

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年12月25日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	Smart-i 8資産バランス 安定型 Smart-i 8資産バランス 安定成長型 Smart-i 8資産バランス 成長型
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	Smart-i 8資産バランス 安定型 1兆円を上限とします。 Smart-i 8資産バランス 安定成長型 1兆円を上限とします。 Smart-i 8資産バランス 成長型 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

Smart-i 8資産バランス 安定型  
 Smart-i 8資産バランス 安定成長型  
 Smart-i 8資産バランス 成長型

- ・以下、上記を総称して「ファンド」または「当ファンド」ということがあります。また、各々については、正式名称ではなく、以下の略称を使用することがあります。

ファンドの名称	略称
Smart-i 8資産バランス 安定型	安定型
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	安定成長型
Smart-i 8資産バランス 成長型	成長型

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

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

## (3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンド、1兆円を上限とします。

## (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

- ・基準価額につきましては、販売会社または「(8)申込取扱場所」の照会先にお問い合わせください。

## (5)【申込手数料】

ありません。

## (6)【申込単位】

販売会社にお問い合わせください。

## (7)【申込期間】

2020年12月26日から2021年6月25日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

## (8)【申込取扱場所】

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

**委託会社の照会先**

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ アドレス：<https://www.resona-am.co.jp/>**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

**（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】**

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

**（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】**

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

< Smart - i 8資産バランス 安定型 >

< Smart - i 8資産バランス 安定成長型 >

< Smart - i 8資産バランス 成長型 >

信託財産の長期的な成長を目標と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
	海外	債券
追加型投信		不動産投信
	内外	その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回 年4回	グローバル (含む日本) 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ないファンドをいう。
- (2) 追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

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

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

#### 4. 独立した区分

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

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

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1)株式

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

## 1 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)を実質的な投資対象資産とします。

- 以下のマザーファンドを通じて投資対象資産への分散投資を行います。
- 各マザーファンドは、以下の対象指数(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。

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

- 上記マザーファンドの運用において、インデックスへの連動性を高めるため、債券先物取引、株価指数先物取引、不動産投信指数先物取引、ETF(上場投資信託証券)を活用することがあります。

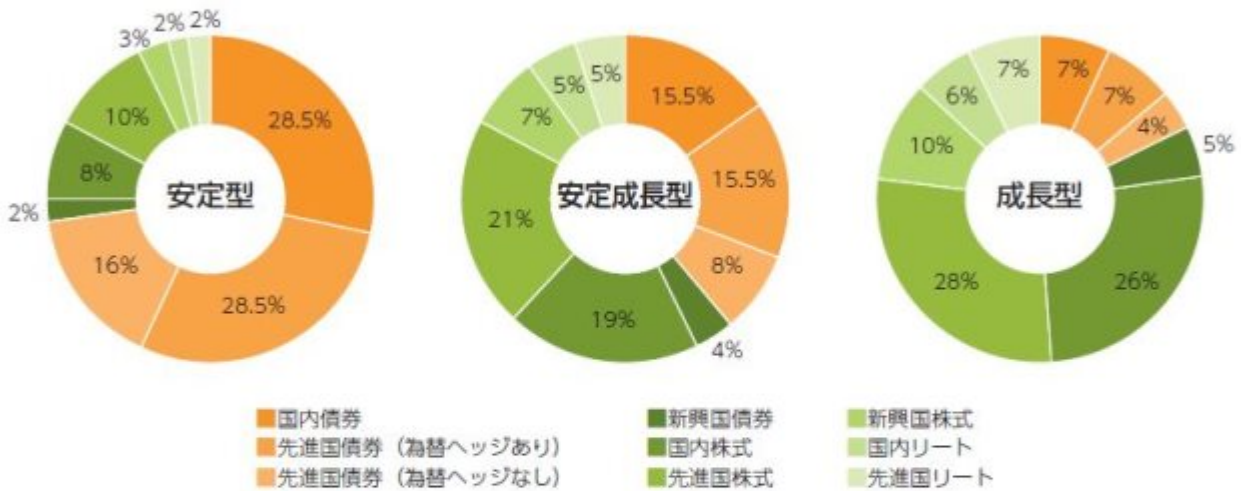
\*各インデックスについては、「インデックスの著作権等について」をご参照ください。



## 2 運用目的やリスク許容度にあわせて、 3つのファンドからお好みの運用タイプをお選びいただけます。

- 安定型：債券への投資割合を高め、資産の安定性を重視した運用を行います。
- 安定成長型：債券、株式およびリートに対する投資割合の分散をはかり、安定性と成長性のバランスを目指した運用を行います。
- 成長型：株式およびリートへの投資割合を高め、資産の成長性を重視した運用を行います。

◆各ファンドの投資割合(基本的資産配分)\*は以下の通りです。



投資対象資産	安定型	安定成長型	成長型	
国内債券	28.5%	15.5%	7%	
先進国債券	(為替ヘッジあり)	28.5%	15.5%	7%
	(為替ヘッジなし)	16%	8%	4%
新興国債券	2%	4%	5%	
国内株式	8%	19%	26%	
先進国株式	10%	21%	28%	
新興国株式	3%	7%	10%	
国内リート	2%	5%	6%	
先進国リート	2%	5%	7%	

\*上記の基本的資産配分は、2020年3月時点のものです。

※上記の基本的資産配分は、四捨五入の都合により合計が100%と異なる場合があります。

※保有する有価証券等の価格変動の影響を受けることなどにより、実際の投資割合は上記の数値から乖離する場合があります。

### 3 基本的資産配分は、原則として年1回見直します。

- 基本的資産配分は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性（標準偏差）等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

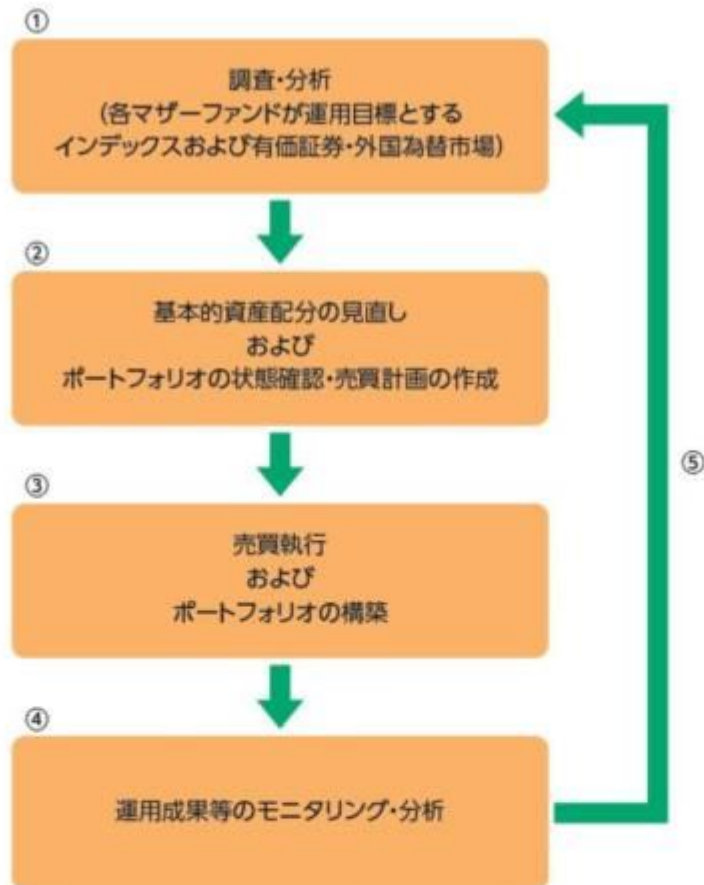
### 4 実質組入外貨建資産の一部について、 対円での為替ヘッジを行います。

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

### 5 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

## 運用プロセスのイメージ



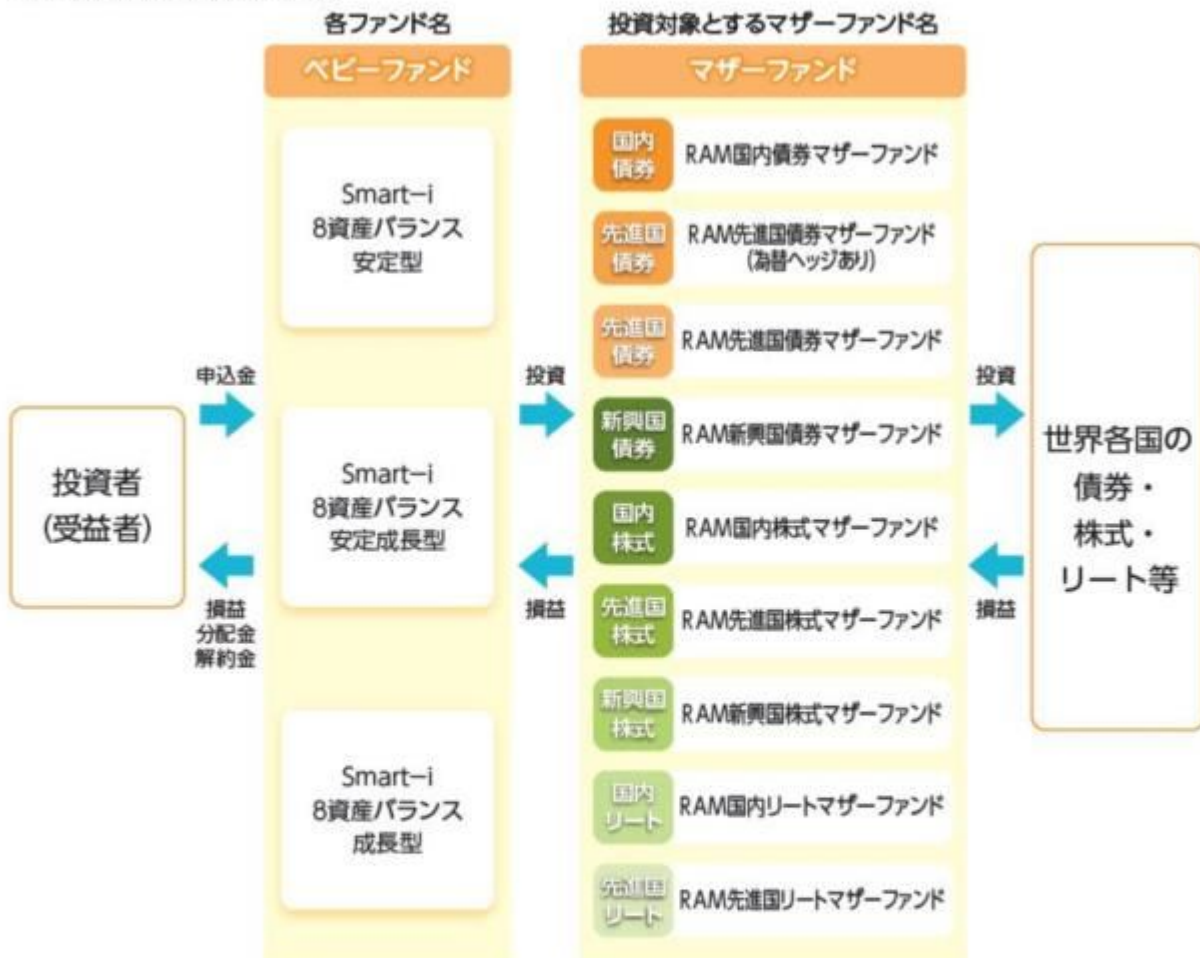
- ①各マザーファンドが運用目標とするインデックスおよび投資対象となる有価証券・外国為替市場に関する調査・分析を行います。
- ②各種情報を基に、原則として年1回基本的資産配分の見直しを行い、また日常的にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じてマザーファンドの売買計画を作成します。
- ③売買執行(マザーファンドの売買)により、ポートフォリオを構築します。
- ④運用成果や基準価額の騰落要因等について、モニタリング・分析を行います。
- ⑤上記④の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## ファンドの仕組み

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



## 主な投資制限

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



## 分配方針

原則、毎年3月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③留保金は、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。

## 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先進国債券マザーファンド

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

### ●RAM新興国債券マザーファンド

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

### ●RAM国内株式マザーファンド

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

### ●RAM先進国株式マザーファンド

「MSCI-KOKUSA1指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSA1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-KOKUSA1指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

