20.49	80,341.29



FINECOBANK SPA	7,003	12.29	86,066.87
ING GROEP NV-CVA	51,310	7.16	367,636.15
INTESA SANPAOLO	223,051	1.77	396,807.72
KBC GROEP NV	3,531	48.32	170,617.92
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.26	49,822.96
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	14.88	18,094.08
SOCIETE GENERALE SA	9,028	13.20	119,187.65
UNICREDIT SPA	29,529	8.08	238,801.02
AMUNDI SA	618	61.60	38,068.80
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,465	7.88	216,424.20
DEUTSCHE BOERSE AG	2,564	151.50	388,446.00
EURAZEO	403	47.10	18,981.30
EXOR NV	1,318	49.10	64,713.80
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,384	78.80	109,059.20
NATIXIS	3,105	2.21	6,889.99
SOFINA	168	228.00	38,304.00
WENDEL	294	84.25	24,769.50
AEGON NV	16,557	2.32	38,412.24
AGEAS	2,765	36.85	101,890.25
ALLIANZ SE-REG	5,481	182.90	1,002,474.90
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	12.82	205,276.95
AXA SA	26,166	17.27	451,939.15
CNP ASSURANCES	1,015	11.42	11,591.30
HANNOVER RUECK SE	718	142.70	102,458.60
MAPFRE SA	942	1.54	1,456.33
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,879	245.10	460,542.90
NN GROUP NV	4,060	33.16	134,629.60
POSTE ITALIANE SPA	5,374	7.97	42,830.78
SAMPO OYJ-A SHS	6,490	34.63	224,748.70
SCOR SE	1,565	25.00	39,125.00
AROUNDTOWN SA	10,475	4.81	50,447.60
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,911	44.01	216,133.11
LEG IMMOBILIEN AG	1,031	123.68	127,514.08
VONOVIA SE	7,029	60.30	423,848.70
ADYEN NV	239	1,380.00	329,820.00

AMADEUS IT GROUP SA	6,112	49.73	303,949.76
ATOS SE	1,004	70.90	71,183.60
CAPGEMINI SA	2,213	118.30	261,797.90
DASSAULT SYSTEMES SA	1,805	157.95	285,099.75
EDENRED	2,756	43.26	119,224.56
NEMETSCHEK SE	536	63.40	33,982.40
NEXI SPA	3,732	16.35	61,036.86
SAP SE	13,579	135.88	1,845,114.52
TEAMVIEWER AG	1,207	41.40	49,969.80
WORLDFLINE SA	1,544	75.74	116,942.56
INGENICO GROUP	708	141.00	99,828.00
NOKIA OYJ	76,089	3.47	264,295.14
ALTICE EUROPE NV	7,300	4.13	30,149.00
CELLNEX TELECOM SA	4,483	51.98	233,026.34
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	44,316	15.25	676,040.58
ELISA OYJ	2,152	49.45	106,416.40
ILIAD SA	98	166.20	16,287.60
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	8.89	21,988.44
KONINKLIJKE KPN NV	41,469	2.19	90,817.11
ORANGE	28,127	9.51	267,544.02
PROXIMUS	918	16.67	15,307.65
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.37	26,807.33
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.36	26,275.47
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.41	30,404.56
TELEFONICA SA	69,076	3.28	226,569.28
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	40.43	30,969.38
E.ON SE	30,402	9.82	298,730.05
EDF	6,102	8.44	51,549.69
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,111	4.22	156,756.86
ELIA GROUP SA/NV	345	84.50	29,152.50
ENAGAS SA	2,667	20.30	54,140.10
ENDESA SA	4,803	23.19	111,381.57
ENEL SPA	107,833	7.56	815,325.31
ENGIE	25,193	11.94	300,930.38
FORTUM OYJ	6,395	17.01	108,810.92

	IBERDROLA SA	78,288	10.55	825,938.40
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	16.95	36,368.47
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.26	79,787.82
	RWE AG	8,723	31.50	274,774.50
	SNAM SPA	23,547	4.42	104,171.92
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	15.20	34,124.00
	TERNA SPA	16,305	6.02	98,156.10
	UNIPER SE	2,857	26.54	75,824.78
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,127	19.31	118,343.00
	VERBUND AG	797	44.76	35,673.72
	ASML HOLDING NV	5,518	310.25	1,711,959.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,550	24.49	405,309.50
	STMICROELECTRONICS NV	8,739	26.36	230,360.04
	ユーロ 小計	2,376,379		49,708,148.12 (6,237,875,507)
英債券	BP PLC	266,429	2.57	684,988.95
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	54,107	10.65	576,347.76
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	49,043	10.20	500,336.68
	ANGLO AMERICAN PLC	16,694	19.37	323,429.55
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	10.96	47,368.80
	BHP GROUP PLC	28,186	17.53	494,213.32
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,494	61.50	91,881.00
	EVRAZ PLC	3,072	3.32	10,217.47
	GLENCORE PLC	138,176	1.81	250,982.88
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	26.10	47,058.30
	MONDI PLC	5,627	15.13	85,164.64
	RIO TINTO PLC	14,830	50.00	741,500.00
	ASHTED GROUP PLC	6,287	28.52	179,305.24
	BAE SYSTEMS PLC	43,957	5.20	228,664.31
	BUNZL PLC	4,790	23.92	114,576.80
	DCC PLC	1,401	63.26	88,627.26
	FERGUSON PLC	3,075	73.10	224,782.50
	MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	1.23	55,034.07
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	22,239	2.10	46,768.61
	SMITHS GROUP PLC	3,824	14.25	54,511.12

SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	106.55	90,354.40
EXPERIAN PLC	12,198	29.50	359,841.00
INTERTEK GROUP PLC	1,825	62.50	114,062.50
RELX PLC	25,710	17.96	461,751.60
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.46	114,115.64
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	5.02	60,847.42
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	44.59	66,795.82
BURBERRY GROUP PLC	5,808	15.59	90,575.76
PERSIMMON PLC	3,796	24.92	94,596.32
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.10	47,992.22
COMPASS GROUP PLC	24,300	13.13	319,180.50
GVC HOLDINGS PLC	6,950	8.85	61,507.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	44.22	111,080.64
WHITBREAD PLC	2,921	22.92	66,949.32
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.61	63,617.84
INFORMA PLC	17,619	4.03	71,110.28
PEARSON PLC	7,332	5.19	38,111.73
WPP PLC	14,514	6.38	92,628.34
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	7.85	38,945.92
KINGFISHER PLC	29,802	2.84	84,756.88
NEXT PLC	1,878	59.94	112,567.32
OCADO GROUP PLC	6,371	23.55	150,037.05
SAINSBURY (J) PLC	9,573	1.84	17,666.97
TESCO PLC	132,370	2.17	287,772.38
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.77	40,770.17
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	19.39	96,470.73
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	30,049	26.42	793,894.58
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	20.82	38,225.52
DIAGEO PLC	30,606	26.31	805,243.86
IMPERIAL BRANDS PLC	10,573	13.73	145,220.15
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,269	75.58	700,551.02
UNILEVER PLC	15,248	48.03	732,361.44
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	15.67	190,045.76
ASTRAZENECA PLC	17,106	84.00	1,436,904.00

	GLAXOSMITHKLINE PLC	65,666	15.15	995,233.89
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	26.63	36,003.76
	BARCLAYS PLC	231,567	1.03	239,949.72
	HSBC HOLDINGS PLC	265,744	3.22	855,961.42
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	943,785	0.26	248,828.91
	NATWEST GROUP PLC	42,392	1.02	43,557.78
	STANDARD CHARTERED PLC	30,372	3.82	116,081.78
	3I GROUP PLC	14,053	9.48	133,250.54
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	16.48	50,560.64
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,254	89.60	381,158.40
	M&G PLC	21,579	1.51	32,627.44
	SCHRODERS PLC	1,161	27.71	32,171.31
	ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	9.60	74,431.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	32,937	2.32	76,578.52
	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	27.07	74,307.15
	AVIVA PLC	45,209	3.02	136,531.18
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	2.98	58,536.23
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,505	1.95	163,586.29
	PRUDENTIAL PLC	34,888	11.69	408,015.16
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	4.70	44,161.20
	AVEVA GROUP PLC	700	48.39	33,873.00
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	7.21	109,619.76
	HALMA PLC	4,416	22.93	101,258.88
	BT GROUP PLC	129,623	1.11	144,075.96
	VODAFONE GROUP PLC	360,190	1.09	394,840.27
	NATIONAL GRID PLC	46,737	8.49	396,984.07
	SEVERN TRENT PLC	2,734	24.16	66,053.44
	SSE PLC	14,351	12.03	172,642.53
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	8.60	67,381.00
	英ポンド 小計	3,712,440		18,530,573.07 (2,515,895,905)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.17	54,629.57
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	848.50	66,183.00
	GIVAUDAN-REG	124	3,963.00	491,412.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	7,141	43.97	313,989.77

SIKA AG-REG	1,908	217.00	414,036.00
ABB LTD-REG	24,382	23.78	579,803.96
GEBERIT AG-REG	504	523.60	263,894.40
SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	244.20	52,503.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	246.30	114,036.90
ADECCO SA-REG	1,516	50.44	76,467.04
SGS SA-REG	67	2,394.00	160,398.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	609	175.70	107,001.30
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6,992	66.54	465,247.68
SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	214.80	88,068.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	41.14	10,326.14
BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,028.00	85,176.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	15	7,730.00	115,950.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	81,200.00	81,200.00
NESTLE SA-REG	38,555	109.70	4,229,483.50
ALCON INC	6,601	51.34	338,895.34
SONOVA HOLDING AG-REG	614	217.70	133,667.80
STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	921.40	106,882.40
LONZA GROUP AG-REG	985	550.60	542,341.00
NOVARTIS AG-REG	28,858	81.90	2,363,470.20
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,120	330.00	3,009,600.00
VIFOR PHARMA AG	638	128.10	81,727.80
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	94.80	25,880.40
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,933	10.26	337,892.58
JULIUS BAER GROUP LTD	2,587	41.39	107,075.93
PARTNERS GROUP HOLDING AG	259	870.60	225,485.40
UBS GROUP AG-REG	48,789	11.43	557,658.27
BALOISE HOLDING AG - REG	658	146.50	96,397.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	376.10	138,404.80
SWISS RE AG	4,010	75.72	303,637.20
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,988	340.50	676,914.00
SWISS PRIME SITE-REG	1,117	84.55	94,442.35
TEMENOS GROUP AG-REG	737	143.80	105,980.60
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,319	64.10	148,647.90
SWISSCOM AG-REG	301	494.50	148,844.50

	スイスフラン 小計	229,393		17,313,651.73 (2,015,135,924)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	192.80	211,887.20	
	BOLIDEN AB	4,039	264.80	1,069,527.20	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	6,034	116.55	703,262.70	
	ALFA LAVAL AB	4,566	207.50	947,445.00	
	ASSA ABLOY AB-B	13,841	202.60	2,804,186.60	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,124	409.70	3,738,102.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	5,552	358.30	1,989,281.60	
	EPIROC AB-A	9,564	127.95	1,223,713.80	
	EPIROC AB-B	4,649	123.05	572,059.45	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	195.70	286,504.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,084	223.70	689,890.80	
	SANDVIK AB	15,627	183.00	2,859,741.00	
	SKANSKA AB-B SHS	4,937	188.25	929,390.25	
	SKF AB-B SHARES	4,538	188.35	854,732.30	
	VOLVO AB-B SHS	20,302	172.15	3,494,989.30	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	134.25	514,580.25	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	183.65	281,351.80	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	92.00	261,004.00	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,877	573.40	1,076,271.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	142.75	1,369,115.25	
	ICA GRUPPEN AB	1,462	433.70	634,069.40	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	701.40	1,402,098.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,201	301.40	2,471,781.40	
	NORDEA BANK ABP	43,708	69.80	3,050,818.40	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,719	83.76	1,567,903.44	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,862	85.82	1,532,916.84	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,556	148.90	1,571,788.40	
	EQT AB	2,344	160.00	375,040.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	237.80	559,543.40		
INVESTOR AB-B SHS	6,250	569.20	3,557,500.00		
KINNEVIK AB - B	2,331	316.15	736,945.65		
LUNDBERGS AB-B SHS	920	434.80	400,016.00		
ERICSSON LM-B SHS	39,493	95.88	3,786,588.84		

	HEXAGON AB-B SHS	3,933	662.00	2,603,646.00	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	125.70	933,196.80	
	TELIA CO AB	31,100	34.61	1,076,371.00	
	スウェーデンクローナ 小計	326,745		52,137,262.07 (627,732,635)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	14,162	139.50	1,975,599.00	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	27.55	223,320.30	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	371.70	1,030,352.40	
	ADEVINTA ASA	3,943	155.90	614,713.70	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	354.40	195,628.80	
	MOWI ASA	5,643	176.30	994,860.90	
	ORKLA ASA	11,182	91.82	1,026,731.24	
	DNB ASA	13,159	136.45	1,795,545.55	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	188.60	504,316.40	
	TELENOR ASA	9,278	148.55	1,378,246.90	
	ノルウェークローネ 小計	71,471		9,739,315.19 (113,755,201)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	692.60	843,586.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,451	409.70	1,004,174.70	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	944.00	2,554,464.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	8,935.00	348,465.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	74	9,650.00	714,100.00	
	DSV PANALPINA A S	2,852	967.80	2,760,165.60	
	PANDORA A/S	1,082	491.80	532,127.60	
	CARLSBERG AS-B	1,203	861.40	1,036,264.20	
	AMBU A/S-B	1,526	168.35	256,902.10	
	COLOPLAST-B	1,680	993.80	1,669,584.00	
	DEMANT A/S	550	190.15	104,582.50	
	GN STORE NORD A/S	1,892	460.70	871,644.40	
	GENMAB A/S	907	2,275.00	2,063,425.00	
	H LUNDBECK A/S	120	206.00	24,720.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	22,611	419.50	9,485,314.50	
	DANSKE BANK A/S	9,894	87.86	869,286.84	
TRYG A/S	694	193.20	134,080.80		
ORSTED A/S	2,606	856.20	2,231,257.20		