### ●RAM新興国株式マザーファンド

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

### ●RAM国内リートマザーファンド

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

### ●RAM先進国リートマザーファンド

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

### 信託金限度額

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

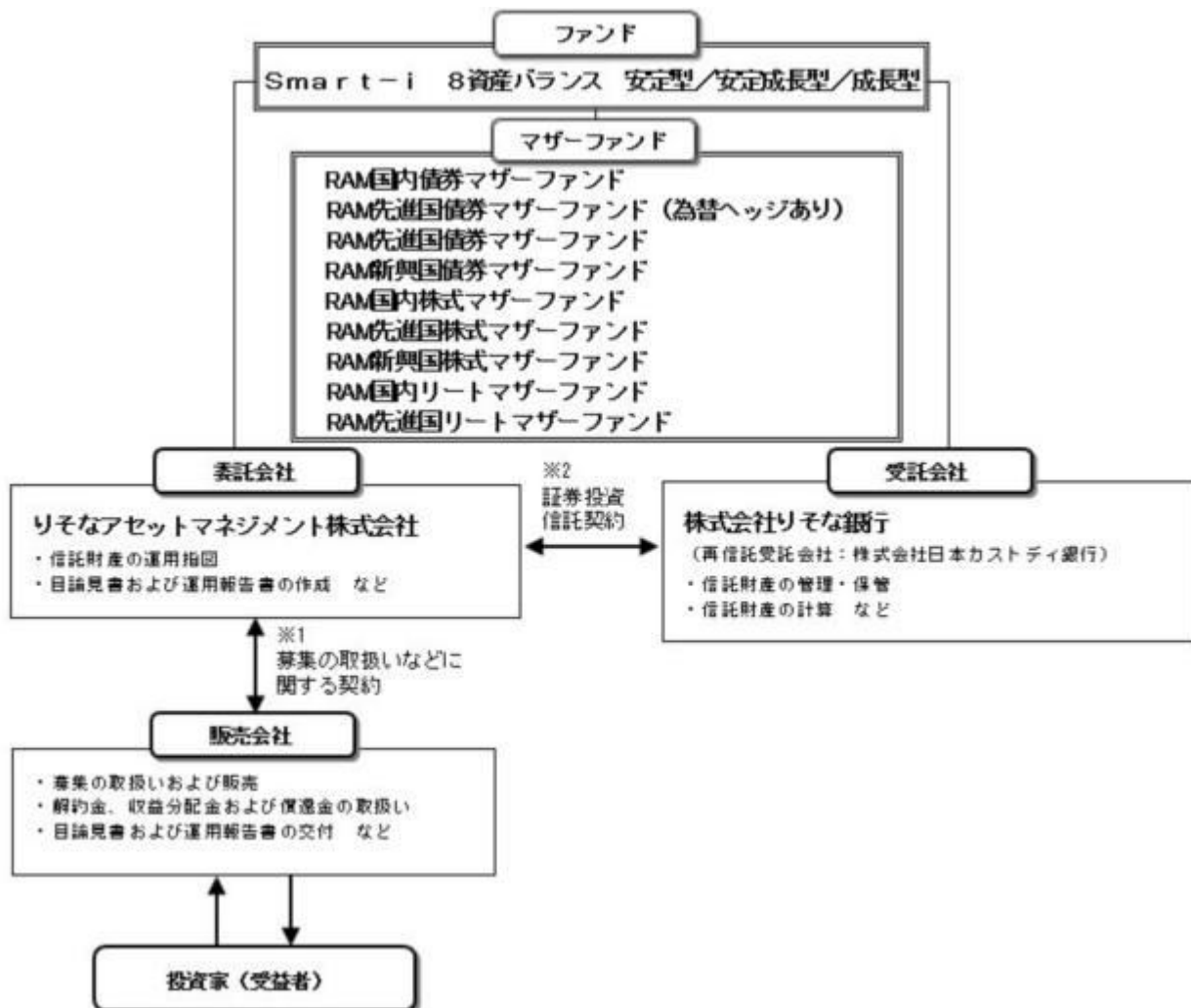
## (2)【ファンドの沿革】

2018年3月27日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、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です。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です。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。

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

#### < Smart-i 8資産バランス 安定型 >

主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式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)等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

各マザーファンドは、以下の対象指数(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。

各マザーファンドに対する投資割合は、「基本的資産配分」にしがいます。なお、設定時における「基本的資産配分」は、以下の通りです。

マザーファンド	インデックス	基本的資産配分
RAM国内債券マザーファンド	NOMURA - B P I 総合	28.5%
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)	28.5%
RAM先進国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	16.0%
RAM新興国債券マザーファンド	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)	2.0%
RAM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	8.0%
RAM先進国株式マザーファンド	M S C I - K O K U S A I 指数(配当込み、円換算ベース)	10.0%
RAM新興国株式マザーファンド	M S C I エマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)	3.0%
RAM国内リートマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	2.0%
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)	2.0%

「基本的資産配分」は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性(標準偏差)等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

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。

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。

#### < Smart-i 8資産バランス 安定成長型 >

主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式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)等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

各マザーファンドは、以下の対象指数(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。

各マザーファンドに対する投資割合は、「基本的資産配分」にしがいます。なお、設定時における「基本的資産配分」は、以下の通りです。

マザーファンド	インデックス	基本的資産配分
RAM国内債券マザーファンド	NOMURA - B P I 総合	15.5%
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)	15.5%
RAM先進国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	8.0%
RAM新興国債券マザーファンド	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)	4.0%
RAM国内株式マザーファンド	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	19.0%
RAM先進国株式マザーファンド	M S C I - K O K U S A I 指数(配当込み、円換算ベース)	21.0%

R A M新興国株式マザーファンド	M S C I エマージング・マーケット指数 （配当込み、円換算ベース）	7.0%
R A M国内リートマザーファンド	東証R E I T指数（配当込み）	5.0%
R A M先進国リートマザーファンド	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配 当込み、円換算ベース）	5.0%

「基本的資産配分」は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性（標準偏差）等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

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。

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。

#### < S m a r t - i 8 資産バランス 成長型 >

主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式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）等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

各マザーファンドは、以下の対象指数（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。

各マザーファンドに対する投資割合は、「基本的資産配分」にしがいます。なお、設定時における「基本的資産配分」は、以下の通りです。

マザーファンド	インデックス	基本的資産配分
R A M国内債券マザーファンド	N O M U R A - B P I 総合	7.0%
R A M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）	7.0%
R A M先進国債券マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円 換算ベース）	4.0%
R A M新興国債券マザーファンド	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）	5.0%
R A M国内株式マザーファンド	東証株価指数（T O P I X、配当込み）	26.0%
R A M先進国株式マザーファンド	M S C I - K O K U S A I 指数（配当込 み、円換算ベース）	28.0%
R A M新興国株式マザーファンド	M S C I エマージング・マーケット指数 （配当込み、円換算ベース）	10.0%
R A M国内リートマザーファンド	東証R E I T 指数（配当込み）	6.0%
R A M先進国リートマザーファンド	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配 当込み、円換算ベース）	7.0%

「基本的資産配分」は、運用リスク水準の維持を目的として、各マザーファンドが運用目標とするインデックスの騰落率や変動性（標準偏差）等、公開されているデータに基づく定量的な算出により、原則として年1回見直します。

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。

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21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）
  - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
  - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産



## イ) 為替手形

## 有価証券の指図範囲

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

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

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

## 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、 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

< R A M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	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は、行いません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<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先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） &gt;

<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ません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<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先進国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 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。 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。
<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新興国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<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	<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>・東証株価指数（TOPIX、配当込み）に採用されている株式</li> </ul>

投資方針	<p>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。</p> <p>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。</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

## &lt; RAM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-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

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

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

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

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

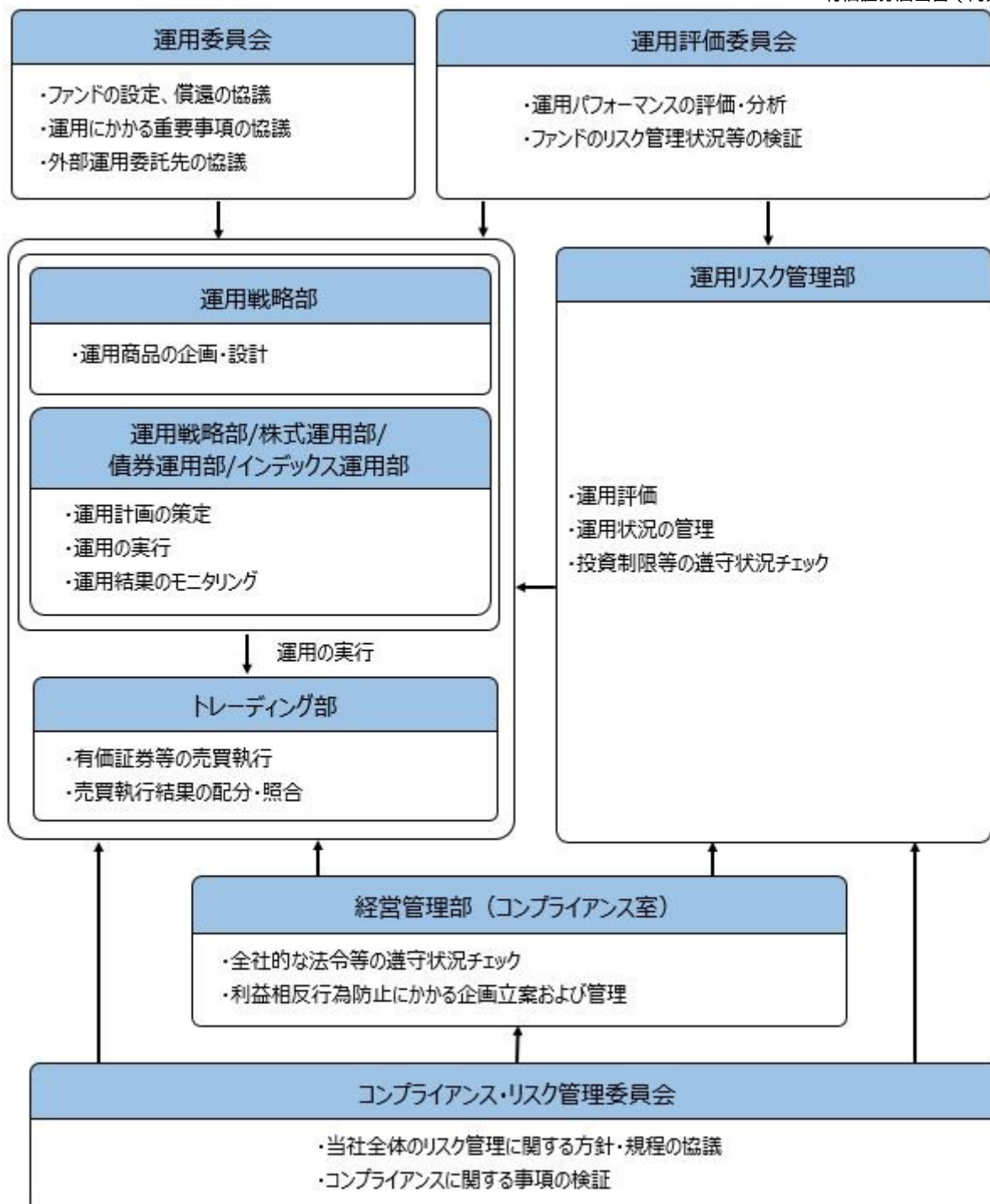
## &lt; R A M先進国リートマザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、S & P 先進国 R E I T 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 E T F（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 E T F（上場投資信託証券）に投資し、S &amp; P 先進国 R E I T 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 R E I T 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 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。</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

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

### 収益分配金の支払い

< 分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース） >

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

< 分配金受取りコース（一般コース） >

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

## (5) 【投資制限】

### 約款に定める投資制限

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

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

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

#### 10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額

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

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、異なる通貨、異なる受取金利または異なる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います。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 17) 資金の借入れ

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

#### 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。

#### (その他の留意点)

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。

## 【参考情報】

## Smart-i 8資産バランス 安定型

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2019年3月から2020年9月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	8.5	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△0.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.5	4.2	6.6	3.5	1.6	0.7	0.5

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2015年10月から2020年9月の5年間(当ファンドは2019年3月から2020年9月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## Smart-i 8資産バランス 安定成長型

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2019年3月から2020年9月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較  
グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	14.6	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△6.2	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.0	4.2	6.6	3.5	1.6	0.7	0.5

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2015年10月から2020年9月の5年間(当ファンドは2019年3月から2020年9月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。



## Smart-i 8資産バランス 成長型

## ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- \* 年間騰落率は、2019年3月から2020年9月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



(%)	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	18.5	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△9.5	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	2.7	4.2	6.6	3.5	1.6	0.7	0.5

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2015年10月から2020年9月の5年間(当ファンドは2019年3月から2020年9月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## 各資産クラスの指数

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

## ○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

## 東証株価指数(TOPIX, 配当込み)

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

## MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)

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

## MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み, 円ベース)

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

## NOMURA-BPI国債

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

## FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

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

## JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

ありません。

## (2)【換金(解約)手数料】

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、各ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

< Smart - i 8資産バランス 安定型 >

年率0.176%（税抜0.16%）

< Smart - i 8資産バランス 安定成長型 >

年率0.198%（税抜0.18%）

< Smart - i 8資産バランス 成長型 >

年率0.220%（税抜0.20%）

ただし、RAM新興国債券マザーファンドがETF（上場投資信託証券）を保有した場合に受益者が負担する実質的な信託報酬率の合計値は以下のとおりです。

各ファンド〔安定型：0.1688%程度、安定成長型：0.1976%程度、成長型：0.2220%程度〕（年率、税抜）

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

ファンド	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率			
	合計	委託会社	販売会社	受託会社
Smart - i 8資産バランス 安定型	0.16%	0.07%	0.07%	0.02%
Smart - i 8資産バランス 安定成長型	0.18%	0.08%	0.08%	
Smart - i 8資産バランス 成長型	0.20%	0.09%	0.09%	

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。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

### （４）【その他の手数料等】

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な費用（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。

確定拠出年金の場合

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税はかかりません。

なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されません。

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

### １）収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については配当所得として、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収（原則として、確定申告は不要です。）が行なわれます。

なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）のいずれかを選択することもできます。

### ２）解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）<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。

\* 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）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）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。なお、確定拠出年金制度を通じて公募株式投資信託な

どを購入する場合は、NISAをご利用になれません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

#### 法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

#### 個別元本

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

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

#### 普通分配金と元本払戻金（特別分配金）

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

##### 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

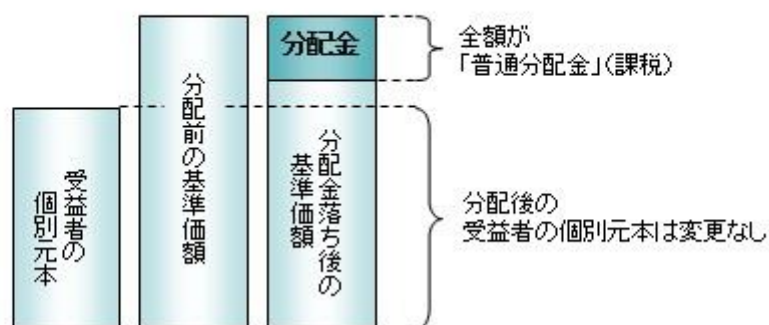
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