	デンマーククローネ 小計	54,105		27,504,145.24 (463,994,930)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	24.02	72,348.24
	OIL SEARCH LTD	14,702	2.92	42,929.84
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.71	124,381.68
	SANTOS LTD	26,550	5.24	139,122.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	21.30	7,604.10
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	18.37	249,997.33
	BHP GROUP LTD	38,850	37.24	1,446,774.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	13.18	82,454.08
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	5.90	95,226.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,433	17.71	414,998.43
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	30.63	203,873.28
	NEWCREST MINING LTD	11,374	32.38	368,290.12
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	13.89	102,466.53
	ORICA LTD	6,263	17.22	107,848.86
	RIO TINTO LTD	5,096	103.73	528,608.08
	SOUTH32 LTD	74,829	2.17	162,378.93
	CIMIC GROUP LTD	682	19.82	13,517.24
	BRAMBLES LTD	17,428	10.60	184,736.80
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	4.35	100,206.60
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	3.94	34,278.00
	SYDNEY AIRPORT	12,027	5.52	66,389.04
	TRANSURBAN GROUP	37,559	14.10	529,581.90
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,885	28.83	198,494.55
	CROWN RESORTS LTD	773	9.16	7,080.68
	TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	3.48	73,890.84
	REA GROUP LTD	563	110.37	62,138.31
	SEEK LTD	3,309	19.33	63,962.97
WESFARMERS LTD	15,132	44.92	679,729.44	
COLES GROUP LTD	18,622	17.15	319,367.30	
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,961	36.49	618,906.89	
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	9.24	47,761.56	
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	9.09	64,084.50	
COCHLEAR LTD	742	193.57	143,628.94	

	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	65.14	179,135.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	5,181	32.59	168,848.79	
	CSL LTD	5,952	283.14	1,685,249.28	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	37,603	17.68	664,821.04	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	23,131	66.17	1,530,578.27	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	42,284	17.40	735,741.60	
	WESTPAC BANKING CORP	47,676	16.97	809,061.72	
	AMP LTD	36,656	1.54	56,633.52	
	ASX LTD	2,263	82.59	186,901.17	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,578	120.20	550,275.60	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	56.81	88,453.17	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	4.67	164,808.97	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.55	85,725.90	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	17,256	9.37	161,688.72	
	SUNCORP GROUP LTD	19,255	9.01	173,487.55	
	LENLEASE GROUP	8,292	12.12	100,499.04	
	AFTERPAY LTD	2,984	72.58	216,578.72	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	12.46	69,825.84	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	27.60	44,160.00	
	TELSTRA CORP LTD	50,525	2.88	145,512.00	
	TPG TELECOM LTD	287	7.33	2,103.71	
	AGL ENERGY LTD	7,599	14.72	111,857.28	
	APA GROUP	13,816	10.28	142,028.48	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.87	2,687.19	
	オーストラリアドル 小計	883,978		15,433,719.62	(1,187,161,713)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.05	157,144.50	
	A2 MILK CO LTD	7,857	17.72	139,226.04	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	33.20	220,315.20	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	13.86	76,313.16	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.77	109,314.09	
	MERCURY NZ LTD	7,200	5.19	37,368.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	4.95	113,647.05	
	ニュージーランドドル 小計	95,365		853,328.04	(60,398,558)

香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,000	49.05	1,912,950.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	16,500	101.50	1,674,750.00	
	MTR CORP	19,500	39.20	764,400.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	59.20	1,894,400.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	33.65	1,043,150.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	10.76	21,520.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	14.02	72,904.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	25.40	558,800.00	
	WH GROUP LTD	152,000	6.64	1,009,280.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	31.60	379,200.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	16.72	60,192.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	22.40	985,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	120.80	1,087,200.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	16,200	371.80	6,023,160.00	
	AIA GROUP LTD	159,200	80.50	12,815,600.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	41.00	1,640,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	20.20	545,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	29.20	406,347.20	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	20.75	10,375.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	38.80	1,008,800.00	
	PACIFIC CENTURY PREMIUM DEVELOPMENTS LIM	432	2.10	907.20	
	SINO LAND CO	18,000	9.62	173,160.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	100.50	1,979,850.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	39.95	167,790.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	20.00	100,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	31.20	717,600.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.84	357,720.00	
	PCCW LTD	4,000	4.91	19,640.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	38.40	168,960.00	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	74.50	1,788,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.90	244,900.00	
HONG KONG & CHINA GAS	156,874	11.38	1,785,226.12		
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	41.70	750,600.00		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	78.90	126,240.00		
		1,013,822		42,294,621.52	

香港ドル 小計				(576,898,637)
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	4.16	79,040.00
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.40	40,800.00
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	0.96	1,447.50
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	3.51	92,313.00
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.67	54,136.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	17.92	1,792.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.15	104,580.00
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,500	20.46	501,270.00
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,800	8.56	392,048.00
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,600	19.37	321,542.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	8.52	97,980.00
	CAPITALAND LTD	49,800	2.73	135,954.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.98	23,940.00
	UOL GROUP LTD	2,100	6.65	13,965.00
VENTURE CORP LTD	4,100	19.16	78,556.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.23	274,513.00	
シンガポールドル 小計		445,400		2,213,876.50 (171,619,706)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	4,122	12.43	51,236.46
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	441.00	168,021.00
	BANK HAPOLIM BM	18,231	19.60	357,327.60
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	16.35	293,057.40
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	9.81	73,768.90
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	63.20	89,364.80
	AZRIELI GROUP	234	164.00	38,376.00
	NICE SYSTEMS LTD	731	734.70	537,065.70
イスラエルシュケル 小計		50,556		1,608,217.86 (49,452,699)
合 計		13,692,267		55,941,262,222 (55,941,262,222)

(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	70,271.11	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	286,767.36	
		AMERICAN TOWER CORP	5,813	1,475,920.70	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	121,796.73	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	301,237.44	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,674	143,813.34	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	103,265.60	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,513	882,962.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	519,696.56	
		DUKE REALTY CORP	4,194	158,952.60	
		EQUINIX INC	1,170	884,566.80	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	159,242.85	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,175	294,612.75	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	753	167,459.67	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,476	164,323.08	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	49,680.84	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	218,748.56	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	77,575.36	
		INVITATION HOMES INC	7,683	224,036.28	
		IRON MOUNTAIN INC	4,068	117,809.28	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	108,911.52	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,301	155,664.65	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	56,749.00	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	77,192.90	
		PROLOGIS INC	9,749	993,910.55	
		PUBLIC STORAGE	2,131	478,920.94	
		REALTY INCOME CORP	4,769	312,369.50	
		REGENCY CENTERS CORP	1,514	60,620.56	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	467,631.90	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	288,692.40	
SUN COMMUNITIES INC	1,389	204,655.26			
UDR INC	3,355	118,062.45			
VENTAS INC	4,246	193,108.08			

	VEREIT INC	11,100	78,810.00	
	VICI PROPERTIES INC	5,335	132,361.35	
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	44,417.52	
	WELLTOWER INC	5,753	345,870.36	
	WEYERHAEUSER CO	10,330	298,846.90	
	WP CAREY INC	2,436	168,303.24	
	米ドル 小計	164,147	11,007,838.07	(1,163,968,797)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	41,553.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	27,032.22	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	22,628.70	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,127.84	
	カナダドル 小計	4,434	92,341.76	(7,405,809)
ユーロ	COVIVIO	522	31,789.80	
	GECINA SA	569	63,500.40	
	ICADE	30	1,545.00	
	KLEPIERRE	1,289	17,124.36	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	88,639.66	
	ユーロ 小計	4,691	202,599.22	(25,424,176)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	19,924.60	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	36,158.47	
	SEGRO PLC	13,859	130,274.60	
	英ポンド 小計	26,244	186,357.67	(25,301,780)
オーストラリアドル	DEXUS	13,745	122,742.85	
	GOODMAN GROUP	23,275	418,717.25	
	GPT GROUP	15,542	60,458.38	
	MIRVAC GROUP	63,099	129,352.95	
	SCENTRE GROUP	83,252	174,829.20	
	STOCKLAND	29,890	107,902.90	
	VICINITY CENTRES	42,168	57,137.64	
	オーストラリアドル 小計	270,971	1,071,141.17	(82,392,178)
香港ドル	LINK REIT	31,300	1,990,680.00	

		香港ドル 小計	31,300	1,990,680.00 (27,152,875)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		41,300	133,399.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		25,500	43,860.00
	CAPITALAND MALL TRUST		22,000	44,220.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		23,000	45,540.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST		38,500	78,155.00
	SUNTEC REIT		8,500	12,495.00
		シンガポールドル 小計	158,800	357,669.00 (27,726,500)
合計				1,359,372,115 (1,359,372,115)

(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 591銘柄	97.2%		69.9%
	投資証券 39銘柄		2.8%	2.0%
カナダドル	株式 81銘柄	99.6%		3.4%
	投資証券 4銘柄		0.4%	0.0%
ユーロ	株式 239銘柄	99.6%		11.0%
	投資証券 5銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式 84銘柄	99.0%		4.4%
	投資証券 3銘柄		1.0%	0.0%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.5%
スウェーデンクローナ	株式 36銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	93.5%		2.1%
	投資証券 7銘柄		6.5%	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 34銘柄	95.5%		1.0%

	投資証券	1銘柄		4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	86.1%		0.3%
	投資証券	6銘柄		13.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 9月15日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,466,861,982
コール・ローン	19,857,367
株式	8,212,388,088
投資証券	5,333,715
派生商品評価勘定	22,090,672
未収入金	43,320
未収配当金	8,340,269
差入委託証拠金	423,380,105
流動資産合計	10,158,295,518
資産合計	10,158,295,518
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	48,615
未払金	2,174,494
未払解約金	3,282,000
未払利息	53
流動負債合計	5,505,162
負債合計	5,505,162
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	7,606,454,069
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,546,336,287
元本等合計	10,152,790,356



2020年 9月15日現在

純資産合計	10,152,790,356
負債純資産合計	10,158,295,518

## 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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	6,615,907,761円
期中追加設定元本額	7,366,577,832円
期中一部解約元本額	6,376,031,524円
期末元本額	7,606,454,069円

期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	492,314,127円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,024,357,717円
りそなラップ型ファンド（成長型）	1,020,474,651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	322,679,063円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	257,294,899円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	131,740,093円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	80,010,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	6,215,402円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,434,374円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,603,914円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,958,129円
リスクコントロール・オープン	5,815,394円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	130,034,809円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,553,744,130円
Smart-i 新興国株式インデックス	956,762,522円
Smart-i 8資産バランス 安定型	40,433,117円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	93,439,826円
Smart-i 8資産バランス 成長型	105,867,158円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	360,027,992円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	321,752,320円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	182,986,013円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	121,911,670円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	324,253,541円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	53,686,331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）	1,046,153円
2. 計算日における受益権の総数	7,606,454,069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	1.3348円
(10,000口当たり純資産額)	(13,348円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### （金融商品に関する注記）

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 9月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在

株式		274,688,633
投資証券		3,231,857
合計		271,456,776

(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 9月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,893,187,993	-	1,915,278,665	22,090,672
	合計	1,893,187,993	-	1,915,278,665	22,090,672

(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 9月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	12,313,295	-	12,264,680	48,615
	米ドル	12,313,295	-	12,264,680	48,615
	合計	12,313,295	-	12,264,680	48,615

(注)時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	72,632	4.70	341,660.92	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.67	5,502.20	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,076	63.00	319,788.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,144	145.50	166,452.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	13,717	4.93	67,638.52	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	4.73	69,637.14	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,978	42.98	127,994.44	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	5.06	9,614.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,090	12.58	26,292.20	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	6.61	20,821.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	7,919	25.85	204,706.15	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,840	22.16	40,774.40	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	11.98	28,105.08	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	875	112.90	98,787.50	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	13.09	41,888.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,085	47.33	51,353.05	
	51JOB INC-ADR	300	66.45	19,935.00	
	BEST INC - ADR	1,500	3.47	5,205.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	4,700	31.72	149,084.00	
	NIO INC - ADR	13,000	18.73	243,490.00	
XPENG INC - ADR	1,300	20.48	26,624.00		

GSX TECHEDU INC- ADR	1,000	91.12	91,120.00
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,700	40.53	68,901.00
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,750	151.72	265,510.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	4,600	75.05	345,230.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	4,750	52.17	247,807.50
58.COM INC-ADR	1,160	55.66	64,565.60
AUTOHOME INC-ADR	720	91.63	65,973.60
BAIDU INC - SPON ADR	3,250	121.88	396,110.00
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,500	43.95	65,925.00
HUYA INC-ADR	900	26.51	23,859.00
IQIYI INC-ADR	2,900	22.31	64,699.00
JOYY INC	720	80.95	58,284.00
MOMO INC-SPON ADR	1,950	14.55	28,372.50
NETEASE INC-ADR	982	465.45	457,071.90
SINA CORP	630	40.07	25,244.10
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,600	15.98	73,508.00
WEIBO CORP-SPON ADR	630	35.15	22,144.50
YANDEX NV-A	3,700	62.58	231,546.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	22,430	274.10	6,148,063.00
BAOZUN INC-SPN ADR	500	37.69	18,845.00
JD.COM INC-ADR	10,220	76.59	782,749.80
PINDUODUO INC-ADR	3,300	85.28	281,424.00
TRIP.COM GROUP LTD	5,750	29.41	169,107.50
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	5,500	16.76	92,180.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,288	14.64	62,776.32
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,456	35.02	50,989.12
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	900	34.26	30,834.00
ZAI LAB LTD-ADR	700	77.42	54,194.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	18,976	4.26	80,837.76
CREDICORP LTD	844	129.72	109,483.68
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	32,945	12.01	395,669.45
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.89	19,847.59
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	28.09	14,045.00
KE HOLDINGS INC	1,200	52.71	63,252.00
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.83	8,366.40

	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,000	75.50	75,500.00	
	GLOBALANT SA	440	173.74	76,445.60	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,500	8.89	48,895.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	7.10	6,177.00	
	米ドル 小計	350,605		13,250,907.02	(1,401,150,908)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	189,600	8.30	1,573,680.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	38,300	58.69	2,247,827.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	332.15	614,477.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	36.77	522,134.00	
	ALFA S.A.B.-A	34,600	13.68	473,328.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	43.86	149,124.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,100	160.21	817,071.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,070	245.38	507,936.60	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	164.32	451,880.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	26,000	28.65	744,900.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	65.96	145,112.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	64,400	50.87	3,276,028.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	96.79	464,592.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	42.08	223,024.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	5,600	86.63	485,128.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	23,700	118.99	2,820,063.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,855	245.32	700,388.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	20,400	40.10	818,040.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	34.89	575,685.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	31,700	77.56	2,458,652.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	30,800	14.82	456,456.00		
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	405,600	14.21	5,763,576.00		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	61.76	382,912.00		
	メキシコペソ 小計	937,925		26,672,014.70	(133,626,793)
ブラジルリアル	COSAN SA	2,000	74.24	148,480.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	44,700	21.82	975,354.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	57,200	21.68	1,240,096.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,600	22.35	169,860.00	

BRASKEM SA-PREF A	2,300	21.99	50,577.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	16.20	118,260.00	
GERDAU SA-PREF	11,500	20.28	233,220.00	
KLABIN SA - UNIT	7,400	24.75	183,150.00	
SUZANO SA	6,807	46.12	313,938.84	
VALE SA	44,400	61.91	2,748,804.00	
WEG SA	10,550	63.33	668,131.50	
CCR SA	13,400	14.84	198,856.00	
LOCALIZA RENT A CAR	8,010	52.83	423,168.30	
RUMO SA	17,100	21.49	367,479.00	
COGNA EDUCACAO	18,400	5.98	110,032.00	
B2W CIA DIGITAL	2,800	100.47	281,316.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	11,200	31.15	348,880.00	
LOJAS RENNER S.A.	9,800	44.98	440,804.00	
MAGAZINE LUIZA SA	8,900	90.30	803,670.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	9,600	22.25	213,600.00	
VIA VAREJO SA	15,900	18.37	292,083.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.58	61,740.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	73.89	125,613.00	
RAIA DROGASIL SA	2,800	113.93	319,004.00	
AMBEV SA	57,300	12.57	720,261.00	
BRF SA	5,900	20.74	122,366.00	
JBS SA	13,600	23.21	315,656.00	
NATURA &CO HOLDING SA	9,600	53.26	511,296.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,400	66.02	158,448.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,000	73.00	438,000.00	
HYPERA SA	4,000	31.24	124,960.00	
BANCO BRADESCO S.A.	13,720	19.16	262,875.20	
BANCO BRADESCO SA-PREF	53,590	20.70	1,109,313.00	
BANCO DO BRASIL S.A.	10,700	32.36	346,252.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	28.63	125,972.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	58,400	24.05	1,404,520.00	
ITAUSA SA	54,000	9.38	506,520.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	25,200	58.73	1,479,996.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	81.48	211,848.00	



	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,300	25.86	188,778.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	12,600	6.12	77,112.00	
	PORTO SEGURO SA	700	51.74	36,218.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	3,100	41.88	129,828.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	22.70	49,940.00	
	CIELO SA	11,700	4.75	55,575.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	5,600	47.75	267,400.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,000	14.52	130,680.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	35.42	120,428.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,200	34.37	109,984.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,619	10.82	114,897.58	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	64.56	71,016.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,600	47.65	171,540.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	30.05	69,115.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	45.04	90,080.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	43.28	98,462.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,900	23.24	276,556.00	
	ブラジルリアル 小計	738,371		20,732,009.42	(415,676,788)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,205	5,460.00	22,959,300.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	1,555.10	23,051,247.30	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,512	25,300.00	38,253,600.00	
	FALABELLA SA	6,932	2,341.30	16,229,891.60	
	CENCOSUD SA	18,824	1,190.00	22,400,560.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,201.00	9,023,735.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,790.00	5,101,500.00	
	BANCO DE CHILE	601,649	62.45	37,572,980.05	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	594	24,250.00	14,404,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	716,617	28.35	20,316,091.95	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,214.70	6,322,513.50	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,858	4,660.00	8,658,280.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	227.50	4,096,365.00	
	COLBUN SA	83,944	128.00	10,744,832.00	
	ENEL AMERICAS SA	443,665	114.00	50,577,810.00	
	ENEL CHILE SA	369,172	54.15	19,990,663.80	

	チリペソ 小計	2,291,591		309,703,870.20 (42,863,015)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	49,667	2,010.00	99,830,670.00
	BANCOLOMBIA SA	2,542	25,600.00	65,075,200.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,980	25,600.00	153,088,000.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	22,760.00	58,902,880.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,890	20,100.00	98,289,000.00
	コロンビアペソ 小計	65,667		475,185,750.00 (13,590,312)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	11.38	8,921.92
	OPAP SA	2,135	8.60	18,361.00
	JUMBO SA	1,515	16.00	24,240.00
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,534	13.60	34,462.40
	ユーロ 小計	6,968		85,985.32 (10,790,297)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	3,050	19.33	58,971.75
	英ポンド 小計	3,050		58,971.75 (8,006,594)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	81.35	142,769.25
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,119	9.15	147,488.85
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	16.73	132,334.30
	KOC HOLDING AS	8,691	14.85	129,061.35
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	10.88	59,840.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	86.50	45,931.50
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,969	70.30	419,620.70
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	20.80	39,936.00
	AKBANK T.A.S.	43,035	4.89	210,441.15
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	6.78	215,068.38
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	5.03	60,863.00
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.04	60,408.48
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	7.91	95,386.69
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,983	14.23	170,518.09
	トルコリラ 小計	188,905		1,929,667.74 (27,246,908)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	521.00	390,229.00

	MONETA MONEY BANK AS	7,045	53.30	375,498.50	
	CEZ AS	2,147	449.50	965,076.50	
	チェココルナ 小計	9,941		1,730,804.00	(8,152,086)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	1,647.00	8,941,563.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,497	6,965.00	10,426,605.00	
	OTP BANK PLC	2,819	10,700.00	30,163,300.00	
	ハンガリーフォリント 小計	9,745		49,531,468.00	(17,385,545)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	682	37.81	25,786.42	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,010	48.91	196,129.10	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	19,031	5.27	100,331.43	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,815	136.85	248,382.75	
	LPP SA	14	6,800.00	95,200.00	
	CD PROJEKT SA	857	417.30	357,626.10	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	26.68	85,162.56	
	DINO POLSKA SA	528	221.00	116,688.00	
	BANK PEKAO SA	1,997	52.18	104,203.46	
	MBANK SA	165	184.00	30,360.00	
	PKO BANK POLSKI SA	11,255	21.91	246,597.05	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	149.90	39,723.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,829	27.50	215,297.50	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.99	32,869.50	
PGE SA	9,929	5.61	55,701.69		
	ポーランドズロチ 小計	66,268		1,950,059.06	(54,913,663)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	5.50	66,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	302,000	3.37	1,017,740.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	43,000	13.26	570,180.00	
	CNOOC LTD	219,000	8.09	1,771,710.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.44	34,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	268,000	2.49	667,320.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	5.86	82,040.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	1.81	54,300.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	15,500	56.90	881,950.00	

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	26,000	4.99	129,740.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	2.94	141,120.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	10.84	520,320.00	
CHINA RESOURCES CEMENT	28,000	11.82	330,960.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.60	144,000.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	4.80	48,000.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	9.69	193,800.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	1.51	51,340.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	9.63	125,190.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	74,000	5.59	413,660.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	4.47	116,220.00	
BOC AVIATION LTD	2,200	60.00	132,000.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	60,000	4.11	246,600.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	4.98	139,440.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	34.95	733,950.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	14.70	191,100.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	23,500	5.59	131,365.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	3.84	168,960.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	6.07	182,100.00	
CITIC LTD	77,000	6.64	511,280.00	
CRRCC CORP LTD - H	51,000	3.21	163,710.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	34,500	8.46	291,870.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	18.68	149,440.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	2.31	46,200.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	11.38	45,520.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	3.28	57,400.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	20.15	161,200.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	26,000	14.74	383,240.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	6.93	41,580.00	
ZHUZHOU CRRCC TIMES ELECTRI-H	6,700	26.00	174,200.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	7.71	151,116.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	4,750	37.75	179,312.50	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	4.50	184,500.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	17,000	51.85	881,450.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	9.28	185,600.00	

AIR CHINA LTD-H	18,000	5.72	102,960.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.12	102,400.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	3.61	50,540.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	8.71	156,780.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.71	122,460.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	39,000	3.59	140,010.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	4.36	78,480.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	8.48	101,760.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	7.32	29,280.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15,500	12.74	197,470.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	5.58	100,440.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	3.55	44,375.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	6.82	231,880.00	
BYD CO LTD-H	8,000	86.40	691,200.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	5.15	164,800.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	26.10	135,720.00	
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	72,000	15.96	1,149,120.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	9.56	334,600.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	40,000	6.71	268,400.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	13,000	76.55	995,150.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	2.05	49,200.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	14,000	26.30	368,200.00	
LI NING CO LTD	26,500	33.25	881,125.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	10,300	127.10	1,309,130.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	17.58	105,480.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	11,000	14.48	159,280.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	6.86	82,320.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10,000	56.35	563,500.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	35.60	89,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.14	159,600.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,200	56.70	238,140.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	68,500	529.50	36,270,750.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	1.02	141,780.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	42,600	244.60	10,419,960.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	13.88	116,592.00	

TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	9.65	135,100.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	49.60	297,600.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	9.33	293,895.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	89.55	98,505.00	
CHINA FEIHE LTD	16,000	17.28	276,480.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	34,000	36.95	1,256,300.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	18,000	49.90	898,200.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.73	144,265.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	14.80	384,800.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	64.45	386,700.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	7.25	108,750.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	5.40	286,200.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	113.50	681,000.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	7,000	57.40	401,800.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	25.60	102,400.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	19.60	78,400.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	38,000	18.76	712,880.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	4,700	112.40	528,280.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	17.30	553,600.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	13.46	152,098.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	17,600	18.62	327,712.00	
3SBIO INC	13,000	8.47	110,110.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	177.50	106,500.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	9.20	147,200.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.14	45,540.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.37	80,880.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	70,000	15.62	1,093,400.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	13.84	138,400.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	14,000	36.95	517,300.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	12,000	57.25	687,000.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	4.73	82,775.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	31.65	189,900.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	129,250	8.87	1,146,447.50	
SSY GROUP LTD	10,000	4.67	46,700.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	3,624	107.50	389,580.00	

WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	12,500	187.00	2,337,500.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	340,000	2.53	860,200.00	
BANK OF CHINA LTD-H	959,000	2.54	2,435,860.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	111,000	3.94	437,340.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	115,000	3.17	364,550.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,153,000	5.35	6,168,550.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.68	125,960.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	47,500	38.05	1,807,375.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	4.51	338,701.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.13	56,340.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	731,000	4.27	3,121,370.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	3.50	437,500.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.46	153,300.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	11.34	158,760.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	41,000	4.18	171,380.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.82	84,460.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,600	17.36	305,536.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,500	17.18	489,630.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	6.95	201,550.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	9.53	148,668.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	11.20	85,120.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	30,400	6.69	203,376.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	12.46	216,804.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	90,000	18.22	1,639,800.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	34,400	22.35	768,840.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.79	43,450.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	17,800	12.12	215,736.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	10,700	30.00	321,000.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	92,000	2.43	223,560.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	86,000	5.87	504,820.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	71,500	81.65	5,837,975.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	5,200	45.70	237,640.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	10.62	191,160.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	8.40	117,600.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	16.08	385,920.00	

CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	74,000	4.72	349,280.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	47,500	21.20	1,007,000.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	6.80	102,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	40,000	34.85	1,394,000.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	24.05	531,505.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	6.06	254,520.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	96,000	9.66	927,360.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	15,200	9.64	146,528.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	4.29	158,730.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	13.44	188,160.00	
LOGAN GROUP CO LTD	19,000	12.76	242,440.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	22,500	41.40	931,500.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	66.55	79,860.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	6.60	158,400.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.40	57,600.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	16,000	33.10	529,600.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	1.74	40,020.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	2.28	27,360.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	32,000	31.60	1,011,200.00	
WHARF HOLDINGS LTD	20,000	14.18	283,600.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	104,000	1.49	154,960.00	
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	14,000	3.51	49,140.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.72	56,640.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	29,000	18.32	531,280.00	
KINGSOFT CORP LTD	10,000	39.75	397,500.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	17.28	224,640.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,500	46.85	445,075.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	9,000	40.00	360,000.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	2.89	43,350.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	9,500	26.35	250,325.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	10.48	172,920.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	10.54	35,836.00	
LENOVO GROUP LTD	92,000	5.21	479,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	8,900	123.70	1,100,930.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	128,400	23.55	3,023,820.00	