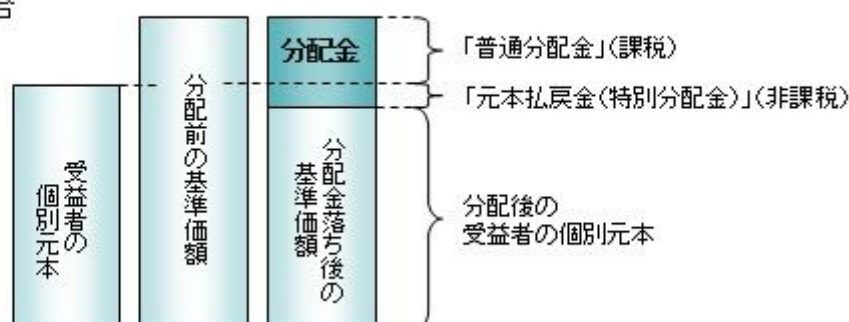
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

#### <分配金に関するイメージ図>

##### イ) の場合



##### ロ)、ハ) の場合



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



上記は2020年9月末現在のものですので、税法または確定拠出年金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】

### 【Smart-i 8資産バランス 安定型】

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	1,838,224,052	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		5,519,176	0.30
合計(純資産総額)		1,843,743,228	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先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	486,707,936	1.0585	515,211,790	1.0752	523,308,372	28.38
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	497,125,149	1.0542	524,118,971	1.0525	523,224,219	28.38
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	278,496,797	1.0456	291,201,852	1.0633	296,125,644	16.06
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	135,717,442	1.1750	159,477,207	1.3729	186,326,476	10.11
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	125,059,266	1.0517	131,528,701	1.1627	145,406,408	7.89
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	42,505,837	1.1198	47,601,472	1.2948	55,036,557	2.99
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	39,320,899	0.8586	33,764,055	0.9298	36,560,571	1.98
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	30,060,493	1.1297	33,960,109	1.2032	36,168,785	1.96
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	35,706,386	0.9844	35,150,471	1.0101	36,067,020	1.96

##### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

## 【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 (2019年 3月25日)	123	123	1.0230	1.0230
第2計算期間末 (2020年 3月25日)	829	829	1.0151	1.0151
2019年 9月末日	373		1.0559	
10月末日	430		1.0649	
11月末日	508		1.0688	
12月末日	604		1.0732	
2020年 1月末日	814		1.0792	
2月末日	845		1.0645	
3月末日	873		1.0236	
4月末日	939		1.0397	
5月末日	1,057		1.0537	
6月末日	1,185		1.0618	
7月末日	1,282		1.0699	
8月末日	1,372		1.0826	
9月末日	1,843		1.0813	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	0.0000
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	0.0000
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
---	----	--------

第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	2.30
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	0.77
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	5.92

(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	2018年 3月27日～2019年 3月25日	124,139,157	3,062,288
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	825,653,926	129,743,802
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	941,670,985	75,712,860

(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。

#### 【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

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	1,833,156,204	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		5,380,886	0.29
合計（純資産総額）		1,838,537,090	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先進国株式マザーファンド	284,020,173	1.1302	321,008,570	1.3729	389,931,295	21.21
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	297,779,663	1.0297	306,635,492	1.1627	346,228,414	18.83
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)	264,489,723	1.0562	279,365,325	1.0752	284,379,350	15.47
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	269,087,079	1.0550	283,908,642	1.0525	283,214,150	15.40
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	137,590,713	1.0395	143,032,296	1.0633	146,300,205	7.96
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	99,024,359	1.0726	106,220,587	1.2948	128,216,740	6.97

日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	76,174,390	1.1191	85,249,046	1.2032	91,653,026	4.99
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	98,293,646	0.8288	81,467,270	0.9298	91,393,432	4.97
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	71,121,268	0.9691	68,929,738	1.0101	71,839,592	3.91

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.71
合 計	99.71

### 【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 (2019年 3月25日)	260	260	1.0267	1.0267
第2計算期間末 (2020年 3月25日)	963	963	0.9587	0.9587
2019年 9月末日	535		1.0606	
10月末日	597		1.0867	
11月末日	715		1.0979	
12月末日	842		1.1111	
2020年 1月末日	1,036		1.1102	
2月末日	1,046		1.0620	
3月末日	1,025		0.9725	
4月末日	1,130		1.0097	
5月末日	1,368		1.0395	
6月末日	1,504		1.0510	
7月末日	1,613		1.0588	
8月末日	1,753		1.0970	
9月末日	1,838		1.0859	

### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	0.0000
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	0.0000
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	2.67
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	6.62
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	12.18

(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	2018年 3月27日～2019年 3月25日	261,794,625	7,945,303
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	877,655,176	126,852,901
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	755,884,234	87,434,133

(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。

## 【Smart-i 8資産バランス 成長型】

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	1,468,266,006	99.71
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		4,336,925	0.29
合計（純資産総額）		1,472,602,931	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先進国株式マザーファンド	303,917,613	1.1208	340,639,404	1.3729	417,248,490	28.33
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	324,730,295	1.0282	333,916,931	1.1627	377,563,913	25.64
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	114,044,826	1.0670	121,694,671	1.2948	147,665,240	10.03
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	111,317,777	0.8243	91,760,145	0.9298	103,503,269	7.03
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)	94,677,902	1.0561	99,991,976	1.0752	101,797,680	6.91
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	96,703,770	1.0552	102,044,591	1.0525	101,780,717	6.91
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	72,920,035	1.1176	81,497,490	1.2032	87,737,386	5.96
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	71,951,707	0.9669	69,572,366	1.0101	72,678,419	4.94
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	54,820,740	1.0388	56,952,611	1.0633	58,290,892	3.96

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.71
合計	99.71

### 【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 (2019年 3月25日)	297	297	1.0266	1.0266
第2計算期間末 (2020年 3月25日)	778	778	0.9218	0.9218
2019年 9月末日	547		1.0587	
10月末日	606		1.0959	
11月末日	677		1.1120	
12月末日	766		1.1315	
2020年 1月末日	850		1.1255	
2月末日	853		1.0558	

3月末日	837		0.9402
4月末日	947		0.9902
5月末日	1,109		1.0286
6月末日	1,230		1.0428
7月末日	1,300		1.0508
8月末日	1,429		1.1046
9月末日	1,472		1.0871

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	0.0000
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	0.0000
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2018年 3月27日～2019年 3月25日	2.66
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	10.21
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	16.47

(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	2018年 3月27日～2019年 3月25日	298,802,333	8,522,699
第2期	2019年 3月26日～2020年 3月25日	673,047,247	118,268,425
当中間期	2020年 3月26日～2020年 9月25日	573,588,280	90,546,024

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## (参考)

## RAM国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 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。

#### RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2020年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
イスラエルシュケル	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先進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（％）
国債証券	アメリカ	12,212,353,143	43.22
	カナダ	526,944,371	1.87
	メキシコ	204,491,738	0.72
	ドイツ	2,151,415,788	7.61
	イタリア	2,629,759,573	9.31
	フランス	2,956,445,350	10.46
	オランダ	535,622,534	1.90
	スペイン	1,702,291,696	6.02
	ベルギー	728,080,365	2.58
	オーストリア	446,030,036	1.58
	フィンランド	171,096,062	0.61
	アイルランド	229,967,430	0.81
	イギリス	1,829,853,695	6.48
	スウェーデン	82,001,984	0.29
	ノルウェー	56,172,961	0.20
	デンマーク	149,264,305	0.53
	ポーランド	174,675,338	0.62
	オーストラリア	671,682,814	2.38
	シンガポール	120,520,234	0.43
	マレーシア	139,383,120	0.49
イスラエル	110,636,736	0.39	
	小計	27,828,689,273	98.49
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		425,540,762	1.51
合計（純資産総額）		28,254,230,035	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		97,203,154	0.34

(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	1,170,000	12,035.37	140,813,858	12,525.72	146,551,012	2.875	2028/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,787.56	143,474,670	10,916.41	145,188,254	1.625	2022/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	11,310.20	131,198,433	11,452.85	132,853,060	1.500	2030/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	11,137.58	118,058,357	11,479.71	121,684,954	2.000	2025/8/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,130,000	10,598.15	119,759,139	10,652.73	120,375,934	0.500	2027/4/30	0.43
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	18,976.77	117,656,017	18,831.84	116,757,427	5.500	2029/4/25	0.41
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	490,000	22,621.45	110,845,119	23,457.45	114,941,511	4.500	2041/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	12,049.39	107,239,660	12,780.30	113,744,749	3.125	2028/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	10,593.91	109,117,330	10,711.01	110,323,403	1.250	2021/10/31	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	490,000	21,389.64	104,809,277	21,503.74	105,368,366	5.750	2032/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,469.77	97,493,113	12,340.16	104,891,393	2.750	2028/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	900,000	11,106.71	99,960,475	11,353.86	102,184,819	1.625	2026/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	10,851.31	96,576,737	11,304.48	100,609,884	2.125	2024/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,041.42	92,747,992	11,832.65	99,394,302	2.250	2027/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,857.19	92,286,166	11,634.69	98,894,896	2.000	2026/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,299.63	96,046,933	11,474.75	97,535,406	2.500	2024/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	800,000	11,880.04	95,040,338	11,895.47	95,163,791	2.250	2027/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	640,000	12,820.23	82,049,499	14,636.35	93,672,672	3.000	2049/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	630,000	12,548.04	79,052,683	14,586.76	91,896,596	3.000	2048/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	790,000	10,987.33	86,799,907	11,476.40	90,663,610	2.375	2024/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	730,000	11,731.99	85,643,566	12,395.95	90,490,489	2.625	2029/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	10,577.49	89,908,704	10,513.87	89,367,936	1.125	2040/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	810,000	10,675.88	86,474,638	10,804.41	87,515,731	2.000	2021/11/15	0.31
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	570,000	15,268.81	87,032,243	15,332.98	87,398,005	2.750	2027/10/25	0.31
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	410,000	20,861.30	85,531,351	21,281.62	87,254,644	4.750	2035/4/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	560,000	13,495.72	75,576,081	15,574.09	87,214,904	3.375	2048/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	750,000	10,942.89	82,071,705	11,471.44	86,035,856	2.250	2024/11/15	0.30
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	670,000	12,534.95	83,984,202	12,814.95	85,860,181	0.000	2029/11/25	0.30
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	400,000	20,390.40	81,561,620	21,244.05	84,976,236	2.500	2046/8/15	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	680,000	11,591.44	78,821,847	12,482.74	84,882,675	2.875	2028/5/15	0.30

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.49

合 計	98.49
-----	-------

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	371,200.00	39,140,441	39,269,248	0.14
	ユーロ	買建	377,800.00	46,340,910	46,911,426	0.17
	英ポンド	買建	81,000.00	10,906,066	11,022,480	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
	バミューダ	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-CL 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。

#### RAM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	アクティビア・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	大和証券リビング投資法人	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。

## 参考情報

## 運用実績

## Smart-i 8資産バランス 安定型

2020年9月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2019年3月25日	0円
2020年3月25日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ●資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	28.4
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	28.4
RAM先進国債券マザーファンド	16.1
RAM新興国債券マザーファンド	2.0
RAM国内株式マザーファンド	7.9
RAM先進国株式マザーファンド	10.1
RAM新興国株式マザーファンド	3.0
RAM国内リートマザーファンド	2.0
RAM先進国リートマザーファンド	2.0
現金等	0.3
合計	100.0

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

## ●通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	67.2
米ドル	16.9
ユーロ	7.9
英ポンド	1.5
豪ドル	0.7
その他	5.8
合計	100.0

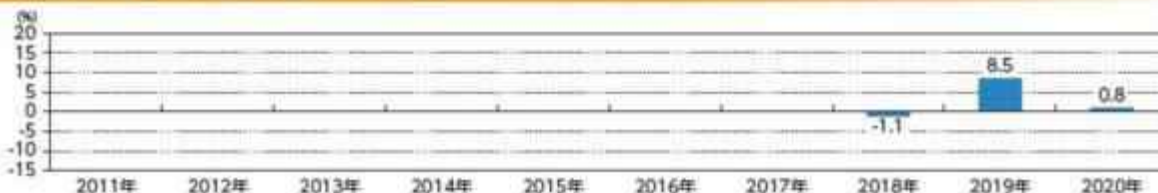
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。  
 ※為替ヘッジをかけている外貨建て資産については、日本円に含めています。

## ●各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産	国・地域	銘柄名	発行日	比率(%)
国内債券	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.45
	日本	第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.31
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.21
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.46
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/11/15	0.45
(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.43
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/8/15	0.52
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/11/15	0.51
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/2/15	0.47
新興国債券	アイルランド	iSHARES JPM EM LCL GOV BND	-	66.62
	アメリカ	VANECK VECTORS JP. MORGAN E	-	32.59
国内株式	日本	トヨタ自動車	-	3.34
	日本	ソフトバンクグループ	-	2.18
	日本	ソニー	-	2.17
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	-	3.88
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	2.93
	アメリカ	AMAZON.COM INC	-	2.62
新興国株式	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-5P ADR	-	6.48
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	4.66
国内リート	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	4.55
	日本	日本ビルファンド投資法人	-	6.18
先進国リート	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	-	5.76
	日本	日本プロロジスリート投資法人	-	5.76
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	-	6.63
	アメリカ	EQUINIX INC	-	6.10
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	3.58

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。  
 ※2018年3月27日が設定日のため、2017年以前の実績はありません。2018年は3月27日から12月末までの騰落率です。2020年は9月末までの騰落率です。  
 ※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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



## Smart-i 8資産バランス 安定成長型

2020年9月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万口当たり、運用管理費用（信託報酬）控除後の価額です。

※分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を再投資したものと計算しております。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2019年3月25日	0円
2020年3月25日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	15.4
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	15.5
RAM先進国債券マザーファンド	8.0
RAM新興国債券マザーファンド	3.9
RAM国内株式マザーファンド	18.8
RAM先進国株式マザーファンド	21.2
RAM新興国株式マザーファンド	7.0
RAM国内リートマザーファンド	5.0
RAM先進国リートマザーファンド	5.0
現金等	0.3
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

## ■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	55.1
米ドル	25.2
ユーロ	6.1
英ポンド	1.5
香港ドル	1.5
その他	10.5
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