	ZTE CORP-H	8,800	18.96	166,848.00	
	CHINA MOBILE LTD	74,000	53.80	3,981,200.00	
	CHINA TELECOM CORP LTD-H	168,000	2.56	430,080.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	548,000	1.47	805,560.00	
	CHINA UNICOM HONG KONG LTD	78,000	5.69	443,820.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	24.40	146,400.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.10	179,800.00	
	CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.62	178,200.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	33,000	21.85	721,050.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	38,000	4.82	183,160.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.52	89,680.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	36.65	439,800.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	8.86	230,360.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	9,900	87.20	863,280.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	38,000	12.86	488,680.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	3.07	159,640.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	52,000	5.29	275,080.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	23.85	119,250.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	44,500	19.16	852,620.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	9.68	503,360.00	
	香港ドル 小計	10,728,824		140,133,301.00 (1,911,418,225)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	50,000	3.68	184,000.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	20.40	59,160.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	30,700	5.60	171,920.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	5.22	87,174.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.41	71,610.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	7.25	55,100.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.28	75,468.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.15	66,435.00	
	MISC BHD	17,600	7.62	134,112.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.85	26,180.00	
	GENTING BHD	23,100	3.42	79,002.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.15	70,090.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	20.60	20,600.00	

	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	32.50	68,250.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.90	29,700.00	
	IOI CORP BHD	32,500	4.45	144,625.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,700	22.32	104,904.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	700	140.00	98,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	8,220	18.52	152,234.40	
	QL RESOURCES BHD	7,100	9.70	68,870.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	22,400	5.05	113,120.00	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	20,800	13.00	270,400.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.30	127,730.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	8,300	11.10	92,130.00	
	SUPERMAX CORP BHD	18,800	9.00	169,200.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	57,300	8.58	491,634.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	3.03	70,902.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	80,200	3.15	252,630.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	14.80	106,560.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	13.68	24,624.00	
	MALAYAN BANKING BHD	48,400	7.28	352,352.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	35,400	16.04	567,816.00	
	RHB BANK BHD	18,100	4.63	83,803.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.07	93,328.00	
	DIGI.COM BHD	39,700	4.15	164,755.00	
	MAXIS BHD	30,200	5.07	153,114.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	4.21	34,101.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,400	16.68	173,472.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	29,400	11.18	328,692.00	
	YTL CORP BHD	19,380	0.65	12,693.90	
	マレーシアリングット 小計	848,100		5,450,491.30 (139,151,042)	
タイパーツ	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.16	297,432.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,000	82.75	1,241,250.00	
	PTT PCL-NVDR	140,400	35.00	4,914,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	37.50	495,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	23.00	379,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	25,000	42.50	1,062,500.00	

SIAM CEMENT PCL-NVDR	9,600	346.00	3,321,600.00
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	54,600	58.00	3,166,800.00
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	9.00	805,500.00
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	10.00	1,055,000.00
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	3.90	242,580.00
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	35,100	21.80	765,180.00
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	26.50	546,562.50
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	64,600	13.90	897,940.00
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	37.25	614,625.00
CP ALL PCL-NVDR	71,400	62.50	4,462,500.00
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	41,700	29.00	1,209,300.00
OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	37.25	242,125.00
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	13.90	336,380.00
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	119,000	20.40	2,427,600.00
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	107.50	645,000.00
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	102.50	799,500.00
KASIKORNBANK PCL-NVDR	21,300	80.75	1,719,975.00
KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	9.40	235,000.00
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	69.50	688,050.00
TMB BANK PCL-NVDR	215,000	0.91	195,650.00
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	21.30	389,790.00
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	31.50	258,300.00
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	48.00	364,800.00
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	45.75	411,750.00
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	44.50	1,308,300.00
LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	7.30	703,720.00
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	14,800	181.50	2,686,200.00
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	54.50	1,558,700.00
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	9,700	34.00	329,800.00
TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.24	275,724.00
B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	45.00	427,500.00
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	202.00	808,000.00
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	41.00	733,900.00
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	63.50	463,550.00
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	32,200	31.25	1,006,250.00

	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	53.25	596,400.00	
	タイパーツ 小計	1,743,025		45,089,233.50 (152,401,609)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	47.80	1,116,608.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	700.00	2,653,000.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	403.00	282,100.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	38,220	62.90	2,404,038.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,185	915.00	2,914,275.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	108.50	1,269,450.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	135.00	607,500.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	48.55	461,225.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,750	142.00	1,384,500.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	64.60	428,298.00	
	BDO UNIBANK INC	21,220	89.50	1,899,190.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	34.90	464,588.80	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.52	510,400.00	
	AYALA LAND INC	105,400	31.30	3,299,020.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	3.16	309,680.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	14.86	364,070.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	128,800	28.85	3,715,880.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,126.00	956,700.00	
	PLDT INC	980	1,455.00	1,425,900.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	27.00	432,000.00	
MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	273.00	857,220.00		
	フィリピンペソ 小計	668,137		27,755,642.80 (60,507,301)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,200.00	181,080,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	23,000.00	508,300,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	815.00	307,662,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	8,725.00	234,702,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	11,325.00	150,622,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	9,850.00	317,170,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	250,800	4,790.00	1,201,332,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,580.00	79,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	78,300	6,200.00	485,460,000.00	

	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	46,300.00	305,580,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,630.00	148,493,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	10,550.00	344,985,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	7,800.00	375,960,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	8,200.00	825,740,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,590.00	360,135,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	119,200	30,250.00	3,605,800,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	230,800	5,750.00	1,327,100,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	78,800	5,050.00	397,940,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	676,200	3,440.00	2,326,128,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	607,400	2,890.00	1,755,386,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	2,270.00	63,560,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,145.00	150,567,500.00	
	インドネシアルピア 小計	3,379,700		15,452,704,000.00 (109,714,198)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	33,650.00	16,488,500.00	
	S-OIL CORP	483	55,900.00	26,999,700.00	
	SK INNOVATION CO LTD	677	157,000.00	106,289,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,199	44,700.00	53,595,300.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	25,050.00	19,714,350.00	
	KOREA ZINC CO LTD	93	405,000.00	37,665,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	104,500.00	22,781,000.00	
	LG CHEM LTD	552	712,000.00	393,024,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	354,000.00	31,152,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	188	217,000.00	40,796,000.00	
	POSCO	898	190,000.00	170,620,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	286	87,800.00	25,110,800.00	
	CJ CORP	193	82,200.00	15,864,600.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	313	85,100.00	26,636,300.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	25,050.00	12,875,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	27,250.00	15,805,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	25,600.00	21,478,400.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	32,700.00	28,383,600.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	234,500.00	25,795,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	23,400.00	23,400,000.00	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	393	87,300.00	34,308,900.00	
LG CORP	1,224	78,200.00	95,716,800.00	
LOTTE CORP	242	30,950.00	7,489,900.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	500	14,050.00	7,025,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,073	114,000.00	122,322,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	11,350.00	18,205,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,232	5,540.00	28,985,280.00	
SK HOLDINGS CO LTD	454	211,500.00	96,021,000.00	
S-1 CORPORATION	228	88,600.00	20,200,800.00	
CJ LOGISTICS	135	158,000.00	21,330,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	149,000.00	32,631,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	18,650.00	17,810,750.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	3,490.00	11,436,730.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	33,350.00	32,216,100.00	
HANON SYSTEMS	2,393	12,600.00	30,151,800.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	805	232,500.00	187,162,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,800	180,000.00	324,000,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	464	87,400.00	40,553,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	86,800.00	14,756,000.00	
KIA MOTORS CORP	3,201	44,400.00	142,124,400.00	
COWAY CO LTD	531	79,900.00	42,426,900.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	37,400.00	24,459,600.00	
HLB INC	571	108,800.00	62,124,800.00	
LG ELECTRONICS INC	1,352	92,100.00	124,519,200.00	
KANGWON LAND INC	1,387	21,250.00	29,473,750.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	499	19,250.00	9,605,750.00	
KAKAO CORP	682	373,500.00	254,727,000.00	
NAVER CORP	1,478	303,000.00	447,834,000.00	
NCSOFT CORP	199	830,000.00	165,170,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	181,500.00	49,186,500.00	
PEARL ABYSS CORP	70	199,900.00	13,993,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	134,300.00	15,175,900.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	75,100.00	30,565,700.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	81,100.00	6,488,000.00	
SHINSEGAE INC	54	215,500.00	11,637,000.00	

BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	121,500.00	6,925,500.00
E-MART INC	257	150,000.00	38,550,000.00
GS RETAIL CO., LTD.	195	33,600.00	6,552,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	88	392,000.00	34,496,000.00
KT&G CORP	1,420	84,600.00	120,132,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	138,000.00	34,638,000.00
OTTOGI CORPORATION	13	590,000.00	7,670,000.00
AMOREPACIFIC CORP	422	168,000.00	70,896,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	209	51,800.00	10,826,200.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	116	1,519,000.00	176,204,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	728,000.00	10,920,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	836	99,200.00	82,931,200.00
ALTEOGEN INC	240	201,700.00	48,408,000.00
CELLTRION INC	1,146	296,000.00	339,216,000.00
CELLTRION PHARM INC	150	119,200.00	17,880,000.00
HANMI PHARM CO LTD	86	293,000.00	25,198,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	207	763,000.00	157,941,000.00
SEEGENE INC	240	250,000.00	60,000,000.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	146,500.00	58,600,000.00
YUHAN CORP	514	65,700.00	33,769,800.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	5,150.00	13,106,750.00
HANA FINANCIAL GROUP	3,664	28,700.00	105,156,800.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	8,200.00	21,246,200.00
KB FINANCIAL GROUP INC	4,777	38,300.00	182,959,100.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,544	28,750.00	159,390,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	5,693	8,530.00	48,561,290.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	557	78,100.00	43,501,700.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,270.00	7,576,590.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	9,330.00	27,962,010.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	9,370.00	14,429,800.00
SAMSUNG CARD CO	217	28,850.00	6,260,450.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	31,950.00	26,326,800.00
DB INSURANCE CO LTD	482	46,100.00	22,220,200.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	23,050.00	10,395,550.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	381	189,000.00	72,009,000.00

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	752	65,900.00	49,556,800.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	190	118,000.00	22,420,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	430	181,000.00	77,830,000.00	
	KMW CO LTD	357	85,800.00	30,630,600.00	
	LG DISPLAY CO LTD	2,534	16,600.00	42,064,400.00	
	LG INNOTEK CO LTD	153	170,000.00	26,010,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	724	144,500.00	104,618,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	57,181	60,400.00	3,453,732,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	9,959	51,900.00	516,872,100.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	664	436,000.00	289,504,000.00	
	LG UPLUS CORP	2,330	12,100.00	28,193,000.00	
	SK TELECOM	482	248,000.00	119,536,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,411	20,600.00	70,266,600.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	23,700.00	5,332,500.00	
	SK HYNIX INC	6,610	80,000.00	528,800,000.00	
	韓国ウォン 小計	171,503		11,154,531,650.00 (998,330,582)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	15,000	82.30	1,234,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	42.90	943,800.00	
	CHINA STEEL CORP	150,000	20.95	3,142,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	45,000	68.30	3,073,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	47,000	79.20	3,722,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	64,000	61.00	3,904,000.00	
	TAIWAN CEMENT	61,477	42.95	2,640,437.15	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	667.00	667,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	26.50	1,033,500.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,174	321.50	1,020,441.00	
	EVA AIRWAYS CORP	26,023	11.35	295,361.05	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	16.50	520,575.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	32.05	705,100.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	22,000	37.80	831,600.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	373.50	754,470.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	4,080	170.50	695,640.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	32.50	325,000.00	
	GIANT MANUFACTURING	3,000	283.50	850,500.00	



NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	332.00	664,000.00
POU CHEN	24,000	26.95	646,800.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	637.00	2,548,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	266.50	1,599,000.00
STANDARD FOODS CORP	3,120	63.90	199,368.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	60,000	66.80	4,008,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	53,616	17.90	959,726.40
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	218,000	18.80	4,098,400.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	140,906	26.60	3,748,099.60
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	130,627	20.90	2,730,104.30
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	107,416	18.10	1,944,229.60
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	135,000	28.65	3,867,750.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	102,995	10.90	1,122,645.50
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	118,769	13.10	1,555,873.90
TAIWAN BUSINESS BANK	44,672	9.89	441,806.08
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	118,374	19.95	2,361,561.30
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	40.90	1,431,500.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,997	130.00	2,079,610.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	125,920	18.25	2,298,040.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	99,000	40.10	3,969,900.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	129,000	8.77	1,131,330.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	20.35	535,612.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	84,000	43.65	3,666,600.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	111,835	8.63	965,136.05
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	46.35	278,100.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	41.55	393,894.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	218.50	1,529,500.00
ACER INC	38,000	25.10	953,800.00
ADVANTECH CO LTD	5,299	288.00	1,526,112.00
ASUSTEK COMPUTER INC	9,000	256.00	2,304,000.00
AU OPTRONICS CORP	86,000	12.20	1,049,200.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	190.00	1,710,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	88.00	441,320.00
COMPAL ELECTRONICS	46,000	19.15	880,900.00
DELTA ELECTRONICS INC	24,000	189.00	4,536,000.00

FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	52.80	369,600.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	151,800	79.40	12,052,920.00	
INNOLUX CORP	90,000	10.15	913,500.00	
INVENTEC CORP	28,000	22.80	638,400.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,655.00	3,655,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	27,000	47.00	1,269,000.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	137.50	962,500.00	
PEGATRON CORP	26,000	63.80	1,658,800.00	
QUANTA COMPUTER INC	37,000	78.10	2,889,700.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	42.75	726,750.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	165.00	495,000.00	
WISTRON CORP	29,951	30.10	901,525.10	
WIWYNN CORP	1,000	680.00	680,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	17,960	39.95	717,502.00	
YAGEO CORPORATION	4,198	358.50	1,504,983.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	129.00	774,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	47,000	109.00	5,123,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	62.70	1,065,900.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	21,000	100.50	2,110,500.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	61.60	2,525,600.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	391.50	1,174,500.00	
MEDIATEK INC	18,000	609.00	10,962,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	54.80	657,600.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	250.50	1,753,500.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	282.00	282,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	89.80	898,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	372.00	2,232,000.00	
SILERGY CORP	1,000	1,765.00	1,765,000.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	294,000	441.00	129,654,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	146,000	23.90	3,489,400.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	97.90	1,174,800.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	297.00	1,188,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	13.60	299,200.00	
新台湾ドル 小計	3,825,594		287,100,423.03 (1,036,432,527)	

インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	8,598	417.15	3,586,655.70	
	COAL INDIA LTD	16,101	124.95	2,011,819.95	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	196.05	1,590,357.60	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	82.70	2,023,999.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	73.65	1,950,988.50	
	PETRONET LNG LTD	7,875	236.70	1,864,012.50	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	34,133	2,302.55	78,592,939.15	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	211.10	1,633,914.00	
	ASIAN PAINTS LTD	3,540	2,031.20	7,190,448.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	577.85	1,524,946.15	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	707.00	2,285,024.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	12,818	175.80	2,253,404.40	
	JSW STEEL LTD	9,306	289.85	2,697,344.10	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,597	1,480.70	2,364,677.90	
	SHREE CEMENT LTD	113	19,789.50	2,236,213.50	
	TATA STEEL LTD	3,946	404.65	1,596,748.90	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,426	3,914.10	5,581,506.60	
	UPL LTD	5,324	515.90	2,746,651.60	
	VEDANTA LTD	19,986	129.65	2,591,184.90	
	HAVELLS INDIA LTD	2,780	669.05	1,859,959.00	
	LARSEN & TOUBRO LTD	6,199	902.10	5,592,117.90	
	SIEMENS LTD	766	1,235.50	946,393.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,672	351.65	2,346,208.80	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	384.20	600,120.40	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,321.15	1,716,173.85	
	BAJAJ AUTO LTD	881	2,957.70	2,605,733.70	
	BHARAT FORGE LTD	3,030	475.60	1,441,068.00	
	BOSCH LTD	73	12,853.55	938,309.15	
	EICHER MOTORS LTD	1,400	2,159.40	3,023,160.00	
	HERO MOTOCORP LTD	1,227	3,028.50	3,715,969.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA LTD	9,194	615.30	5,657,068.20	
	MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,468	7,128.85	10,465,151.80	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	12,820	116.35	1,491,607.00		
TATA MOTORS LTD	18,122	148.55	2,692,023.10		
PAGE INDUSTRIES LTD	54	19,148.75	1,034,032.50		

TITAN CO LTD	4,082	1,188.00	4,849,416.00
JUBILANT FOODWORKS LTD	681	2,347.35	1,598,545.35
INFO EDGE INDIA LTD	655	3,434.10	2,249,335.50
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	216.20	2,014,335.40
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,002	2,162.70	4,329,725.40
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	626	3,719.50	2,328,407.00
ITC LTD	35,192	183.35	6,452,453.20
NESTLE INDIA LTD	287	16,083.30	4,615,907.10
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	5,490	546.50	3,000,285.00
UNITED SPIRITS LTD	3,058	546.65	1,671,655.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,416.60	991,620.00
DABUR INDIA LTD	5,557	504.20	2,801,839.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	691.55	3,720,539.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,021	2,123.50	21,279,593.50
MARICO LTD	4,834	370.55	1,791,238.70
AUROBINDO PHARMA LTD	3,700	796.15	2,945,755.00
BIOCON LTD	2,750	430.00	1,182,500.00
CIPLA LTD	3,668	721.60	2,646,828.80
DIVI'S LABORATORIES LTD	854	3,164.80	2,702,739.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,471	4,364.10	6,419,591.10
LUPIN LTD	2,363	968.00	2,287,384.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,198	1,322.80	1,584,714.40
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,895	495.80	5,401,741.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,797.55	1,342,824.00
AXIS BANK LTD	27,430	440.55	12,084,286.50
BANDHAN BANK LTD	7,394	301.40	2,228,551.60
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	19,738	1,738.00	34,304,644.00
ICICI BANK LTD	61,367	363.70	22,319,177.90
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	302.65	704,266.55
STATE BANK OF INDIA	22,200	198.50	4,406,700.00
BAJAJ FINANCE LTD	2,285	3,440.70	7,861,999.50
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,350.00	1,668,500.00
REC LTD	7,000	107.25	750,750.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	636.45	416,238.30
BAJAJ FINSERV LTD	402	6,112.15	2,457,084.30

	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,748	599.45	5,243,988.60	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,586	1,305.35	3,375,635.10	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	430.35	1,603,914.45	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,992	857.10	4,278,643.20	
	DLF LTD	4,542	155.70	707,189.40	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	13,207	794.95	10,498,904.65	
	INFOSYS LTD	40,855	978.40	39,972,532.00	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,828	2,491.40	26,976,879.20	
	TECH MAHINDRA LTD	5,777	790.75	4,568,162.75	
	WIPRO LTD	14,289	307.20	4,389,580.80	
	BHARTI AIRTEL LTD	15,312	474.10	7,259,419.20	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	202.60	486,240.00	
	GAIL INDIA LTD	17,471	91.95	1,606,458.45	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	2,160	408.80	883,008.00	
	NTPC LTD	25,698	90.85	2,334,663.30	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	23,917	171.50	4,101,765.50	
	インドルピー 小計	728,274		470,146,090.15 (681,711,830)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	17.76	113,664.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.12	103,275.00	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	10.30	246,303.90	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	3.91	85,125.12	
	MASRAF AL RAYAN	44,940	4.15	186,545.94	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	8.40	78,775.20	
	QATAR ISLAMIC BANK	12,416	15.92	197,662.72	
	QATAR NATIONAL BANK	55,167	17.65	973,697.55	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.60	89,102.19	
	OOREDOO QPSC	5,987	6.50	38,915.50	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,015	16.61	99,909.15	
	カタールリアル 小計	259,306		2,212,976.27 (64,021,403)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	134.29	376,012.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	677	1,312.83	888,785.91	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,057	494.67	2,501,546.19	
	GOLD FIELDS LTD	10,740	233.80	2,511,012.00	

HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	103.06	710,598.70
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	9,799	175.99	1,724,526.01
KUMBA IRON ORE LTD	703	547.61	384,969.83
NORTHAM PLATINUM LTD	3,813	182.48	695,796.24
SASOL LTD	7,017	133.70	938,172.90
SIBANYE STILLWATER LTD	27,980	54.22	1,517,075.60
BIDVEST GROUP LTD	2,876	152.24	437,842.24
MULTICHOICE GROUP LTD	4,613	87.67	404,421.71
MR PRICE GROUP LTD	2,802	133.27	373,422.54
NASPERS LTD-N SHS	5,210	2,958.00	15,411,180.00
PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	11.70	116,426.70
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,960	35.53	460,468.80
BID CORP LTD	4,319	272.00	1,174,768.00
CLICKS GROUP LTD	2,589	236.23	611,599.47
SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,519	149.88	977,067.72
SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	182.17	462,893.97
TIGER BRANDS LTD	2,099	188.87	396,438.13
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	17.15	218,885.45
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,174	128.24	663,513.76
ABSA GROUP LTD	7,463	89.73	669,654.99
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	766	971.12	743,877.92
NEDBANK GROUP LTD	3,923	103.08	404,382.84
STANDARD BANK GROUP LTD	15,779	116.00	1,830,364.00
FIRSTRAND LTD	59,593	40.25	2,398,618.25
REINET INVESTMENTS SCA	1,613	294.35	474,786.55
REMGRO LTD	7,030	88.67	623,350.10
DISCOVERY LTD	4,144	133.46	553,058.24
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	15.60	157,279.20
OLD MUTUAL LTD	59,174	10.65	630,203.10
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	31.00	310,434.00
SANLAM LTD	21,916	54.50	1,194,422.00
NEPI ROCKCASTLE PLC	4,282	70.25	300,810.50
MTN GROUP LTD	20,781	57.15	1,187,634.15
VODACOM GROUP LTD	7,934	125.04	992,067.36
	384,391		46,428,367.07

	南アフリカランド 小計			(294,355,847)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	33,706	5.54	186,731.24	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	4.31	88,096.40	
	EMIRATES NBD PJSC	30,421	10.85	330,067.85	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	32,831	11.38	373,616.78	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	51,017	2.06	105,095.02	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.43	43,863.82	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	36,755	2.91	106,957.05	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,250	16.52	351,050.00	
	アラブディルハム 小計	257,094		1,585,478.16	(45,566,642)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.01	12,020.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	3.92	46,256.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	16.06	24,090.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.83	3,113.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.63	2,315.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.26	21,726.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	8.47	21,175.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.17	1,851.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.75	24,975.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	520	4.17	2,168.40	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	29.33	26,397.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.12	9,037.92	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.06	6,426.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.68	2,090.40	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	59.19	165,732.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	5.02	40,160.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.20	2,880.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	55.00	66,000.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	14.50	42,050.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.03	27,404.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	11.61	5,805.00		
GEM CO LTD-A	3,500	5.22	18,270.00		
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	6.39	8,946.00		
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	48.53	24,265.00		

HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	19.02	68,852.40
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	11.64	22,698.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.22	3,330.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	25.77	28,347.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.07	17,745.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.19	21,301.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	7.17	25,095.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	13.14	24,966.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	88.40	26,520.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	15.27	4,581.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	49.16	9,832.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.23	2,492.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	23.98	40,766.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.79	1,953.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.16	15,552.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	18.38	62,492.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	6.90	14,490.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,568	27.05	42,414.40
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	24.53	34,342.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.45	24,500.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	39.66	31,728.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	13.80	30,360.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	105.74	31,722.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.68	17,664.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.37	2,022.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	16.69	18,359.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	20.07	4,014.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.72	22,080.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.31	3,465.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.98	7,774.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	74.08	170,384.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	72.71	29,084.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	14.44	17,328.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	15.52	26,384.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	85.42	51,252.00



ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	38.41	9,986.60
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	6.56	15,088.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	13.79	5,516.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	10.72	4,288.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	7.14	126,378.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	19.16	19,160.00
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	39.93	55,902.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	2,500	21.91	54,775.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.44	31,320.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,100	53.13	58,443.00
AVICOPTER PLC-A	500	52.80	26,400.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	32.22	45,108.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	2.83	28,300.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.18	16,514.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	16.30	1,630.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	7.60	2,280.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.00	3,000.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	14.77	13,293.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.52	2,760.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	7,400	8.59	63,566.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.47	50,324.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	10,300	4.48	46,144.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	33.72	3,372.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.03	149,894.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,900	192.78	366,282.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.25	3,375.00
CRRC CORP LTD-A	18,500	5.60	103,600.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	10.35	6,210.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	48.36	73,507.20
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.46	2,693.82
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	22.65	22,650.00
GUOCHENG MINING CO LTD-A	900	23.20	20,880.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	49.02	29,412.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	46.78	14,034.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	11.28	15,792.00

JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	71.82	74,405.52
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	11.07	28,782.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.78	5,004.00
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	900	24.13	21,717.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	20.17	71,381.63
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.90	15,600.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	22.94	142,228.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.17	17,752.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.36	4,288.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.80	1,740.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	52.01	36,407.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	15.63	20,319.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	27.65	35,945.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	10.86	4,344.00
TBEA CO LTD-A	400	8.55	3,420.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	2,700	14.35	38,745.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	5.87	6,457.00
XIAMEN C & D INC-A	300	8.88	2,664.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	10.50	4,200.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	30.68	61,360.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	100.00	42,000.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	21.46	64,165.40
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	14.50	18,850.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	14.88	2,976.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	8.07	51,648.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	9.52	24,752.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	23.88	33,432.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	68.96	55,168.00
AIR CHINA LTD-A	800	7.47	5,976.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	10,400	6.16	64,064.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	5.15	6,695.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.25	56,875.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	5.64	6,768.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.50	72,150.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	14.31	11,448.00

JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	11.55	8,085.00
S F HOLDING CO LTD-A	1,800	78.80	141,840.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	74.30	74,300.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.33	4,330.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	9.05	17,195.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.71	7,420.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	48.10	4,810.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	18.53	21,680.10
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	6.16	19,712.00
BYD CO LTD -A	800	92.50	74,000.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	155.10	31,020.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	13.61	6,805.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	31.87	6,374.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	25.87	36,218.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	21.78	26,136.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	38.30	30,640.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	19.43	134,261.30
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	24.94	2,494.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	23.52	2,352.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	6.75	13,500.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	2,700	55.28	149,256.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	22.00	125,400.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	34.65	3,465.00
JOYOUNG CO LTD -A	600	41.82	25,092.00
NAVINFO CO LTD-A	900	15.61	14,049.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	109.66	15,352.40
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	28.20	11,280.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	7.04	43,648.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	57.02	17,106.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	7.75	3,100.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	81.00	24,300.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	18.71	14,968.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	33.25	33,250.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	39.95	23,970.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.05	7,755.00

SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	18.58	20,066.40
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	16.58	21,554.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	30.71	24,568.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	14.08	2,816.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	11.04	2,208.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.16	1,216.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	7.26	87,846.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	571.90	57,190.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	19.48	3,896.00
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.15	12,915.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	66.85	87,573.50
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	18.57	20,427.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.95	2,985.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	33.33	44,995.50
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	17.94	16,146.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	41.55	37,395.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	18.86	7,544.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	10.60	31,800.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,300	214.30	278,590.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	26.72	5,344.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.07	45,350.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	9.19	30,327.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.79	28,740.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	81.20	22,736.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	99.67	41,861.40
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	8.35	25,885.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	55.46	38,822.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	236.50	70,950.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	57.47	28,735.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.52	4,760.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	69.19	41,514.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	7.47	17,928.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	61.41	24,564.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	98.23	39,292.00
CHONGQING FULING ZHACAI -A	700	45.27	31,689.00

FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,800	159.00	286,200.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	23.77	21,393.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	63.20	82,160.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	18.63	46,575.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	51.53	123,672.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	39.02	163,884.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	48.41	48,410.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,000	136.65	136,650.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	18.88	37,760.00	
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	67.09	20,127.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	78.88	23,664.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	900	1,766.00	1,589,400.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	146.44	146,440.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,940	78.13	229,702.20	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	30.71	79,846.00	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	800	211.60	169,280.00	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	66.48	26,592.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	500	55.51	27,755.00	
TONGWEI CO LTD-A	3,300	25.00	82,500.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	77.95	7,795.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	21.59	122,199.40	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,900	230.08	667,232.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	19.40	21,340.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	21.36	27,768.00	
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	21.07	21,070.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	143.53	14,353.00	
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	37.95	22,770.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,521	49.66	174,852.86	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	151.89	15,189.00	
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	47.69	9,538.00	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	42.11	16,844.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	100.90	20,180.00	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	300	84.90	25,470.00	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	24.73	5,935.20	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	68.93	26,193.40	

JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	32.53	16,265.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	16.41	3,282.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	34.07	23,849.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	15.55	7,464.00
OVCTEK CHINA INC-A	300	58.19	17,457.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	20.85	4,170.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	336.83	235,781.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	190.98	19,098.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	19.84	20,633.60
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	24.32	21,888.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	245.13	49,026.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	40.21	43,426.80
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	28.23	5,646.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	108.16	32,448.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	137.55	41,265.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	200	371.62	74,324.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	46.51	27,906.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	26.74	2,674.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,300	124.81	162,253.00
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	32.85	19,710.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	41.94	4,194.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	30.98	6,196.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	100.65	30,195.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	48.86	38,110.80
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	23.39	16,373.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	4,180	91.36	381,884.80
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	17.32	17,320.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	26.45	23,805.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	17.42	27,872.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	47.45	23,725.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	42.77	27,800.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	26.00	6,760.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	47.75	57,300.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	8.59	24,911.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	22.02	19,818.00

SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	171.20	102,720.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	36.07	3,607.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,000	25.96	25,960.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	23.40	4,680.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	6.05	13,310.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	14.82	2,964.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	53.46	32,076.00
WUXI APPTec CO LTD-A	1,440	97.60	140,544.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	26.12	26,120.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	111.00	122,100.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	300	254.00	76,200.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.45	11,990.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	36.81	44,540.10
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	30.99	55,162.20
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	57.85	23,140.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.16	158,948.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.79	89,573.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	10.51	15,765.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.21	52,323.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.62	125,664.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	12.59	6,295.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	6.31	20,192.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	8.57	76,273.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	32.75	163,750.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.35	73,563.50
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.09	3,054.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.13	18,390.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	3.72	129,828.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	15,400	37.35	575,190.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	5.45	162,410.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.23	27,412.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	4.93	178,466.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	16.12	220,844.00
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	15.30	200,430.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	9.90	192,060.00

AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.58	4,122.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	13.40	20,100.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	7.99	6,392.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	12.33	34,524.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	20.55	137,685.00
CITIC SECURITIES CO-A	8,600	30.05	258,430.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,500	51.25	128,125.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	12.47	2,494.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,920	23.61	139,771.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	22.04	70,528.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	9.52	4,760.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.18	58,896.00
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	16.00	43,200.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	13.19	60,674.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	18.35	126,615.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	9.83	4,915.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	14.32	127,448.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	150.18	75,090.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	8.13	3,252.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	20.27	111,485.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	11.83	3,549.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.16	54,672.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	13.63	21,808.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	9.78	29,340.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	10.81	56,212.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	4.10	13,120.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	3,600	14.58	52,488.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.18	12,950.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.78	3,112.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	5.27	80,104.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	14.11	4,233.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.85	2,955.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.20	19,760.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	6.32	27,176.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.37	4,685.00



ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	14.08	18,304.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	44.09	110,225.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	30.46	134,024.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.38	3,228.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	58.43	111,017.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	6.85	23,975.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	8,100	78.55	636,255.00	
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	7.05	15,510.00	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.14	14,076.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	15.84	22,651.20	
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	26.64	18,648.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	15.92	57,312.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	6,500	27.70	180,050.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.74	2,696.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	33.84	27,072.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	14.71	48,543.00	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	5.06	13,662.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.91	8,292.00	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.17	28,427.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	9.60	6,720.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	4.18	5,016.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	16.55	137,365.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	7.84	4,704.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	19.83	17,847.00	
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	5.35	13,375.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.52	4,224.00	
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	7.70	26,180.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	7.08	21,948.00	
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	3.44	17,544.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	17.68	70,720.00	
AISINO CORP-A	200	16.52	3,304.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	36.51	17,524.80	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	36.85	3,685.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	23.39	16,373.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	86.60	17,320.00	

CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	22.38	15,666.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	10.98	4,392.00
GLODON CO LTD-A	500	70.33	35,165.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	102.19	70,408.91
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	35.03	35,030.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	17.17	8,585.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	204.78	20,478.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	3.01	2,347.80
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	70.40	28,160.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	18.50	7,400.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	83.85	25,155.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	35.46	14,184.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	9.03	8,127.00
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	900	26.01	23,409.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	38.50	88,858.00
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	32.30	19,380.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	46.15	41,535.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	5.24	107,420.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	26.91	18,837.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	15.78	41,028.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	39.43	44,161.60
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	24.27	26,697.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	13.85	52,630.00
GOERTEK INC -A	2,000	42.70	85,400.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	12.69	27,918.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	11.61	29,025.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	11.93	3,579.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	98.00	49,000.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	7,500	36.50	273,750.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	14.85	2,970.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	5.27	14,756.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	12.29	11,061.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	31.10	18,660.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	35.38	45,994.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	9.08	20,884.00

LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	5,533	56.21	311,009.93	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	200	350.50	70,100.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	153.40	30,680.00	
NINESTAR CORP-A	100	30.65	3,065.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	14.94	5,976.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	23.00	23,000.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	115.71	32,398.80	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	21.11	21,110.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	59.55	53,595.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	26.99	18,893.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	44.29	31,003.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	15.05	4,515.00	
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	3.11	2,488.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	27.17	50,970.92	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	23.50	30,550.00	
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	20.09	16,072.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	122.20	85,540.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	37.85	51,476.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	18.54	29,664.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	43.31	17,324.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	58.40	17,520.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	21.27	51,048.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	51.22	25,610.00	
ZTE CORP-A	2,700	33.48	90,396.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	5.06	69,828.00	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	5.15	12,875.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.57	19,651.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,400	20.90	363,660.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.15	6,020.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.72	4,836.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	5.85	4,680.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.86	2,316.00	
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.62	12,838.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	9.41	62,106.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.58	16,676.00	

	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.65	3,955.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.42	3,252.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	10.12	7,084.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.76	16,168.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	178.03	24,924.20	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	17.47	34,940.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	72.82	189,332.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	26.98	43,168.00	
	SG MICRO CORP-A	100	284.80	28,480.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	161.80	40,450.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	21.71	49,933.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	14.26	27,094.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	22.35	17,880.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	112.05	56,025.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	13.92	15,312.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	400	191.00	76,400.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	10.38	15,570.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	30.91	27,819.00	
	オフショア人民元 小計	1,247,088		23,164,969.01	(359,983,618)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	14.26	23,201.02	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	26,704	36.05	962,679.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	61.00	71,614.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	12.50	47,275.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	16.12	56,420.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	2,572	83.20	213,990.40	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	5,424	42.45	230,248.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	10,872	88.10	957,823.20	
	SAUDI CEMENT	565	56.30	31,809.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	23.30	69,503.90	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	9.80	79,752.40	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,789	59.40	165,666.60	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	84.50	35,659.00	
	JARIR MARKETING CO	611	174.60	106,680.60	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	126.00	51,156.00	

ALMARAI CO	3,167	55.40	175,451.80	
SAVOLA	3,337	51.00	170,187.00	
AL RAJHI BANK	14,912	67.90	1,012,524.80	
ALINMA BANK	12,351	16.30	201,321.30	
ARAB NATIONAL BANK	6,307	20.50	129,293.50	
BANK AL-JAZIRA	5,356	13.50	72,306.00	
BANK ALBILAD	3,925	24.96	97,968.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	7,513	32.00	240,416.00	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	17,926	38.00	681,188.00	
RIYAD BANK	16,646	19.14	318,604.44	
SAMBA FINANCIAL GROUP	12,062	27.15	327,483.30	
SAUDI BRITISH BANK	8,978	26.10	234,325.80	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	124.80	99,840.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	82.50	54,532.50	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	8.71	34,334.82	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	10.08	43,293.60	
ETIHAD ETISALAT CO	3,984	28.40	113,145.60	
SAUDI TELECOM CO	7,265	99.20	720,688.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	9,159	16.78	153,688.02	
サウジアラビアリアル 小計	214,155		7,984,072.10 (225,390,355)	
合 計	29,124,227		8,212,388,088 (8,212,388,088)	

(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	568,447.00	
	メキシコペソ 小計		34,100	568,447.00 (2,847,919)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	31,594	392,081.54	
	南アフリカランド 小計		31,594	392,081.54 (2,485,796)	

合計		5,333,715	
		(5,333,715)	

(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 60銘柄	100.0%		17.1%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.9%		1.6%
	投資証券 1銘柄		2.1%	0.0%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.0%		5.1%
チリペソ	株式 16銘柄	100.0%		0.5%
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%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%
トルコリラ	株式 14銘柄	100.0%		0.3%
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 204銘柄	100.0%		23.3%
マレーシアリングgit	株式 40銘柄	100.0%		1.7%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%		1.9%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%		0.7%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%		1.3%
韓国ウォン	株式 105銘柄	100.0%		12.1%
新台湾ドル	株式 86銘柄	100.0%		12.6%
インドルピー	株式 86銘柄	100.0%		8.3%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式 38銘柄	99.2%		3.6%
	投資証券 1銘柄		0.8%	0.0%
アラブディルハム	株式 8銘柄	100.0%		0.6%
オフショア人民元	株式 462銘柄	100.0%		4.4%
サウジアラビアリアル	株式 34銘柄	100.0%		2.7%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

### R A M新興国債券マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）	
2020年 9月15日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	15,846,894
コール・ローン	30,056,806
投資信託受益証券	5,116,849,884
派生商品評価勘定	129,360
未収入金	28,988,385
流動資産合計	5,191,871,329
<b>資産合計</b>	
5,191,871,329	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	34,387,000
未払利息	81
流動負債合計	34,387,081
<b>負債合計</b>	
34,387,081	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	4,943,476,261
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	214,007,987
元本等合計	5,157,484,248
<b>純資産合計</b>	
5,157,484,248	
<b>負債純資産合計</b>	
5,191,871,329	

#### 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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	4,508,187,993円
期中追加設定元本額	4,074,994,243円
期中一部解約元本額	3,639,705,975円
期末元本額	4,943,476,261円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	622,478,697円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	448,737,484円
りそなラップ型ファンド(成長型)	244,781,505円
DCりそな グローバルバランス	12,260,921円
つみたてバランスファンド	408,644,195円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	174,733,884円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	87,352,741円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	53,451,550円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,028,768円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,918,934円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,063,395円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,654,553円
リスクコントロール・オープン	1,836,497円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	81,151,731円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,753,510,034円
Smart-i 8資産バランス 安定型	34,015,710円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	68,190,266円
Smart-i 8資産バランス 成長型	68,172,963円



りそな・リスクコントロールファンド2019-06	229,794,296円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	206,611,020円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	117,502,888円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	77,691,393円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	206,743,213円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,444,351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)	705,272円
2. 計算日における受益権の総数	4,943,476,261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	1.0433円
(10,000口当たり純資産額)	(10,433円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 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 9月15日現在

該当事項はありません。

#### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

#### （その他の注記）

##### 1 有価証券に関する注記

##### 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		160,940,040
合計		160,940,040

(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 9月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	34,322,442	-	34,193,082	129,360
	米ドル	34,322,442	-	34,193,082	129,360

合計	34,322,442	-	34,193,082	129,360
----	------------	---	------------	---------

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	600,325	33,870,336.50	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	459,947	14,520,526.79	
		米ドル 小計	1,060,272	48,390,863.29	(5,116,849,884)
合計				5,116,849,884	(5,116,849,884)

(注1) 通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 外貨建有価証券の内訳

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

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## RAM国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

2020年 9月15日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	154,413,307
投資証券	18,671,713,300
派生商品評価勘定	462,160
未収入金	1,085,204
未収配当金	222,271,945
前払金	6,320,400
差入委託証拠金	110,384,500
流動資産合計	19,166,650,816
<b>資産合計</b>	
19,166,650,816	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,273,030
未払解約金	5,309,000
未払利息	418
流動負債合計	6,582,448
<b>負債合計</b>	
6,582,448	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	16,047,301,600
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	3,112,766,768
元本等合計	19,160,068,368
<b>純資産合計</b>	
19,160,068,368	
<b>負債純資産合計</b>	
19,166,650,816	

## 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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	14,708,553,466円
期中追加設定元本額	13,526,741,070円
期中一部解約元本額	12,187,992,936円
期末元本額	16,047,301,600円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	548,797,200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)	377,820,075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	722,598,892円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	182,587,975円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	90,805,298円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	55,550,786円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,279,037円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,067,740円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,089,174円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,713,847円
リスクコントロール・オープン	1,621,015円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,332,637,379円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,365,412,390円
Smart-i Jリートインデックス	2,339,413,202円
Smart-i 8資産バランス 安定型	29,691,983円