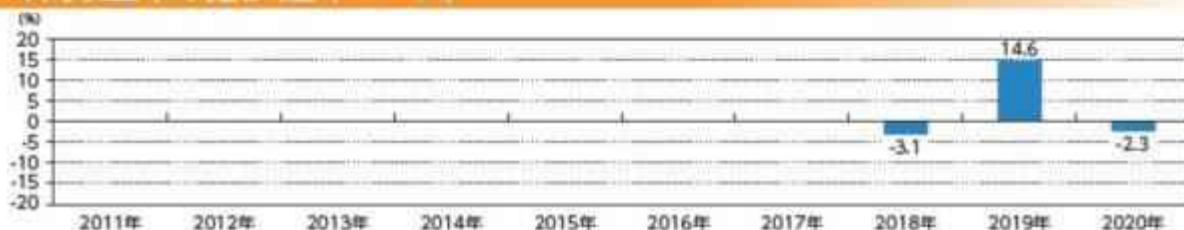
※為替ヘッジをかけている外貨建資産については、日本円に含めていきます。

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産	国・地域	銘柄名	買付日	比率(%)
国内債券	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.45
	日本	第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.31
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.21
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.46
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/11/15	0.45
	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.43
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/8/15	0.52
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/11/15	0.51
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/2/15	0.47
	アイルランド	SHARES JPM EM LCL GOV BND	-	66.62
新興国債券	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	-	32.59
国内株式	日本	トヨタ自動車	-	3.34
	日本	ソフトバンクグループ	-	2.18
国内株式	日本	ソニー	-	2.17
	アメリカ	APPLE INC	-	3.88
先進国株式	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	2.93
	アメリカ	AMAZON.COM INC	-	2.62
新興国株式	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	-	6.48
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	4.66
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	4.55
	日本	日本ビルファンド投資法人	-	6.18
国内リート	日本	ジャパニリアルエステイト投資法人	-	5.76
	日本	日本プロロジスリート投資法人	-	5.76
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	-	6.63
	アメリカ	EQUINIX INC	-	6.10
先進国リート	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	3.58

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。

※2018年3月27日が設定日のため、2017年以前の実績はありません。2018年は3月27日から12月末までの騰落率です。2020年は9月末までの騰落率です。

※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

※運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※運用実績については、別途、委託会社のホームページで開示しています。

## Smart-i 8資産バランス 成長型

2020年9月30日現在

## 基準価額・純資産の推移



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

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2019年3月25日	0円
2020年3月25日	0円
-	-
-	-
-	-
設定来累計	0円

## 主要な資産の状況

## ■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	6.9
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	6.9
RAM先進国債券マザーファンド	4.0
RAM新興国債券マザーファンド	4.9
RAM国内株式マザーファンド	25.6
RAM先進国株式マザーファンド	28.3
RAM新興国株式マザーファンド	10.0
RAM国内リートマザーファンド	6.0
RAM先進国リートマザーファンド	7.0
現金等	0.3
合計	100.0

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

## ■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	45.8
米ドル	31.3
ユーロ	5.5
香港ドル	2.2
英ポンド	1.7
その他	13.6
合計	100.0

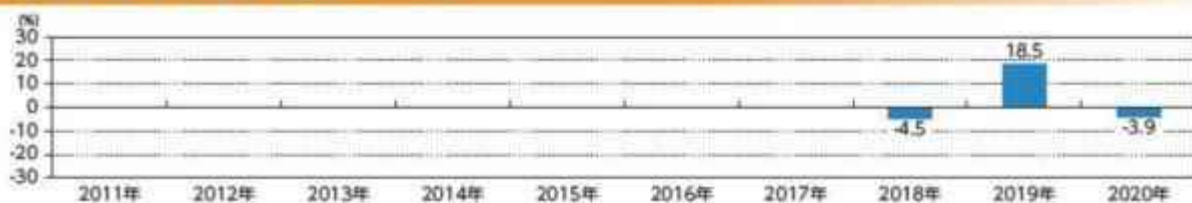
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。  
※為替ヘッジをかけている外貨資産については、日本円に含めています。

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

資産	国・地域	銘柄	最終決算日	比率(%)
国内債券	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.45
	日本	第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.31
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.21
先進国債券 (為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.46
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/11/15	0.45
先進国債券 (為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15	0.43
	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/8/15	0.52
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/11/15	0.51
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/2/15	0.47
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	-	66.62
	アメリカ	VANECK VECTORS JP. MORGAN E	-	32.59
国内株式	日本	トヨタ自動車	-	3.34
	日本	ソフトバンクグループ	-	2.18
	日本	ソニー	-	2.17
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	-	3.88
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	2.93
	アメリカ	AMAZON.COM INC	-	2.62
新興国株式	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	-	6.48
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	4.66
国内リート	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	4.55
	日本	日本ビルファンド投資法人	-	6.18
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	-	5.76
先進国リート	日本	日本プロロジスリート投資法人	-	5.76
	アメリカ	PROLOGIS INC	-	6.63
	アメリカ	EQUINIX INC	-	6.10
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	3.58

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。  
※2018年3月27日が設定日のため、2017年以前の実績はありません。2018年は3月27日から12月末までの騰落率です。2020年は9月末までの騰落率です。  
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込(販売)手続等】

## (1) 申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

(2) コースの選択

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

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

(3) 申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(4) 取扱時間

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

(5) 取得申込不可日

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

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

(6) 申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

(7) 申込単位

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

(8) 申込代金の支払い

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

(9) 受付の中止および取消

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

(1) 解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2) 取扱時間

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

(3) 解約請求不可日

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

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

(4) 解約制限

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

(5) 解約価額



解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

#### （6）手取額

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

確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税はかかりません。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

#### （7）解約単位

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

#### （8）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

#### （9）受付の中止および取消

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

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

### 3【資産管理等の概要】

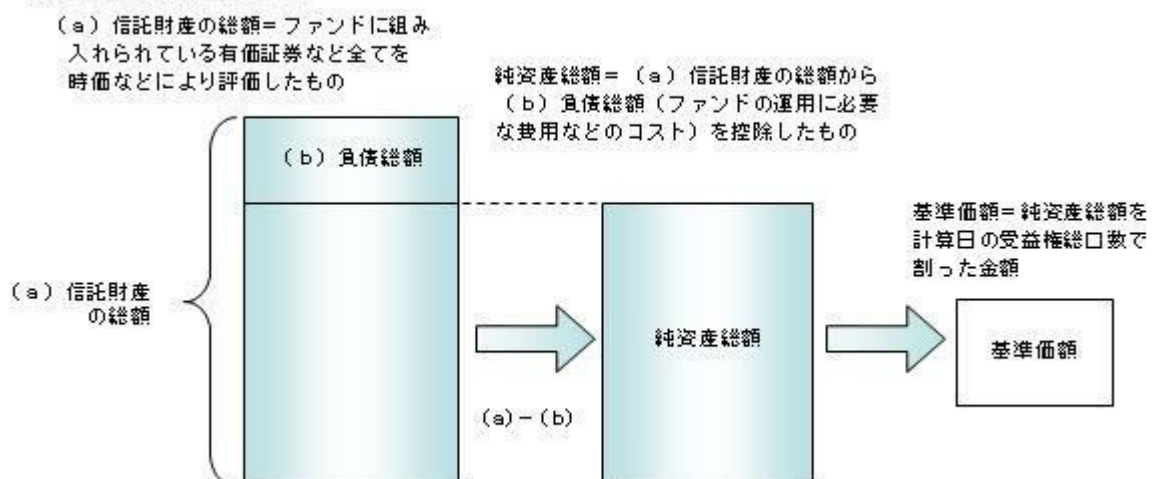
#### （1）【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。

- ・基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当たり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】

無期限とします(2018年3月27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3月26日から翌年3月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5) 【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
  - イ) 各ファンドの信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

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

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

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

ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

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

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

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

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

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

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

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。

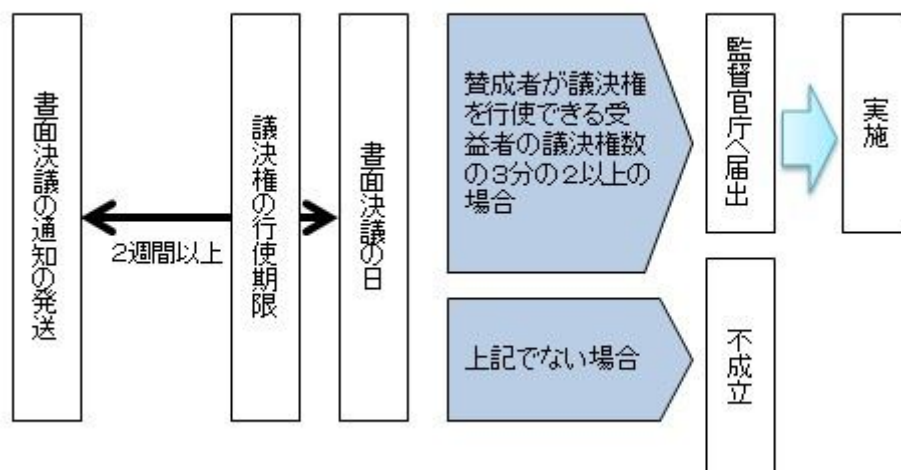
3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

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

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

## 関係法人との契約について

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

## 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

Smart-i 8資産バランス 安定型  
Smart-i 8資産バランス 安定成長型  
Smart-i 8資産バランス 成長型

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2019年 3月26日から2020年 3月25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】



## 【Smart-i 8資産バランス 安定型】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	4,522,153
コール・ローン	714,297	-
親投資信託受益証券	123,491,010	828,144,628
流動資産合計	124,205,307	832,666,781
資産合計	124,205,307	832,666,781
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	286,817	2,797,361
未払受託者報酬	6,581	67,395
未払委託者報酬	45,997	471,684
未払利息	1	-
その他未払費用	3,198	28,845
流動負債合計	342,594	3,365,285
負債合計	342,594	3,365,285
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	121,076,869	816,986,993
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,785,844	12,314,503
（分配準備積立金）	2,100,887	9,560,603
元本等合計	123,862,713	829,301,496
純資産合計	123,862,713	829,301,496
負債純資産合計	124,205,307	832,666,781

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第1期		第2期	
	自	2018年 3月27日	自	2019年 3月26日
	至	2019年 3月25日	至	2020年 3月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,166,010		30,539,382
営業収益合計		2,166,010		30,539,382
営業費用				
支払利息		82		2,275
受託者報酬		6,828		93,618
委託者報酬		47,694		655,191
その他費用		3,444		39,932
営業費用合計		58,048		791,016
営業利益又は営業損失( )		2,107,962		31,330,398
経常利益又は経常損失( )		2,107,962		31,330,398
当期純利益又は当期純損失( )		2,107,962		31,330,398
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( )		7,075		1,177,783
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		2,785,844
剰余金増加額又は欠損金減少額		697,334		47,931,885
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		697,334		47,931,885
剰余金減少額又は欠損金増加額		12,377		5,895,045
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		12,377		5,895,045
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		2,785,844		12,314,503

## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 121,076,869円
期中追加設定元本額 124,039,157円	期中追加設定元本額 825,653,926円
期中一部解約元本額 3,062,288円	期中一部解約元本額 129,743,802円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 121,076,869口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 816,986,993口
3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0230円	3. 計算期間の末日における1単位の純資産の額 1.0151円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,230円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,151円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 654,195円	A 費用控除後の配当等収益額 7,961,212円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 1,446,692円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 684,957円	C 収益調整金額 14,647,340円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 1,599,391円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 2,785,844円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 24,207,943円
F 当ファンドの期末残存口数 121,076,869口	F 当ファンドの期末残存口数 816,986,993口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F × 10,000) 230円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F × 10,000) 296円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F × H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F × H/10,000) 0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
<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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</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>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</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> <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。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
該当事項はありません。	同左

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,168,602	31,718,519
合計	2,168,602	31,718,519

## 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	225,107,907	237,758,971	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	225,210,908	236,831,790	
	R A M先進国債券マザーファンド	132,972,310	138,051,852	
	R A M新興国債券マザーファンド	15,338,255	14,350,471	
	R A M国内株式マザーファンド	74,128,849	73,928,701	
	R A M先進国株式マザーファンド	74,402,216	78,137,207	
	R A M新興国株式マザーファンド	21,286,920	21,461,472	
	R A M国内リートマザーファンド	13,923,354	15,530,109	
	R A M先進国リートマザーファンド	15,567,068	12,094,055	
合計		797,937,787	828,144,628	

(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。

## 【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	6,657,466
コール・ローン	1,943,061	-
親投資信託受益証券	258,844,318	957,835,613
流動資産合計	260,787,379	964,493,079
<b>資産合計</b>	260,787,379	964,493,079
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	4,928	490,000
未払受託者報酬	15,133	88,819
未払委託者報酬	121,022	710,491
未払利息	5	-
その他未払費用	7,473	38,109
流動負債合計	148,561	1,327,419
<b>負債合計</b>	148,561	1,327,419
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	253,849,322	1,004,651,597
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,789,496	41,485,937
（分配準備積立金）	3,670,270	15,633,443
元本等合計	260,638,818	963,165,660
<b>純資産合計</b>	260,638,818	963,165,660
<b>負債純資産合計</b>	260,787,379	964,493,079

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	自	2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		3,784,818		105,052,705
営業収益合計		3,784,818		105,052,705
営業費用				
支払利息		279		2,925
受託者報酬		15,577		131,965
委託者報酬		124,536		1,055,609
その他費用		7,798		56,404
営業費用合計		148,190		1,246,903
営業利益又は営業損失（ ）		3,636,628		106,299,608
経常利益又は経常損失（ ）		3,636,628		106,299,608
当期純利益又は当期純損失（ ）		3,636,628		106,299,608
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（ ）		33,642		573,664
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		6,789,496
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,230,877		64,214,895
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,230,877		64,214,895
剰余金減少額又は欠損金増加額		111,651		6,764,384
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		111,651		6,764,384
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		6,789,496		41,485,937



## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 253,849,322円
期中追加設定元本額 261,694,625円	期中追加設定元本額 877,655,176円
期中一部解約元本額 7,945,303円	期中一部解約元本額 126,852,901円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 253,849,322口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,004,651,597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 41,485,937円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0267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 0.9587円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,267円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,587円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 1,504,950円	A 費用控除後の配当等収益額 12,631,006円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 2,165,320円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 3,119,226円	C 収益調整金額 14,022,357円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 3,002,437円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 6,789,496円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 29,655,800円
F 当ファンドの期末残存口数 253,849,322口	F 当ファンドの期末残存口数 1,004,651,597口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 267円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 295円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
<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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</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>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
該当事項はありません。	同左

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	3,728,592	107,533,055
合計	3,728,592	107,533,055

## 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	136,371,882	144,035,981	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	136,841,945	143,902,989	
	R A M先進国債券マザーファンド	72,319,685	75,082,296	
	R A M新興国債券マザーファンド	38,851,794	36,349,738	
	R A M国内株式マザーファンド	204,954,468	204,401,090	
	R A M先進国株式マザーファンド	188,204,408	197,652,269	
	R A M新興国株式マザーファンド	61,999,724	62,508,121	
	R A M国内リートマザーファンド	46,641,026	52,023,400	
	R A M先進国リートマザーファンド	53,906,204	41,879,729	
合計		940,091,136	957,835,613	

(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。

## 【Smart-i 8資産バランス 成長型】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	7,239,008
コール・ローン	1,168,519	-
親投資信託受益証券	297,236,299	774,225,614
流動資産合計	298,404,818	781,464,622
資産合計	298,404,818	781,464,622
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	208,966	1,705,052
未払受託者報酬	18,978	79,045
未払委託者報酬	170,752	711,392
未払利息	3	-
その他未払費用	9,407	33,888
流動負債合計	408,106	2,529,377
負債合計	408,106	2,529,377
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	290,279,634	845,058,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,717,078	66,123,211
(分配準備積立金)	5,893,078	17,459,931
元本等合計	297,996,712	778,935,245
純資産合計	297,996,712	778,935,245
負債純資産合計	298,404,818	781,464,622

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2018年 3月27日	自	2019年 3月26日
	至	2019年 3月25日	至	2020年 3月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		6,172,199		110,475,685
営業収益合計		6,172,199		110,475,685
営業費用				
支払利息		382		3,133
受託者報酬		19,639		124,760
委託者報酬		176,756		1,122,744
その他費用		9,853		53,298
営業費用合計		206,630		1,303,935
営業利益又は営業損失( )		5,965,569		111,779,620
経常利益又は経常損失( )		5,965,569		111,779,620
当期純利益又は当期純損失( )		5,965,569		111,779,620
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( )		72,491		838,394
期首剰余金又は期首欠損金( )		-		7,717,078
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,898,691		42,690,642
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,898,691		42,690,642
剰余金減少額又は欠損金増加額		74,691		5,589,705
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		74,691		5,589,705
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		7,717,078		66,123,211

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2019年 3月25日現在	第2期 2020年 3月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 100,000円	期首元本額 290,279,634円
期中追加設定元本額 298,702,333円	期中追加設定元本額 673,047,247円
期中一部解約元本額 8,522,699円	期中一部解約元本額 118,268,425円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 290,279,634口	2. 計算期間の末日における受益権の総数 845,058,456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 66,123,211円
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0266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 0.9218円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,266円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,218円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
分配金の計算過程	分配金の計算過程
A 費用控除後の配当等収益額 1,982,760円	A 費用控除後の配当等収益額 12,713,887円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 3,910,318円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 0円
C 収益調整金額 1,824,000円	C 収益調整金額 14,465,764円
D 分配準備積立金額 0円	D 分配準備積立金額 4,746,044円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 7,717,078円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D) 31,925,695円
F 当ファンドの期末残存口数 290,279,634口	F 当ファンドの期末残存口数 845,058,456口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 265円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000) 377円
H 10,000口当たり分配金額 0円	H 10,000口当たり分配金額 0円
I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円	I 収益分配金金額 (I=F×H/10,000) 0円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
<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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</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>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
該当事項はありません。	同左

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2018年 3月27日 至 2019年 3月25日	第2期 自 2019年 3月26日 至 2020年 3月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	6,092,077	111,069,149
合計	6,092,077	111,069,149

## 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	48,214,913	50,924,591	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	48,765,667	51,281,975	
	R A M先進国債券マザーファンド	28,590,456	29,682,611	
	R A M新興国債券マザーファンド	38,491,200	36,012,366	
	R A M国内株式マザーファンド	223,222,871	222,620,169	
	R A M先進国株式マザーファンド	199,928,650	209,965,068	
	R A M新興国株式マザーファンド	72,669,993	73,265,886	
	R A M国内リートマザーファンド	46,447,454	51,807,490	
	R A M先進国リートマザーファンド	62,640,569	48,665,458	
合計		768,971,773	774,225,614	

(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）

「Smart-i 8資産バランス」の各ファンドは「RAM国内債券マザーファンド」、「RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RAM先進国債券マザーファンド」、「RAM新興国債券マザーファンド」、「RAM国内株式マザーファンド」、「RAM先進国株式マザーファンド」、「RAM新興国株式マザーファンド」、「RAM国内リートマザーファンド」および「RAM先進国リートマザーファンド」受

益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

## R A M国内債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2020年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	467,426,333
国債証券	48,154,113,870
地方債証券	3,916,654,600
特殊債券	4,778,126,251
社債券	3,396,378,000
未収入金	792,496,000
未収利息	64,338,562
前払費用	6,301,002
流動資産合計	61,575,834,618
資産合計	61,575,834,618
負債の部	
流動負債	
未払金	886,472,100
未払解約金	126,541,000
その他未払費用	23,167
流動負債合計	1,013,036,267
負債合計	1,013,036,267
純資産の部	
元本等	
元本	57,341,519,752
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	3,221,278,599
元本等合計	60,562,798,351
純資産合計	60,562,798,351
負債純資産合計	61,575,834,618

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日

期首元本額	63,710,013,442円
期中追加設定元本額	54,845,140,473円
期中一部解約元本額	61,213,634,163円
期末元本額	57,341,519,752円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,679,805,281円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,597,175,308円
りそなラップ型ファンド(成長型)	358,844,004円
DCりそな グローバルバランス	345,951,593円
つみたてバランスファンド	941,927,092円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	740,621,237円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	137,163,071円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	26,906,251円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	8,418,974円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,550,881円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	235,240円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	12,410円
FWりそな円建債券アクティブファンド	66,225,121円
FWりそな国内債券インデックスファンド	39,842,271,771円
Smart-i 国内債券インデックス	591,235,750円
Smart-i 8資産バランス 安定型	225,107,907円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	136,371,882円
Smart-i 8資産バランス 成長型	48,214,913円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	7,258,284円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	5,584,644,415円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	578,367円
2. 計算日における受益権の総数	57,341,519,752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	1.0562円
(10,000口当たり純資産額)	(10,562円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 3月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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

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

### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25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 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	481,106,650	
地方債証券	28,495,400	
特殊債券	21,370,765	

社債券	39,107,000
合計	570,079,815

(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399回利付国債(2年)	60,000,000	60,213,600	
	第400回利付国債(2年)	60,000,000	60,224,400	
	第401回利付国債(2年)	300,000,000	301,173,000	
	第402回利付国債(2年)	150,000,000	150,618,000	
	第403回利付国債(2年)	30,000,000	30,129,900	
	第404回利付国債(2年)	170,000,000	170,770,100	
	第405回利付国債(2年)	30,000,000	30,141,600	
	第406回利付国債(2年)	130,000,000	130,647,400	
	第407回利付国債(2年)	200,000,000	201,048,000	
	第408回利付国債(2年)	200,000,000	201,100,000	
	第409回利付国債(2年)	100,000,000	100,577,000	
	第128回利付国債(5年)	120,000,000	120,475,200	
	第129回利付国債(5年)	450,000,000	452,146,500	
	第130回利付国債(5年)	240,000,000	241,296,000	
	第131回利付国債(5年)	360,000,000	362,149,200	
	第132回利付国債(5年)	240,000,000	241,588,800	
	第133回利付国債(5年)	760,000,000	765,502,400	
	第134回利付国債(5年)	590,000,000	594,702,300	
	第135回利付国債(5年)	430,000,000	433,741,000	

第136回利付国債（5年）	300,000,000	302,634,000	
第137回利付国債（5年）	200,000,000	201,716,000	
第138回利付国債（5年）	190,000,000	191,639,700	
第139回利付国債（5年）	660,000,000	665,940,000	
第140回利付国債（5年）	530,000,000	534,960,800	
第141回利付国債（5年）	140,000,000	141,356,600	
第142回利付国債（5年）	50,000,000	50,487,500	
第1回利付国債（40年）	40,000,000	61,054,800	
第2回利付国債（40年）	100,000,000	148,681,000	
第3回利付国債（40年）	110,000,000	165,221,100	
第4回利付国債（40年）	110,000,000	166,882,100	
第5回利付国債（40年）	110,000,000	161,972,800	
第6回利付国債（40年）	110,000,000	159,943,300	
第7回利付国債（40年）	120,000,000	168,178,800	
第8回利付国債（40年）	130,000,000	170,944,800	
第9回利付国債（40年）	250,000,000	247,277,500	
第10回利付国債（40年）	220,000,000	254,617,000	
第11回利付国債（40年）	170,000,000	191,474,400	
第12回利付国債（40年）	150,000,000	153,249,000	
第315回利付国債（10年）	295,000,000	300,189,050	
第316回利付国債（10年）	300,000,000	304,905,000	
第317回利付国債（10年）	40,000,000	40,788,000	
第318回利付国債（10年）	366,000,000	372,661,200	
第319回利付国債（10年）	240,000,000	245,457,600	
第320回利付国債（10年）	202,000,000	206,242,000	
第321回利付国債（10年）	241,000,000	246,733,390	
第322回利付国債（10年）	220,000,000	224,796,000	
第323回利付国債（10年）	340,000,000	348,319,800	
第324回利付国債（10年）	183,000,000	187,066,260	
第325回利付国債（10年）	330,000,000	338,121,300	
第326回利付国債（10年）	280,000,000	286,776,000	
第327回利付国債（10年）	387,000,000	397,429,650	
第328回利付国債（10年）	411,000,000	420,613,290	
第329回利付国債（10年）	297,000,000	306,322,830	
第330回利付国債（10年）	257,000,000	265,511,840	
第331回利付国債（10年）	90,000,000	92,349,900	
第332回利付国債（10年）	532,000,000	546,582,120	
第333回利付国債（10年）	225,000,000	231,529,500	
第334回利付国債（10年）	261,000,000	269,057,070	
第335回利付国債（10年）	345,000,000	354,729,000	
第336回利付国債（10年）	180,000,000	185,315,400	
第337回利付国債（10年）	170,000,000	173,359,200	

第338回利付国債(10年)	371,000,000	380,479,050
第339回利付国債(10年)	115,000,000	118,056,700
第340回利付国債(10年)	494,000,000	507,767,780
第341回利付国債(10年)	150,000,000	153,505,500
第342回利付国債(10年)	30,000,000	30,360,900
第343回利付国債(10年)	230,000,000	232,884,200
第344回利付国債(10年)	320,000,000	324,179,200
第345回利付国債(10年)	130,000,000	131,762,800
第346回利付国債(10年)	360,000,000	364,932,000
第347回利付国債(10年)	40,000,000	40,553,200
第348回利付国債(10年)	90,000,000	91,219,500
第349回利付国債(10年)	320,000,000	324,230,400
第350回利付国債(10年)	230,000,000	232,950,900
第351回利付国債(10年)	130,000,000	131,612,000
第352回利付国債(10年)	330,000,000	333,791,700
第353回利付国債(10年)	380,000,000	383,990,000
第354回利付国債(10年)	320,000,000	323,017,600
第355回利付国債(10年)	350,000,000	353,066,000
第356回利付国債(10年)	520,000,000	523,936,400
第357回利付国債(10年)	380,000,000	382,580,200
第1回利付国債(30年)	60,000,000	75,723,600
第7回利付国債(30年)	40,000,000	50,292,400
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,747,500
第12回利付国債(30年)	40,000,000	50,014,000
第13回利付国債(30年)	90,000,000	111,583,800
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,850,000
第15回利付国債(30年)	160,000,000	210,499,200
第16回利付国債(30年)	70,000,000	92,407,700
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,512,000
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,989,200
第19回利付国債(30年)	100,000,000	130,374,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	133,747,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	118,024,200
第22回利付国債(30年)	50,000,000	67,342,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	216,336,000
第24回利付国債(30年)	100,000,000	135,736,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	132,932,000
第26回利付国債(30年)	145,000,000	195,789,150
第27回利付国債(30年)	215,000,000	295,803,450
第28回利付国債(30年)	110,000,000	152,331,300
第29回利付国債(30年)	70,000,000	96,338,900
第30回利付国債(30年)	190,000,000	259,883,900
第31回利付国債(30年)	130,000,000	176,776,600