Smart-i 8資産バランス 安定成長型	74,256,467円
Smart-i 8資産バランス 成長型	71,613,502円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	200,594,715円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	179,861,835円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	102,290,023円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	66,655,051円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	181,089,483円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,932,222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)	648,006円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,482,363,502円
2. 計算日における受益権の総数	16,047,301,600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	1.1940円
(10,000口当たり純資産額)	(11,940円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 9月15日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		3,321,261,028
合計		3,321,261,028

(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 9月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	473,095,870	-	472,285,000	810,870
	合計	473,095,870	-	472,285,000	810,870

(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	339	34,137,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	507	46,796,100	
	S O S i L A 物流リート投資法人	462	62,554,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	689	423,735,000	
	M C U B S Mid C i t y 投資法人	2,535	192,913,500	
	森ヒルズリート投資法人	2,434	327,129,600	
	産業ファンド投資法人	2,929	538,057,300	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,968	613,032,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,352	254,311,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,038	411,048,000	
	G L P 投資法人	5,958	990,815,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	904	282,500,000	
	日本プロロジスリート投資法人	3,135	1,100,385,000	
	星野リゾート・リート投資法人	315	161,280,000	
O n e リート投資法人	323	79,167,300		



イオンリート投資法人	2,102	247,195,200	
ヒューリックリート投資法人	1,668	225,346,800	
日本リート投資法人	673	230,839,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	13,311	185,022,900	
積水ハウス・リート投資法人	6,094	439,986,800	
トーセイ・リート投資法人	458	48,960,200	
ケネディクス商業リート投資法人	762	164,363,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	442	55,073,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人	399	38,902,500	
野村不動産マスターファンド投資法人	6,700	871,000,000	
いちごホテルリート投資法人	362	25,086,600	
ラサールロジポート投資法人	2,309	405,691,300	
スターアジア不動産投資法人	2,129	90,695,400	
マリモ地方創生リート投資法人	194	19,904,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	594	316,008,000	
大江戸温泉リート投資法人	334	21,676,600	
投資法人みらい	2,238	84,148,800	
森トラスト・ホテルリート投資法人	449	48,806,300	
三菱地所物流リート投資法人	466	199,681,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	565	83,281,000	
ザイマックス・リート投資法人	317	27,452,200	
タカラレーベン不動産投資法人	623	51,895,900	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	654	89,271,000	
日本ビルファンド投資法人	2,006	1,277,822,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,072	1,220,408,000	
日本リテールファンド投資法人	3,916	606,588,400	
オリックス不動産投資法人	4,128	639,014,400	
日本プライムリアルティ投資法人	1,290	405,060,000	
プレミア投資法人	1,871	217,784,400	
東急リアル・エステート投資法人	1,389	195,987,900	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,439	145,914,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人	4,431	497,601,300	
森トラスト総合リート投資法人	1,481	200,083,100	
インヴィンシブル投資法人	8,664	267,717,600	
フロンティア不動産投資法人	688	240,456,000	
平和不動産リート投資法人	1,290	145,512,000	

日本ロジスティクスファンド投資法人	1,354	395,097,200	
福岡リート投資法人	1,072	142,147,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	641	390,369,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,719	127,721,700	
大和証券オフィス投資法人	441	256,662,000	
阪急阪神リート投資法人	936	109,605,600	
スタートプロシード投資法人	323	65,149,100	
大和ハウスリート投資法人	2,956	796,642,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,675	322,402,500	
大和証券りビング投資法人	2,614	285,710,200	
ジャパンエクセレント投資法人	1,923	232,106,100	
合計	124,050	18,671,713,300	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M先進国リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	35,487,382
コール・ローン	20,013,187
投資証券	21,346,325,669
派生商品評価勘定	103
未収入金	26,007,854
未収配当金	38,480,071
流動資産合計	21,466,314,266
資産合計	21,466,314,266
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	414

2020年 9月15日現在	
未払金	21,238,604
未払解約金	5,974,000
未払利息	54
流動負債合計	27,213,072
負債合計	27,213,072
純資産の部	
元本等	
元本	22,234,195,479
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	795,094,285
元本等合計	21,439,101,194
純資産合計	21,439,101,194
負債純資産合計	21,466,314,266

## 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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	16,787,744,438円
期中追加設定元本額	19,215,684,585円
期中一部解約元本額	13,769,233,544円
期末元本額	22,234,195,479円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	678,428,927円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	782,790,926円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,851,696,105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	441,801,627円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	254,662,792円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	127,530,794円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	77,248,146円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	5,907,563円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,264,109円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,549,141円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,811,901円
リスクコントロール・オープン	8,018,146円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,471,106,294円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,337,530,961円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,322,677,348円
Smart-i 8資産バランス 安定型	36,784,546円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	91,140,080円
Smart-i 8資産バランス 成長型	103,834,952円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	495,387,821円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	443,739,591円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	252,360,970円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	167,931,847円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	446,967,345円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	73,889,562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)	2,091,564円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,737,724,530円
2. 計算日における受益権の総数	22,234,195,479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	795,094,285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	0.9642円
(10,000口当たり純資産額)	(9,642円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

#### デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 9月15日現在

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

### 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		2,244,597,067
合計		2,244,597,067

(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 9月15日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,983,951	-	23,983,640	311
	米ドル	5,815,221	-	5,815,150	71
	英ポンド	15,476,537	-	15,476,640	103
	オーストラリアドル	2,692,193	-	2,691,850	343
合計		23,983,951	-	23,983,640	311

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,937	174,762.90	
		AGREE REALTY CORP	9,785	673,697.25	
		ALEXANDER'S INC	368	95,484.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,383	3,663,649.44	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,232	209,751.36	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24,565	895,394.25	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	133,222.32	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	45,394	1,348,201.80	
		AMERICOLD REALTY TRUST	35,824	1,323,338.56	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	26,837	1,005,850.76	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	38,578	410,469.92	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	66,200	22,508.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,169	2,186.03	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,882	3,845,761.92	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	26,436.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	25,574	2,197,062.34	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	12,973.31	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	30,901	332,494.76	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52,716	662,112.96	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,842	106,588.86	
		BRT APARTMENTS CORP	877	10,883.57	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	17,340	1,616,088.00	
		CARETRUST REIT INC	17,311	331,505.65	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	2,955.76	
		CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	13,492.20	

CHATHAM LODGING TRUST	8,481	66,406.23	
CITY OFFICE REIT INC	8,644	68,460.48	
CLIPPER REALTY INC	1,350	8,437.50	
COLONY CAPITAL INC	83,392	220,154.88	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	21,242	241,521.54	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	183,064.00	
CORECIVIC INC	19,484	177,888.92	
COREPOINT LODGING INC	7,200	39,024.00	
CORESITE REALTY CORP	7,022	818,624.76	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	20,632	492,073.20	
COUSINS PROPERTIES INC	26,571	791,018.67	
CUBESMART	34,296	1,122,508.08	
CYRUSONE INC	20,556	1,571,917.32	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,147	196,686.72	
DIGITAL REALTY TRUST INC	47,552	6,860,802.56	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,700	144,351.00	
DOUGLAS EMMETT INC	28,919	779,656.24	
DUKE REALTY CORP	65,658	2,488,438.20	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,662	325,702.08	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,877	906,182.29	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,942	162,656.34	
EPR PROPERTIES	13,450	425,020.00	
EQUINIX INC	15,689	11,861,511.56	
EQUITY COMMONWEALTH	21,828	670,774.44	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	32,104	2,090,933.52	
EQUITY RESIDENTIAL	61,906	3,524,308.58	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,056	323,893.44	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,686	2,598,849.54	
EXTRA SPACE STORAGE INC	23,025	2,563,373.25	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	21,672.35	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,303	990,637.56	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,792	938,574.56	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,917	338,683.74	



FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	65,878.80	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8,641	83,126.42	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	37,014	1,415,415.36	
GEO GROUP INC/THE	23,121	259,880.04	
GETTY REALTY CORP	6,175	176,605.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	113,180.96	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	39,649.61	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	103,373.11	
GLOBAL NET LEASE INC	16,550	290,121.50	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	24,503	727,004.01	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	39,079	1,053,960.63	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	95,145	2,736,370.20	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	25,131.02	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	18,432	658,944.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	125,860	1,500,251.20	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	27,565	661,008.70	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	17,854	208,713.26	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,134	249,290.26	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,740	449,959.40	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,974	139,917.12	
INVITATION HOMES INC	96,236	2,806,241.76	
IRON MOUNTAIN INC	50,884	1,473,600.64	
JBG SMITH PROPERTIES	20,196	557,207.64	
KILROY REALTY CORP	18,496	1,041,694.72	
KIMCO REALTY CORP	75,757	937,114.09	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,699	159,045.39	
LEXINGTON REALTY TRUST	47,838	540,091.02	
LIFE STORAGE INC	8,329	920,271.21	
LTC PROPERTIES INC	7,359	273,901.98	
MACERICH CO/THE	20,631	150,193.68	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	201,211.90	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	256,400	197,428.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	93,238	1,711,849.68	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,444	2,446,124.60	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	17,950	257,223.50	

NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30,040	1,156,540.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,777	378,380.47	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,723	503,462.37	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,695	63,250.85	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,057	174,694.42	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,819	179,524.24	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	40,489	1,341,400.57	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,185	41,318.35	
PARAMOUNT GROUP INC	36,007	263,931.31	
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,506	445,160.94	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,138	309,046.48	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	6,473.22	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,738	686,633.22	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,777	335,277.44	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	28,245.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	54,765.92	
PRIME US REIT	85,000	69,275.00	
PROLOGIS INC	130,949	13,350,250.55	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,480	428,840.40	
PUBLIC STORAGE	26,638	5,986,624.12	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,935	698,527.80	
REALTY INCOME CORP	60,924	3,990,522.00	
REGENCY CENTERS CORP	30,567	1,223,902.68	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,099	242,647.02	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	39,537	247,896.99	
RETAIL VALUE INC	1,615	20,026.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,970	1,032,590.00	
RLJ LODGING TRUST	28,086	274,961.94	
RPT REALTY	15,048	89,836.56	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,923	390,569.28	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,637	567,341.04	
SAFEHOLD INC	2,352	139,520.64	
SAUL CENTERS INC	2,130	54,634.50	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	7,242	108,195.48	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	246,428.96	

	SIMON PROPERTY GROUP INC	54,251	3,678,217.80	
	SITE CENTERS CORP	24,168	193,827.36	
	SL GREEN REALTY CORP	13,535	643,859.95	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	18,442	691,759.42	
	STAG INDUSTRIAL INC	26,154	840,851.10	
	STORE CAPITAL CORP	39,967	1,137,061.15	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	110,241.60	
	SUN COMMUNITIES INC	17,397	2,563,273.98	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	39,478	328,456.96	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,020	96,333.20	
	TAUBMAN CENTERS INC	10,971	391,774.41	
	TERRENO REALTY CORP	12,252	698,364.00	
	UDR INC	52,422	1,844,730.18	
	UMH PROPERTIES INC	7,056	100,054.08	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,060	137,772.80	
	URBAN EDGE PROPERTIES	17,978	188,589.22	
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	51,874.48	
	VENTAS INC	65,946	2,999,224.08	
	VEREIT INC	192,872	1,369,391.20	
	VICI PROPERTIES INC	82,646	2,050,447.26	
	VORNADO REALTY TRUST	27,817	981,383.76	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	12,860.94	
	WASHINGTON REIT	14,564	301,620.44	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	21,596	390,239.72	
	WELLTOWER INC	73,959	4,446,415.08	
	WHITESTONE REIT	7,716	47,299.08	
	WP CAREY INC	30,873	2,133,015.57	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	20,048	187,448.80	
	米ドル 小計	4,438,253	151,519,978.82 (16,021,722,560)	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,585	403,923.60	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,597	110,979.57	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,226	122,342.70	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,801	647,395.74	
	CHOICE PROPERTIES REIT	26,037	332,492.49	

	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	17,280	124,416.00
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	112,194.14
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	125,784.36
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	145,717.46
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,061	79,189.50
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	265,430.52
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,848	367,284.48
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,054	260,311.06
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	150,457.41
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	147,415.03
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	59,938.04
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	57,551.12
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	6,008	203,851.44
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,751	179,246.38
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,723	424,813.17
	SLATE GROCERY REIT	1,920	20,793.60
	SLATE OFFICE REIT	4,169	15,842.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,423	264,361.44
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,126	149,513.58
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	28,224.00
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	8,000	136,560.00
	カナダドル 小計	290,208	4,936,029.03 (395,869,528)
ユーロ	AEDIFICA	4,689	481,091.40
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	28,430	354,237.80
	ALTAREA	659	82,243.20
	BEFIMMO	4,044	153,672.00
	COFINIMMO	4,226	529,095.20
	COVIVIO	8,276	504,008.40
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	7,371	73,857.42
	GECINA SA	9,817	1,095,577.20
	HAMBORNER REIT AG	12,779	110,998.39
	HIBERNIA REIT PLC	124,814	138,293.91
	ICADE	5,196	267,594.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	15,397.61