第32回利付国債(30年)	215,000,000	298,316,800	
第33回利付国債(30年)	180,000,000	240,453,000	
第34回利付国債(30年)	145,000,000	200,374,050	
第35回利付国債(30年)	256,000,000	344,893,440	
第36回利付国債(30年)	245,000,000	331,578,100	
第37回利付国債(30年)	190,000,000	254,309,300	
第38回利付国債(30年)	150,000,000	198,376,500	
第39回利付国債(30年)	170,000,000	229,081,800	
第40回利付国債(30年)	125,000,000	165,957,500	
第41回利付国債(30年)	125,000,000	163,415,000	
第42回利付国債(30年)	140,000,000	183,237,600	
第43回利付国債(30年)	140,000,000	183,659,000	
第44回利付国債(30年)	120,000,000	157,604,400	
第45回利付国債(30年)	150,000,000	190,354,500	
第46回利付国債(30年)	170,000,000	215,906,800	
第47回利付国債(30年)	170,000,000	220,294,500	
第48回利付国債(30年)	163,000,000	203,525,060	
第49回利付国債(30年)	160,000,000	199,900,800	
第50回利付国債(30年)	150,000,000	165,288,000	
第51回利付国債(30年)	180,000,000	175,933,800	
第52回利付国債(30年)	200,000,000	205,280,000	
第53回利付国債(30年)	120,000,000	126,100,800	
第54回利付国債(30年)	160,000,000	176,230,400	
第55回利付国債(30年)	80,000,000	88,184,000	
第56回利付国債(30年)	150,000,000	165,267,000	
第57回利付国債(30年)	160,000,000	176,419,200	
第58回利付国債(30年)	240,000,000	264,825,600	
第59回利付国債(30年)	150,000,000	161,620,500	
第60回利付国債(30年)	150,000,000	169,612,500	
第61回利付国債(30年)	140,000,000	150,824,800	
第62回利付国債(30年)	130,000,000	133,030,300	
第63回利付国債(30年)	120,000,000	119,529,600	
第64回利付国債(30年)	140,000,000	139,447,000	
第65回利付国債(30年)	90,000,000	89,641,800	
第51回利付国債(20年)	90,000,000	92,486,700	
第52回利付国債(20年)	190,000,000	196,604,400	
第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,803,600	
第54回利付国債(20年)	180,000,000	187,545,600	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	104,366,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,490,500	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	115,148,000	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	105,197,000	

第59回利付国債(20年)	40,000,000	42,068,400
第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,303,500
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,769,500
第62回利付国債(20年)	80,000,000	82,511,200
第63回利付国債(20年)	60,000,000	63,835,200
第64回利付国債(20年)	120,000,000	128,578,800
第65回利付国債(20年)	380,000,000	408,887,600
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,617,000
第68回利付国債(20年)	90,000,000	98,357,400
第69回利付国債(20年)	60,000,000	65,331,000
第70回利付国債(20年)	110,000,000	121,800,800
第71回利付国債(20年)	100,000,000	109,876,000
第72回利付国債(20年)	210,000,000	231,033,600
第73回利付国債(20年)	180,000,000	198,037,800
第75回利付国債(20年)	100,000,000	111,046,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	110,044,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	22,109,000
第78回利付国債(20年)	50,000,000	55,263,000
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,210,400
第80回利付国債(20年)	90,000,000	100,420,200
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,476,100
第82回利付国債(20年)	170,000,000	190,636,300
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,269,400
第84回利付国債(20年)	120,000,000	134,540,400
第85回利付国債(20年)	150,000,000	169,813,500
第86回利付国債(20年)	100,000,000	114,412,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	102,429,000
第88回利付国債(20年)	185,000,000	212,792,550
第89回利付国債(20年)	120,000,000	137,275,200
第90回利付国債(20年)	170,000,000	195,467,700
第91回利付国債(20年)	80,000,000	92,507,200
第92回利付国債(20年)	215,000,000	246,996,300
第93回利付国債(20年)	90,000,000	103,218,300
第94回利付国債(20年)	140,000,000	161,546,000
第95回利付国債(20年)	185,000,000	217,121,550
第96回利付国債(20年)	70,000,000	81,134,900
第97回利付国債(20年)	130,000,000	152,269,000
第98回利付国債(20年)	70,000,000	81,463,900
第99回利付国債(20年)	85,000,000	99,309,750
第100回利付国債(20年)	151,000,000	178,303,820
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,937,200
第102回利付国債(20年)	145,000,000	174,304,500
第103回利付国債(20年)	100,000,000	119,384,000

第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,773,100	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	14,181,000	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	47,610,400	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	94,843,200	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	256,968,800	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	93,696,800	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	231,890,100	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	60,131,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	244,644,950	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	101,741,600	
第114回利付国債(20年)	60,000,000	72,057,600	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	121,067,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	169,985,200	
第117回利付国債(20年)	85,000,000	102,360,400	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	156,852,850	
第119回利付国債(20年)	60,000,000	70,620,600	
第120回利付国債(20年)	140,000,000	161,932,400	
第121回利付国債(20年)	145,000,000	172,535,500	
第122回利付国債(20年)	150,000,000	176,925,000	
第123回利付国債(20年)	185,000,000	224,662,150	
第124回利付国債(20年)	100,000,000	120,375,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	147,376,800	
第126回利付国債(20年)	40,000,000	48,256,800	
第127回利付国債(20年)	20,000,000	23,911,000	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	269,698,500	
第129回利付国債(20年)	60,000,000	71,253,600	
第130回利付国債(20年)	130,000,000	154,659,700	
第131回利付国債(20年)	120,000,000	141,403,200	
第132回利付国債(20年)	60,000,000	70,848,600	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	292,130,650	
第134回利付国債(20年)	55,000,000	65,721,700	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,326,400	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	93,710,400	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	201,538,400	
第138回利付国債(20年)	10,000,000	11,615,000	
第139回利付国債(20年)	160,000,000	187,761,600	
第140回利付国債(20年)	270,000,000	320,708,700	
第141回利付国債(20年)	75,000,000	89,250,000	
第142回利付国債(20年)	170,000,000	204,418,200	
第143回利付国債(20年)	155,000,000	182,807,000	
第144回利付国債(20年)	180,000,000	210,009,600	
第145回利付国債(20年)	265,000,000	316,661,750	

	第146回利付国債(20年)	260,000,000	311,220,000
	第147回利付国債(20年)	245,000,000	290,469,550
	第148回利付国債(20年)	255,000,000	299,278,200
	第149回利付国債(20年)	210,000,000	246,932,700
	第150回利付国債(20年)	290,000,000	337,568,700
	第151回利付国債(20年)	295,000,000	335,308,800
	第152回利付国債(20年)	270,000,000	307,265,400
	第153回利付国債(20年)	230,000,000	265,443,000
	第154回利付国債(20年)	238,000,000	271,508,020
	第155回利付国債(20年)	240,000,000	266,848,800
	第156回利付国債(20年)	270,000,000	275,165,100
	第157回利付国債(20年)	140,000,000	138,259,800
	第158回利付国債(20年)	180,000,000	186,240,600
	第159回利付国債(20年)	200,000,000	210,232,000
	第160回利付国債(20年)	180,000,000	192,256,200
	第161回利付国債(20年)	270,000,000	283,972,500
	第162回利付国債(20年)	80,000,000	84,197,600
	第163回利付国債(20年)	230,000,000	242,026,700
	第164回利付国債(20年)	290,000,000	300,150,000
	第165回利付国債(20年)	230,000,000	237,951,100
	第166回利付国債(20年)	310,000,000	331,718,600
	第167回利付国債(20年)	250,000,000	258,640,000
	第168回利付国債(20年)	200,000,000	203,408,000
	第169回利付国債(20年)	210,000,000	210,000,000
	第170回利付国債(20年)	230,000,000	230,000,000
	第171回利付国債(20年)	70,000,000	70,065,100
	国債証券合計	43,538,000,000	48,154,113,870
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	117,348,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,978,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,436,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,026,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,709,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,490,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,882,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,784,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	99,791,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,743,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,926,000
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	98,733,000
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	99,970,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,466,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,368,000

	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,086,000	
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,864,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,640,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,767,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,188,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,606,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	118,973,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,220,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,445,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,986,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,624,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,563,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,850,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,561,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,063,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,258,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,194,000	
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,887,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,022,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	120,879,600	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,895,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,520,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	100,913,000	
	地方債証券合計	3,830,000,000	3,916,654,600	
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,159,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,386,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,153,000	
	第27回道路債券	100,000,000	109,540,000	
	第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	101,000,000	102,489,750	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	117,052,920	
	第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	130,032,760	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,143,000	
	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	102,468,000	
	第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	135,354,100	
	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	100,718,000	
	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	101,182,000	

	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	101,457,000	
	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	100,807,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	110,968,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	130,083,560	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,067,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,283,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,255,700	
	第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,596,690	
	F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,492,000	
	F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,957,000	
	第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,009,000	
	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	115,091,000	
	第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,556,000	
	第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,410,000	
	第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,788,000	
	第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,734,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,415,000	90,462,049	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,726,000	90,523,664	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,759,000	91,426,986	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,427,000	91,221,853	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,491,000	94,059,425	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,390,000	95,512,297	
	第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,665,000	97,752,348	
	第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,750,000	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	71,721,000	71,688,008	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	74,866,000	74,884,716	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	78,936,000	78,904,425	
	第327回信金中金債	100,000,000	99,884,000	
	第340回信金中金債	100,000,000	99,910,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,571,000	
	第36回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,043,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,008,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,389,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,902,000	
	特殊債券合計	4,632,396,000	4,778,126,251	
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	99,074,000	
	第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	99,260,000	
	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	97,713,000	
	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	99,215,000	

第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,535,000	
第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,256,000	
第12回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,661,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	98,990,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,080,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,789,000	
第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,355,000	
第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,355,000	
第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,573,000	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,795,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,122,000	
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	97,258,000	
第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,481,000	
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,554,000	
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	98,645,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,332,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	98,828,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,648,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	98,373,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,012,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,705,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,126,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,469,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	98,529,000	
第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,669,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	99,274,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,996,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	99,945,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,140,000	
社債券合計	3,400,000,000	3,396,378,000	
合計		60,245,272,721	

## 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。

#### R A M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 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	135,695,982
金銭信託	2,923,992,467
国債証券	97,283,545,639
派生商品評価勘定	1,072,497,472
未収入金	4,486,283,982
未収利息	470,992,092
前払費用	238,976,761
流動資産合計	106,611,984,395
資産合計	106,611,984,395
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	983,797,081
未払金	1,061,901,855
未払解約金	3,291,745,654
その他未払費用	346,985
流動負債合計	5,337,791,575
負債合計	5,337,791,575
純資産の部	
元本等	
元本	96,308,797,975
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,965,394,845
元本等合計	101,274,192,820
純資産合計	101,274,192,820
負債純資産合計	106,611,984,395

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。



3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	65,475,061,200円
期中追加設定元本額	177,626,194,563円
期中一部解約元本額	146,792,457,788円
期末元本額	96,308,797,975円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	13,542,804,939円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,216,855,375円
りそなラップ型ファンド(成長型)	849,321,978円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	743,096,372円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	137,675,765円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	26,939,755円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	8,462,837円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,556,084円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	230,808円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	12,898円
FWりそな円建債券アクティブファンド	63,165,368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)	59,209,011,080円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	549,689,429円
Smart-i 8資産バランス 安定型	225,210,908円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	136,841,945円
Smart-i 8資産バランス 成長型	48,765,667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)	7,291,822,696円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	7,406,531円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	7,248,595,081円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	332,459円
2. 計算日における受益権の総数	96,308,797,975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	1.0516円
(10,000口当たり純資産額)	(10,516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 3月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.時価の算定方法	<p>国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引 （その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<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る場合、当該価額 が異なることもあります。</p> <p>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。</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		2,241,571,209
合計		2,241,571,209

(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 3月25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	1,017,909,326	-	1,028,341,765	10,432,439
	米ドル	365,887,440	-	368,573,400	2,685,960
	ユーロ	359,157,150	-	361,175,056	2,017,906
	英ポンド	292,864,736	-	298,593,309	5,728,573
	売建	98,471,967,822	-	98,393,699,870	78,267,952
	米ドル	47,893,936,092	-	48,847,142,090	953,205,998
	カナダドル	1,882,034,915	-	1,778,189,905	103,845,010
	メキシコペソ	937,738,770	-	751,289,050	186,449,720
	ユーロ	36,608,407,538	-	36,548,415,000	59,992,538
	英ポンド	6,248,490,053	-	5,846,018,080	402,471,973
	スウェーデンクローナ	254,272,324	-	247,840,560	6,431,764

	ノルウェークローネ	215,493,230	-	187,026,840	28,466,390
	デンマーククローネ	430,880,513	-	430,857,680	22,833
	ポーランドズロチ	630,765,135	-	591,968,000	38,797,135
	オーストラリアドル	1,808,434,014	-	1,675,589,825	132,844,189
	シンガポールドル	431,146,748	-	423,555,360	7,591,388
	マレーシアリンギット	605,593,044	-	590,929,500	14,663,544
	南アフリカランド	524,775,446	-	474,877,980	49,897,466
	合計	99,489,877,148	-	99,422,041,635	88,700,391

## (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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	1,980,000.00	1,996,667.44	
		US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,777,427.90	

US TREASURY N/B	600,000.00	612,621.06
US TREASURY N/B	3,270,000.00	3,303,785.64
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,520,412.94
US TREASURY N/B	2,020,000.00	2,045,960.03
US TREASURY N/B	4,220,000.00	4,312,642.08
US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,817,543.72
US TREASURY N/B	4,240,000.00	4,354,281.14
US TREASURY N/B	3,310,000.00	3,378,656.35
US TREASURY N/B	800,000.00	810,593.68
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,571,582.00
US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,829,761.39
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,525,517.55
US TREASURY N/B	940,000.00	968,108.16
US TREASURY N/B	2,030,000.00	2,050,973.96
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,056,308.50
US TREASURY N/B	1,670,000.00	1,710,673.51
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,549,423.80
US TREASURY N/B	1,010,000.00	1,020,711.45
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,016,035.10
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,069,179.60
US TREASURY N/B	880,000.00	889,762.80
US TREASURY N/B	1,580,000.00	1,621,598.39
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,350,044.80
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,295,448.97
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,017,792.90
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,477,940.54
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,352,685.49
US TREASURY N/B	1,230,000.00	1,258,011.28
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,285,924.16
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,259,812.48
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,142,259.69
US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,835,197.56
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,554,248.00
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,397,275.18
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,550,935.04