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,440	304,414.00
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	94,594.50
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	104,853.22
	KLEPIERRE	36,303	482,285.35
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	47,079.99
	MERCIALYS	3,481	19,267.33
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	64,785	449,607.90
	MONTEA	1,871	193,835.60
	NSI NV	3,090	90,382.50
	RETAIL ESTATES	1,989	113,174.10
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	24,692	959,531.12
	VASTNED RETAIL NV	3,660	87,657.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,850	672,932.50
	WERELDHAVE NV	7,169	52,190.32
	ユーロ 小計	521,012	7,477,871.96 (938,398,152)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	15,640.00
	ASSURA PLC	472,419	375,573.10
	BIG YELLOW GROUP PLC	29,321	307,870.50
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	89,958.00
	BRITISH LAND CO PLC	165,720	575,545.56
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,700	179,283.30
	CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	2,864.40
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,652	124,818.41
	DERWENT LONDON PLC	19,238	508,652.72
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	67,910.30
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	45,664	267,317.05
	HAMMERSON PLC	687,112	170,884.75
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	131,300	714,140.70
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	163,242	373,824.18
	LXI REIT PLC	94,678	104,524.51
	NEWRIVER REIT PLC	56,051	28,586.01
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	68,289.60
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	233,711	349,631.65
	RDI REIT PLC	48,350	43,901.80

	REGIONAL REIT LTD	68,961	49,996.72	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	37,357	296,801.36	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	33,224.46	
	SEGRO PLC	210,916	1,982,610.40	
	SHAFTESBURY PLC	41,622	222,677.70	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	49,939	54,433.51	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	294,977	453,969.60	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	164,710	109,696.86	
	UNITE GROUP PLC	71,753	688,470.03	
	WORKSPACE GROUP PLC	21,040	113,931.60	
	英ボンド 小計	3,951,562	8,375,028.78 (1,137,077,657)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	66,607	184,501.39	
	APN INDUSTRIA REIT	13,219	33,708.45	
	ARENA REIT	52,557	137,699.34	
	BWP TRUST	93,681	370,976.76	
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	141,373.26	
	CHARTER HALL GROUP	84,214	1,037,516.48	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,828	370,616.56	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,091	285,909.40	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	152,237.14	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	324,502	282,316.74	
	DEXUS	196,712	1,756,638.16	
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	89,615.36	
	GOODMAN GROUP	288,753	5,194,666.47	
	GPT GROUP	340,528	1,324,653.92	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	173,698.87	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,020	67,684.40	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,899	220,553.58	
	MIRVAC GROUP	688,152	1,410,711.60	
	NATIONAL STORAGE REIT	185,638	346,214.87	
	RURAL FUNDS GROUP	67,950	156,285.00	
	SCENTRE GROUP	911,360	1,913,856.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	196,242	429,769.98	
	STOCKLAND	423,672	1,529,455.92	

	VICINITY CENTRES	709,328	961,139.44
	WAYPOINT REIT LTD	119,935	320,226.45
	オーストラリアドル 小計	5,257,859	18,892,025.54 (1,453,174,604)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	196,469.55
	GOODMAN PROPERTY TRUST	207,660	486,962.70
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	272,970	286,618.50
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	315,759.70
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	67,526	200,889.85
	ニュージーランドドル 小計	879,430	1,486,700.30 (105,228,647)
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,395,940.00
	FORTUNE REIT	239,000	1,613,250.00
	LINK REIT	365,700	23,258,520.00
	PROSPERITY REIT	226,000	522,060.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	196,000	760,480.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	988,200.00
	香港ドル 小計	1,634,700	28,538,450.00 (389,264,458)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	96,509.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	175,200	111,252.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	530,200	1,712,546.00
	ASCOTT TRUST	316,596	291,268.32
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	519,600	893,712.00
	CAPITALAND MALL TRUST	508,500	1,022,085.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	140,500	160,170.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	143,100	153,117.00
	ESR REIT	390,700	154,326.50
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	88,110.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	107,400	47,256.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	126,100	337,948.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	58,828.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	419,979	571,171.44
	KEPPEL DC REIT	212,400	626,580.00
	KEPPEL REIT	327,600	353,808.00
LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	127,100	86,428.00	

	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	22,498.30	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	393,400	778,932.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	276,400	870,660.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	529,400	1,074,682.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	392,900	367,361.50	
	OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I	446,000	162,790.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	70,900	283,600.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	60,037.50	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	69,075.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	165,900	80,461.50	
	SPH REIT	161,200	141,856.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	251,500	113,175.00	
	SUNTEC REIT	421,200	619,164.00	
	シンガポールドル 小計	7,980,075	11,409,408.06 (884,457,312)	
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	15,600	80,340,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	28,085,000.00	
	韓国ウォン 小計	19,700	108,425,000.00 (9,704,037)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	29,265	371,665.50	
	イスラエルシュケル 小計	29,265	371,665.50 (11,428,714)	
合計			21,346,325,669 (21,346,325,669)	

(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%	75.1%
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%	4.4%
英ポンド	投資証券 30銘柄	100.0%	5.3%



オーストラリアドル	投資証券	25銘柄	100.0%	6.8%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	4.1%
韓国ウォン	投資証券	2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M マネーマザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

2020年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,721,562,423
国債証券	18,802,970,900
流動資産合計	31,524,533,323
資産合計	31,524,533,323
負債の部	
流動負債	
未払金	900,153,900
未払利息	34,505
流動負債合計	900,188,405
負債合計	900,188,405
純資産の部	
元本等	
元本	30,681,150,051
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	56,805,133
元本等合計	30,624,344,918
純資産合計	30,624,344,918
負債純資産合計	31,524,533,323

### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年10月31日
期首元本額	620,620,315円
期中追加設定元本額	108,827,743,728円
期中一部解約元本額	78,767,213,992円
期末元本額	30,681,150,051円
期末元本の内訳	
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	11,687,316,697円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	6,613,979,753円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	4,792,087,450円
りそなDAA先物ファンド（適格機関投資家専用）	7,110,659,706円
りそなマネー・プール・ファンド（適格機関投資家専用）	553,926円
りそなDAA先物 ファンド（適格機関投資家専用）	476,552,519円
2. 計算日における受益権の総数	30,681,150,051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	56,805,133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	0.9981円
(10,000口当たり純資産額)	(9,981円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

2020年 9月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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

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

### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月15日現在

#### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

#### 2. 時価の算定方法

##### 国債証券

（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 9月15日現在

該当事項はありません。

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

### （その他の注記）

#### 1 有価証券に関する注記

##### 売買目的有価証券

種類	2020年 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		5,136,200
合計		5,136,200

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

### 附属明細表

#### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第864回国庫短期証券	200,000,000	200,025,000	
	第871回国庫短期証券	3,700,000,000	3,700,888,000	
	第917回国庫短期証券	4,000,000,000	4,000,092,000	
	第918回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,061,500	
	第919回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,105,000	
	第921回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,144,000	
	第923回国庫短期証券	300,000,000	300,036,600	
	第926回国庫短期証券	600,000,000	600,103,800	
	第928回国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,207,000	
	第933回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,415,500	
	第934回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,454,500	
	第936回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,438,000	
合計		18,800,000,000	18,802,970,900	

#### 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 9月30日現在です。

## 【りそな・リスクコントロールファンド2019-10】

## 【純資産額計算書】

資産総額	21,429,026,708円
負債総額	15,126,617円
純資産総額（ - ）	21,413,900,091円
発行済口数	22,198,942,352口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9646円

（参考）

## RAM国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	89,572,192,975円
負債総額	586,613,018円
純資産総額（ - ）	88,985,579,957円
発行済口数	84,547,755,878口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0525円

## RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

資産総額	188,489,242,754円
負債総額	2,656,489,640円
純資産総額（ - ）	185,832,753,114円
発行済口数	172,828,003,322口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0752円

## RAM国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	30,997,006,897円
負債総額	185,432,977円
純資産総額（ - ）	30,811,573,920円
発行済口数	26,500,451,568口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1627円

## R A M先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	70,189,720,269円
負債総額	518,368,534円
純資産総額（ - ）	69,671,351,735円
発行済口数	50,748,554,632口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3729円

## R A M新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	10,250,227,324円
負債総額	104,875,074円
純資産総額（ - ）	10,145,352,250円
発行済口数	7,835,203,765口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2948円

## R A M新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	5,252,124,341円
負債総額	96,700,314円
純資産総額（ - ）	5,155,424,027円
発行済口数	5,103,989,197口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0101円

## R A M国内リートマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	19,504,698,629円
負債総額	78,557,856円
純資産総額（ - ）	19,426,140,773円
発行済口数	16,145,343,594口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2032円

## R A M先進国リートマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	21,302,627,370円
負債総額	193,422,901円
純資産総額（ - ）	21,109,204,469円
発行済口数	22,703,730,175口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9298円

## R A Mマネーマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	30,351,753,720円
負債総額	34,848円
純資産総額（ - ）	30,351,718,872円
発行済口数	30,409,443,809口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9981円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## 受益権の譲渡

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



するものとしします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2020年9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9月末現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

###### PLAN：計画

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

###### DO：実行

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

###### CHECK：検証 ACTION：改善

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

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年9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	81	813,696
単位型株式投資信託	6	117,600
合計	87	931,296

## 3【委託会社等の経理状況】

- （1）委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- （2）財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- （3）当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （2019年3月31日）	当事業年度 （2020年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	1,344,092	2,211,091
前払費用	21,505	186,739
未収入金	238	247
未収委託者報酬	369,524	810,183
未収運用受託報酬	-	1,261,327
未収投資助言報酬	38,188	418,494
流動資産計	1,773,550	4,888,083
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 2,791	4,325
器具備品	1 9,167	11,668
有形固定資産計	11,958	15,993
無形固定資産		
ソフトウェア	29,501	18,733
無形固定資産計	29,501	18,733
投資その他の資産		
投資有価証券	599	7,975
長期前払費用	1,416	416
繰延税金資産	34,080	72,304

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

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	87,317	311,378
その他未払金	2 163,133	760,759
未払費用	23,612	85,094
未払法人税等	17,310	192,367
未払消費税等	39,930	287,966
預り金	444	1,648
賞与引当金	36,596	96,675
流動負債計	368,344	1,735,890
負債合計	368,344	1,735,890
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,236	1,778,051
利益剰余金計	7,236	1,778,051
株主資本計	1,482,763	3,268,051
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	0	433
評価・換算差額等計	0	433
純資産合計	1,482,762	3,267,617
負債・純資産合計	1,851,107	5,003,507

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

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

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11	11	1,318,695
当期変動額			
当期純利益			164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	11	11	11
当期変動額合計	11	11	164,067
当期末残高	0	0	1,482,762

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	0	0	1,482,762
当期変動額			
当期純利益			1,785,287
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	433	433	433
当期変動額合計	433	433	1,784,854
当期末残高	433	433	3,267,617

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

2016年4月1日以降に取得した建物附属設備につきましては、定額法を採用しております。

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

## 器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

## 賞与引当金

従業員への業績インセンティブ給与の支払いに備えるため、従業員に対する業績インセンティブ給与の支給見込額のうち、当事業年度に帰属する額を計上しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## (2) 連結納税制度の適用

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

## (3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

## (未適用の会計基準等)

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

## (1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
流動負債		
その他未払金	44,766千円	616,704千円
(注)当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。		

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社に対する主な取引

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

当社の営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に支払われる信託報酬の未払金額であります。当該信託財産は、受託者である信託銀行により適切に分別管理され、信託法により受託者の倒産の影響を受けません。そのため、当該金銭債権に関する信用リスクはありません。

未収運用受託報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、運用受託先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、投資助言先毎に期日管理および残高管理を行うとともに、四半期毎に回収可能性を把握する体制としております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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



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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

負債

未払手数料、その他未払金

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(\*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2019年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2020年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04%
住民税均等割	0.43%
評価性引当額の増減	3.23%
その他	1.89%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>25.96%</u>

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.01%
住民税均等割	0.09%
その他	1.64%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.07%</u>

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1) 取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：株式会社りそな銀行の資産運用事業に関して有する権利義務の一部

事業の内容：法人・機関投資家向け資産運用サービスの提供

企業結合日

2020年1月1日

企業結合の法的形式

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

結合後の名称

りそなアセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

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

## （２）実施した会計処理の概要

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

### （セグメント情報等）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

#### 1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 2．関連情報

##### （１）製品及びサービスごとの情報

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

##### （２）地域ごとの情報

###### 営業収益

内国籍投資信託からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

###### 有形固定資産

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

##### （３）主要な顧客ごとの情報

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

#### 3．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

#### 4．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

#### 5．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

#### 1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

#### 2．関連情報

##### （１）製品及びサービスごとの情報

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

##### （２）地域ごとの情報

###### 営業収益

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

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

###### 有形固定資産

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

##### （３）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報  
該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報  
該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報  
該当事項はありません。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（2）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の費用については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資一任の費用については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

## (2) 兄弟会社等

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

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

## 2. 親会社に関する注記

## 親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

## (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	374円43銭	825円15銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失( )	41円43銭	450円83銭

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
当期純利益又は当期純損失( )(千円)	164,079	1,785,287
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失( )(千円)	164,079	1,785,287
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000	3,960,000

## (重要な後発事象)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（4）、（5）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記（3）、（4）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
2020年1月1日付で株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を承継する吸収分割を行いました。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

### 第2【その他の関係法人の概況】

#### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

##### (1) 受託会社

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

##### < 再信託受託会社の概要 >

- 名称 : 株式会社日本カストディ銀行  
 資本金の額 : 51,000百万円（2020年7月27日現在）  
 事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。  
 再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

##### (2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## (3) 保証会社

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

## 2【関係業務の概要】

## (1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

## (2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

## (3) 保証会社

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

## 3【資本関係】

## (1) 受託会社

該当事項はありません。

## (2) 販売会社

該当事項はありません。

## (3) 保証会社

該当事項はありません。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 7月30日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 有限責任監査法人トーマツ 東京事務所

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

#### 監査意見

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

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

#### 監査意見の根拠

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

#### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

#### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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



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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年11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 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそな・リスクコントロールファンド2019-10の2019年10月31日から2020年9月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・リスクコントロールファンド2019-10の2020年9月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

る。継続企業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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。