US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,054,316.20	
US TREASURY N/B	260,000.00	267,825.37	
US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,236,799.02	
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,151,806.20	
US TREASURY N/B	600,000.00	624,082.02	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,362,351.39	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,823,238.23	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,113,378.70	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,252,021.45	
US TREASURY N/B	650,000.00	669,957.01	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,831,425.57	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,084,722.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,543,242.15	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,133,708.95	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,423,462.05	
US TREASURY N/B	400,000.00	412,328.12	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,267,331.88	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,058,170.23	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,051,060.51	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,829,008.60	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,422,905.26	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,759,897.11	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	1,972,537.34	
US TREASURY N/B	780,000.00	805,837.50	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,803,278.75	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,539,917.04	
US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,884,026.10	
US TREASURY N/B	980,000.00	1,010,720.64	
US TREASURY N/B	1,780,000.00	1,854,189.68	
US TREASURY N/B	900,000.00	929,021.40	
US TREASURY N/B	2,440,000.00	2,553,993.62	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,400,127.40	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,447,393.63	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,635,250.00	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,180,629.19	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,541,396.40	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,370,976.39	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,595,331.90	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,206,624.19	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,494,488.10	
US TREASURY N/B	520,000.00	538,789.05	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,432,548.96	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,102,358.55	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,135,399.09	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,930,007.70	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,605,215.50	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,375,313.19	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,153,320.26	
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,172,558.88	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,390,144.73	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,295,823.69	
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,226,488.25	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,627,968.75	
US TREASURY N/B	2,080,000.00	2,248,268.67	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,564,538.13	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,283,618.75	
US TREASURY N/B	920,000.00	980,482.73	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,916,000.00	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,640,307.99	
US TREASURY N/B	2,280,000.00	2,479,410.85	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,914,187.50	
US TREASURY N/B	860,000.00	923,458.54	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,701,511.58	
US TREASURY N/B	1,420,000.00	1,505,754.65	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,532,135.76	
US TREASURY N/B	2,310,000.00	2,454,284.67	
US TREASURY N/B	880,000.00	935,756.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,106,250.00	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,583,137.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,108,515.60	

US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,200,230.79
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,797,781.18
US TREASURY N/B	180,000.00	186,215.61
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,701,223.28
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,883,337.50
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,610,669.38
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,345,000.00
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,272,623.38
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,395,925.70
US TREASURY N/B	600,000.00	628,359.36
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,189,074.15
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,058,398.40
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,866,545.93
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,509,415.92
US TREASURY N/B	480,000.00	513,768.72
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,548,328.01
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,792,685.09
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,839,838.87
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,969,462.65
US TREASURY N/B	100,000.00	111,902.34
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,362,226.53
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,524,658.17
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,837,381.18
US TREASURY N/B	550,000.00	613,593.75
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,243,300.74
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,487,804.66
US TREASURY N/B	2,160,000.00	2,353,725.00
US TREASURY N/B	500,000.00	563,496.05
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,894,039.02
US TREASURY N/B	3,820,000.00	4,261,090.43
US TREASURY N/B	990,000.00	1,045,687.50
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,884,675.76
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,171,858.97
US TREASURY N/B	750,000.00	792,509.70
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,849,347.55



US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,898,597.42	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,791,343.62	
US TREASURY N/B	3,630,000.00	3,811,784.95	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,004,537.24	
US TREASURY N/B	700,000.00	741,753.88	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,059,453.10	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,474,378.04	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,702,402.28	
US TREASURY N/B	500,000.00	534,218.75	
US TREASURY N/B	1,870,000.00	1,967,298.34	
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,463,191.76	
US TREASURY N/B	920,000.00	1,026,914.02	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,273,347.43	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,488,937.47	
US TREASURY N/B	5,450,000.00	6,279,421.87	
US TREASURY N/B	5,490,000.00	6,398,423.16	
US TREASURY N/B	220,000.00	304,442.18	
US TREASURY N/B	3,170,000.00	3,705,804.17	
US TREASURY N/B	580,000.00	691,967.14	
US TREASURY N/B	530,000.00	732,269.51	
US TREASURY N/B	3,060,000.00	3,532,387.50	
US TREASURY N/B	6,360,000.00	7,225,555.92	
US TREASURY N/B	200,000.00	214,398.42	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,014,933.27	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,129,335.80	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,194,557.75	
US TREASURY N/B	610,000.00	896,652.29	
US TREASURY N/B	540,000.00	822,065.59	
US TREASURY N/B	130,000.00	212,067.57	
US TREASURY N/B	190,000.00	294,084.37	
US TREASURY N/B	520,000.00	816,359.33	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,353,749.95	
US TREASURY N/B	840,000.00	1,294,256.20	
US TREASURY N/B	340,000.00	539,683.56	
US TREASURY N/B	600,000.00	943,687.50	

US TREASURY N/B	780,000.00	1,266,250.75	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,499,701.16	
US TREASURY N/B	180,000.00	268,073.42	
US TREASURY N/B	770,000.00	1,200,869.13	
US TREASURY N/B	480,000.00	764,418.72	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,591,017.12	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,409,525.00	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,817,008.51	
US TREASURY N/B	1,550,000.00	2,064,285.04	
US TREASURY N/B	940,000.00	1,203,640.57	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,388,210.79	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	3,047,274.94	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,312,226.50	
US TREASURY N/B	430,000.00	631,209.72	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,635,118.64	
US TREASURY N/B	3,840,000.00	5,653,499.90	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	3,429,260.33	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,987,802.68	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,817,773.28	
US TREASURY N/B	330,000.00	408,787.50	
US TREASURY N/B	1,450,000.00	1,953,875.00	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,961,165.75	
US TREASURY N/B	3,320,000.00	4,501,323.39	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,275,204.62	
US TREASURY N/B	390,000.00	488,170.29	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,136,808.57	
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,853,062.50	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	2,390,460.89	
US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,418,693.72	
US TREASURY N/B	220,000.00	287,967.96	
US TREASURY N/B	1,190,000.00	1,559,457.75	
US TREASURY N/B	3,670,000.00	5,038,508.50	
US TREASURY N/B	2,040,000.00	2,859,904.56	
US TREASURY N/B	200,000.00	275,531.24	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	3,459,732.27	

	US TREASURY N/B	3,780,000.00	5,222,453.67
	US TREASURY N/B	2,450,000.00	3,316,113.22
	US TREASURY N/B	810,000.00	973,961.65
	US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,665,285.98
	US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,731,415.95
	米ドル 小計	400,120,000.00	446,955,631.07 (49,683,587,949)
カナダドル	GOV OF CANADA	1,210,000.00	1,211,585.10
	GOV OF CANADA	590,000.00	597,327.80
	GOV OF CANADA	770,000.00	793,692.90
	GOV OF CANADA	690,000.00	698,017.80
	GOV OF CANADA	560,000.00	560,940.80
	GOV OF CANADA	390,000.00	393,896.10
	GOV OF CANADA	520,000.00	528,736.00
	GOV OF CANADA	760,000.00	758,046.80
	GOV OF CANADA	300,000.00	305,517.00
	GOV OF CANADA	860,000.00	899,474.00
	GOV OF CANADA	760,000.00	766,703.20
	GOV OF CANADA	1,210,000.00	1,247,848.80
	GOV OF CANADA	440,000.00	451,294.80
	GOV OF CANADA	670,000.00	699,727.90
	GOV OF CANADA	140,000.00	148,521.80
	GOV OF CANADA	550,000.00	590,716.50
	GOV OF CANADA	580,000.00	600,027.40
	GOV OF CANADA	1,490,000.00	1,528,889.00
	GOV OF CANADA	700,000.00	754,061.00
	GOV OF CANADA	490,000.00	511,878.50
	GOV OF CANADA	1,160,000.00	1,178,478.80
	GOV OF CANADA	740,000.00	811,047.40
	GOV OF CANADA	350,000.00	500,692.50
	GOV OF CANADA	510,000.00	573,877.50
	GOV OF CANADA	310,000.00	320,729.10
	GOV OF CANADA	560,000.00	885,488.80
	GOV OF CANADA	430,000.00	688,455.80
	GOV OF CANADA	820,000.00	1,239,684.20

	GOV OF CANADA	880,000.00	1,301,722.40
	GOV OF CANADA	460,000.00	619,206.00
	GOV OF CANADA	640,000.00	755,398.40
	GOV OF CANADA	140,000.00	209,855.80
	カナダドル 小計	20,680,000.00	23,131,539.90 (1,778,121,472)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	10,910,000.00	10,892,434.90
	UNITED MEXICAN STATE	12,900,000.00	13,029,000.00
	UNITED MEXICAN STATE	10,170,000.00	10,114,065.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,300,000.00	2,296,619.00
	UNITED MEXICAN STATE	10,740,000.00	11,079,384.00
	UNITED MEXICAN STATE	12,480,000.00	12,874,867.20
	UNITED MEXICAN STATE	17,570,000.00	19,475,642.20
	UNITED MEXICAN STATE	11,760,000.00	10,761,693.60
	UNITED MEXICAN STATE	11,980,000.00	11,836,000.40
	UNITED MEXICAN STATE	13,110,000.00	13,665,601.80
	UNITED MEXICAN STATE	6,880,000.00	6,767,030.40
	UNITED MEXICAN STATE	560,000.00	546,319.20
	UNITED MEXICAN STATE	4,550,000.00	5,312,170.50
	UNITED MEXICAN STATE	6,270,000.00	6,257,961.60
	UNITED MEXICAN STATE	9,310,000.00	8,484,947.80
	UNITED MEXICAN STATE	10,410,000.00	9,631,436.10
	メキシコペソ 小計	151,900,000.00	153,025,173.70 (682,492,274)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	741,363.00
	GOV OF AUSTRIA	370,000.00	401,229.85
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	131,348.23
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	770,935.90
	GOV OF AUSTRIA	260,000.00	262,477.80
	GOV OF AUSTRIA	650,000.00	697,902.40
	GOV OF AUSTRIA	380,000.00	383,648.76
	GOV OF AUSTRIA	280,000.00	303,587.20
	GOV OF AUSTRIA	650,000.00	695,492.20
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	129,320.70
	GOV OF AUSTRIA	750,000.00	784,638.00
	GOV OF AUSTRIA	230,000.00	237,713.05

GOV OF AUSTRIA	820,000.00	1,189,927.42
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	136,892.21
GOV OF AUSTRIA	280,000.00	289,924.04
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	216,806.04
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	271,157.25
GOV OF AUSTRIA	850,000.00	1,386,861.70
GOV OF AUSTRIA	460,000.00	754,644.72
GOV OF AUSTRIA	190,000.00	239,091.29
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	347,473.60
GOV OF AUSTRIA	240,000.00	413,184.96
GOV OF AUSTRIA	180,000.00	242,658.90
GOV OF BELGIUM	550,000.00	589,202.12
GOV OF BELGIUM	900,000.00	981,126.90
GOV OF BELGIUM	1,250,000.00	1,397,660.00
GOV OF BELGIUM	650,000.00	704,668.62
GOV OF BELGIUM	260,000.00	264,529.48
GOV OF BELGIUM	360,000.00	402,917.04
GOV OF BELGIUM	240,000.00	247,085.28
GOV OF BELGIUM	660,000.00	690,360.00
GOV OF BELGIUM	400,000.00	508,752.80
GOV OF BELGIUM	360,000.00	382,034.16
GOV OF BELGIUM	190,000.00	199,874.11
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,617,990.50
GOV OF BELGIUM	900,000.00	950,465.70
GOV OF BELGIUM	830,000.00	885,170.93
GOV OF BELGIUM	100,000.00	98,695.63
GOV OF BELGIUM	580,000.00	624,425.68
GOV OF BELGIUM	160,000.00	229,564.16
GOV OF BELGIUM	260,000.00	289,337.62
GOV OF BELGIUM	240,000.00	324,973.20
GOV OF BELGIUM	1,210,000.00	2,003,011.01
GOV OF BELGIUM	120,000.00	137,142.24
GOV OF BELGIUM	170,000.00	208,126.07
GOV OF BELGIUM	100,000.00	94,624.80
GOV OF BELGIUM	1,150,000.00	1,952,551.65

GOV OF BELGIUM	590,000.00	999,073.55	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	143,855.64	
GOV OF BELGIUM	390,000.00	478,156.38	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	170,055.00	
GOV OF BELGIUM	370,000.00	530,453.09	
GOV OF FINLAND	150,000.00	156,407.70	
GOV OF FINLAND	230,000.00	232,235.14	
GOV OF FINLAND	130,000.00	136,478.81	
GOV OF FINLAND	120,000.00	126,746.52	
GOV OF FINLAND	270,000.00	272,875.50	
GOV OF FINLAND	300,000.00	327,886.20	
GOV OF FINLAND	100,000.00	100,983.00	
GOV OF FINLAND	420,000.00	512,755.32	
GOV OF FINLAND	80,000.00	84,366.08	
GOV OF FINLAND	180,000.00	186,402.06	
GOV OF FINLAND	310,000.00	321,208.98	
GOV OF FINLAND	110,000.00	134,605.46	
GOV OF FINLAND	70,000.00	72,535.40	
GOV OF FINLAND	250,000.00	258,437.75	
GOV OF FINLAND	310,000.00	329,874.41	
GOV OF FINLAND	20,000.00	22,347.22	
GOV OF FINLAND	190,000.00	184,694.63	
GOV OF FINLAND	290,000.00	431,911.98	
GOV OF FINLAND	220,000.00	273,716.17	
GOV OF FRANCE	1,900,000.00	1,987,641.30	
GOV OF FRANCE	790,000.00	794,482.46	
GOV OF FRANCE	1,550,000.00	1,642,349.00	
GOV OF FRANCE	1,140,000.00	1,148,561.51	
GOV OF FRANCE	2,080,000.00	2,230,354.88	
GOV OF FRANCE	1,660,000.00	1,676,175.36	
GOV OF FRANCE	1,800,000.00	1,926,003.60	
GOV OF FRANCE	1,000,000.00	1,010,534.00	
GOV OF FRANCE	1,060,000.00	1,072,449.70	
GOV OF FRANCE	2,160,000.00	2,306,493.36	
GOV OF FRANCE	1,770,000.00	2,064,901.47	

GOV OF FRANCE	1,450,000.00	1,466,915.99	
GOV OF FRANCE	1,520,000.00	1,681,011.00	
GOV OF FRANCE	1,580,000.00	1,725,459.54	
GOV OF FRANCE	1,070,000.00	1,078,748.32	
GOV OF FRANCE	1,510,000.00	1,561,983.26	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,047,511.32	
GOV OF FRANCE	1,040,000.00	1,105,292.24	
GOV OF FRANCE	1,680,000.00	2,043,005.16	
GOV OF FRANCE	1,530,000.00	1,581,683.40	
GOV OF FRANCE	1,560,000.00	1,585,534.08	
GOV OF FRANCE	1,810,000.00	1,933,840.20	
GOV OF FRANCE	810,000.00	976,139.10	
GOV OF FRANCE	2,240,000.00	2,361,233.28	
GOV OF FRANCE	750,000.00	791,625.00	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,111,375.60	
GOV OF FRANCE	1,290,000.00	1,332,213.96	
GOV OF FRANCE	920,000.00	903,923.92	
GOV OF FRANCE	980,000.00	1,207,187.52	
GOV OF FRANCE	1,970,000.00	2,239,109.88	
GOV OF FRANCE	2,450,000.00	4,092,764.20	
GOV OF FRANCE	1,870,000.00	2,080,964.05	
GOV OF FRANCE	580,000.00	945,591.40	
GOV OF FRANCE	1,820,000.00	2,030,901.41	
GOV OF FRANCE	840,000.00	1,352,779.25	
GOV OF FRANCE	970,000.00	1,177,266.69	
GOV OF FRANCE	2,360,000.00	4,167,915.76	
GOV OF FRANCE	550,000.00	868,359.80	
GOV OF FRANCE	1,740,000.00	2,274,059.94	
GOV OF FRANCE	1,640,000.00	1,939,710.00	
GOV OF FRANCE	170,000.00	165,317.01	
GOV OF FRANCE	250,000.00	488,554.50	
GOV OF FRANCE	980,000.00	2,006,838.12	
GOV OF FRANCE	270,000.00	355,889.70	
GOV OF GERMANY	820,000.00	825,398.47	
GOV OF GERMANY	1,080,000.00	1,086,885.00	

GOV OF GERMANY	1,000,000.00	1,007,707.00	
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	1,101,980.25	
GOV OF GERMANY	800,000.00	833,212.80	
GOV OF GERMANY	310,000.00	312,882.84	
GOV OF GERMANY	580,000.00	585,858.00	
GOV OF GERMANY	500,000.00	505,620.50	
GOV OF GERMANY	700,000.00	733,379.57	
GOV OF GERMANY	500,000.00	506,371.60	
GOV OF GERMANY	670,000.00	678,887.21	
GOV OF GERMANY	960,000.00	1,012,699.20	
GOV OF GERMANY	610,000.00	642,400.15	
GOV OF GERMANY	420,000.00	426,822.90	
GOV OF GERMANY	500,000.00	531,209.00	
GOV OF GERMANY	1,070,000.00	1,090,580.38	
GOV OF GERMANY	340,000.00	362,839.16	
GOV OF GERMANY	480,000.00	523,164.48	
GOV OF GERMANY	1,090,000.00	1,114,194.73	
GOV OF GERMANY	570,000.00	622,414.46	
GOV OF GERMANY	910,000.00	931,203.00	
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,195,227.66	
GOV OF GERMANY	640,000.00	684,368.70	
GOV OF GERMANY	1,070,000.00	1,096,576.66	
GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,472,193.80	
GOV OF GERMANY	340,000.00	348,911.40	
GOV OF GERMANY	890,000.00	964,122.93	
GOV OF GERMANY	1,510,000.00	1,599,841.98	
GOV OF GERMANY	840,000.00	866,348.28	
GOV OF GERMANY	1,660,000.00	1,743,650.72	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,530,076.27	
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,179,322.10	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,923,282.40	
GOV OF GERMANY	390,000.00	419,394.30	
GOV OF GERMANY	310,000.00	444,900.53	
GOV OF GERMANY	800,000.00	845,358.40	
GOV OF GERMANY	1,180,000.00	1,247,097.16	



GOV OF GERMANY	550,000.00	568,169.80
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,226,925.18
GOV OF GERMANY	450,000.00	464,647.50
GOV OF GERMANY	1,000,000.00	1,641,235.00
GOV OF GERMANY	1,280,000.00	2,216,250.88
GOV OF GERMANY	1,290,000.00	2,214,802.29
GOV OF GERMANY	480,000.00	894,420.00
GOV OF GERMANY	490,000.00	982,503.83
GOV OF GERMANY	710,000.00	1,244,990.68
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	3,110,939.52
GOV OF GERMANY	1,570,000.00	2,606,669.43
GOV OF GERMANY	130,000.00	175,063.46
GOV OF GERMANY	200,000.00	197,172.00
GOV OF IRELAND	320,000.00	327,088.32
GOV OF IRELAND	180,000.00	181,232.64
GOV OF IRELAND	250,000.00	280,896.39
GOV OF IRELAND	280,000.00	318,206.00
GOV OF IRELAND	490,000.00	619,659.14
GOV OF IRELAND	690,000.00	725,097.54
GOV OF IRELAND	500,000.00	526,246.69
GOV OF IRELAND	200,000.00	214,420.80
GOV OF IRELAND	420,000.00	504,897.33
GOV OF IRELAND	160,000.00	176,027.28
GOV OF IRELAND	60,000.00	66,164.58
GOV OF IRELAND	240,000.00	233,046.24
GOV OF IRELAND	160,000.00	186,569.76
GOV OF IRELAND	510,000.00	649,040.01
GOV OF IRELAND	100,000.00	114,099.20
GOV OF ITALY	1,530,000.00	1,578,036.95
GOV OF ITALY	920,000.00	916,643.84
GOV OF ITALY	810,000.00	839,546.77
GOV OF ITALY	820,000.00	820,223.04
GOV OF ITALY	1,720,000.00	1,824,611.43
GOV OF ITALY	770,000.00	791,439.88
GOV OF ITALY	1,030,000.00	1,028,290.20

GOV OF ITALY	540,000.00	555,136.20	
GOV OF ITALY	690,000.00	749,384.16	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,154,710.56	
GOV OF ITALY	810,000.00	823,111.47	
GOV OF ITALY	1,030,000.00	1,040,274.25	
GOV OF ITALY	950,000.00	957,546.80	
GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,129,651.67	
GOV OF ITALY	500,000.00	510,415.00	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,642,431.38	
GOV OF ITALY	390,000.00	383,788.86	
GOV OF ITALY	50,000.00	50,449.10	
GOV OF ITALY	270,000.00	272,334.42	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,563,161.60	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,266,400.00	
GOV OF ITALY	360,000.00	380,755.44	
GOV OF ITALY	150,000.00	149,567.85	
GOV OF ITALY	1,260,000.00	1,435,756.14	
GOV OF ITALY	720,000.00	747,900.00	
GOV OF ITALY	180,000.00	185,970.60	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,354,732.94	
GOV OF ITALY	690,000.00	704,567.28	
GOV OF ITALY	450,000.00	480,262.50	
GOV OF ITALY	470,000.00	455,168.68	
GOV OF ITALY	1,510,000.00	1,795,174.52	
GOV OF ITALY	330,000.00	335,857.00	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,163,338.65	
GOV OF ITALY	1,090,000.00	1,170,675.26	
GOV OF ITALY	400,000.00	418,911.20	
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,450,871.58	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,587,556.50	
GOV OF ITALY	740,000.00	778,863.32	
GOV OF ITALY	650,000.00	651,358.50	
GOV OF ITALY	400,000.00	389,616.00	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,421,869.98	
GOV OF ITALY	920,000.00	966,105.80	

GOV OF ITALY	1,780,000.00	2,432,194.83
GOV OF ITALY	150,000.00	157,235.10
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,473,038.19
GOV OF ITALY	690,000.00	763,912.80
GOV OF ITALY	790,000.00	889,834.67
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,503,448.82
GOV OF ITALY	790,000.00	925,753.60
GOV OF ITALY	800,000.00	783,592.00
GOV OF ITALY	1,630,000.00	2,333,920.39
GOV OF ITALY	950,000.00	950,232.27
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,685,237.56
GOV OF ITALY	280,000.00	301,923.16
GOV OF ITALY	1,060,000.00	1,467,202.92
GOV OF ITALY	870,000.00	1,032,192.36
GOV OF ITALY	300,000.00	280,680.00
GOV OF ITALY	560,000.00	583,229.47
GOV OF ITALY	1,630,000.00	2,078,372.25
GOV OF ITALY	430,000.00	485,631.25
GOV OF ITALY	1,290,000.00	1,874,357.10
GOV OF ITALY	310,000.00	356,291.30
GOV OF ITALY	1,200,000.00	1,748,628.00
GOV OF ITALY	450,000.00	651,773.61
GOV OF ITALY	290,000.00	338,125.79
GOV OF ITALY	930,000.00	993,020.52
GOV OF ITALY	980,000.00	1,185,417.80
GOV OF ITALY	670,000.00	869,055.99
GOV OF ITALY	50,000.00	50,408.45
GOV OF ITALY	700,000.00	742,979.44
GOV OF NETHERLANDS	640,000.00	671,947.64
GOV OF NETHERLANDS	1,310,000.00	1,322,968.34
GOV OF NETHERLANDS	580,000.00	617,615.32
GOV OF NETHERLANDS	340,000.00	381,164.71
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	268,753.75
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	183,149.04
GOV OF NETHERLANDS	960,000.00	1,061,283.54

GOV OF NETHERLANDS	910,000.00	938,077.14
GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	911,824.54
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	320,859.30
GOV OF NETHERLANDS	990,000.00	1,431,205.38
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	290,419.56
GOV OF NETHERLANDS	750,000.00	774,442.50
GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	172,030.04
GOV OF NETHERLANDS	860,000.00	1,426,449.32
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	150,196.20
GOV OF NETHERLANDS	1,020,000.00	1,816,682.22
GOV OF NETHERLANDS	950,000.00	1,587,242.59
GOV OF SPAIN	790,000.00	800,144.39
GOV OF SPAIN	1,850,000.00	1,856,889.40
GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,278,208.90
GOV OF SPAIN	860,000.00	869,902.72
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,326,173.42
GOV OF SPAIN	450,000.00	448,558.65
GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,498,721.90
GOV OF SPAIN	1,680,000.00	1,975,661.52
GOV OF SPAIN	1,720,000.00	1,966,684.12
GOV OF SPAIN	1,140,000.00	1,264,413.90
GOV OF SPAIN	460,000.00	451,811.08
GOV OF SPAIN	850,000.00	901,913.75
GOV OF SPAIN	1,040,000.00	1,271,781.68
GOV OF SPAIN	1,330,000.00	1,454,288.50
GOV OF SPAIN	440,000.00	478,038.44
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,369,927.60
GOV OF SPAIN	440,000.00	460,228.25
GOV OF SPAIN	190,000.00	200,946.09
GOV OF SPAIN	970,000.00	1,022,613.77
GOV OF SPAIN	270,000.00	284,217.12
GOV OF SPAIN	1,430,000.00	1,951,006.20
GOV OF SPAIN	1,230,000.00	1,777,546.80
GOV OF SPAIN	1,220,000.00	1,288,768.96
GOV OF SPAIN	1,440,000.00	1,409,342.40

	GOV OF SPAIN	580,000.00	559,095.06	
	GOV OF SPAIN	330,000.00	364,228.62	
	GOV OF SPAIN	1,100,000.00	1,710,794.80	
	GOV OF SPAIN	120,000.00	139,166.82	
	GOV OF SPAIN	150,000.00	164,097.60	
	GOV OF SPAIN	1,210,000.00	1,762,481.16	
	GOV OF SPAIN	890,000.00	1,453,493.71	
	GOV OF SPAIN	1,430,000.00	2,312,596.00	
	GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,845,795.00	
	GOV OF SPAIN	330,000.00	428,554.50	
	GOV OF SPAIN	1,120,000.00	1,413,000.96	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	521,187.36	
	ユーロ 小計	242,310,000.00	289,972,896.87 (34,776,449,521)	
英bond	UK TREASURY	790,000.00	832,225.18	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,075,740.00	
	UK TREASURY	1,710,000.00	1,725,885.21	
	UK TREASURY	440,000.00	457,533.47	
	UK TREASURY	860,000.00	877,286.50	
	UK TREASURY	1,260,000.00	1,351,163.26	
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,570,491.36	
	UK TREASURY	420,000.00	467,654.54	
	UK TREASURY	780,000.00	963,227.92	
	UK TREASURY	1,320,000.00	1,345,520.88	
	UK TREASURY	150,000.00	164,946.60	
	UK TREASURY	660,000.00	713,347.53	
	UK TREASURY	800,000.00	856,888.00	
	UK TREASURY	450,000.00	585,177.65	
	UK TREASURY	970,000.00	1,077,705.69	
	UK TREASURY	950,000.00	1,413,448.00	
	UK TREASURY	1,290,000.00	1,347,202.72	
	UK TREASURY	110,000.00	159,106.66	
	UK TREASURY	990,000.00	1,415,521.80	
	UK TREASURY	970,000.00	1,482,205.59	
	UK TREASURY	600,000.00	921,410.76	

	UK TREASURY	1,370,000.00	1,589,455.91
	UK TREASURY	390,000.00	663,951.28
	UK TREASURY	810,000.00	1,318,961.88
	UK TREASURY	1,080,000.00	1,788,662.52
	UK TREASURY	150,000.00	161,698.50
	UK TREASURY	550,000.00	968,085.90
	UK TREASURY	730,000.00	1,105,774.80
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,909,351.20
	UK TREASURY	770,000.00	1,396,007.22
	UK TREASURY	1,460,000.00	1,694,665.20
	UK TREASURY	530,000.00	652,165.00
	UK TREASURY	490,000.00	931,445.41
	UK TREASURY	1,190,000.00	2,217,560.71
	UK TREASURY	280,000.00	356,602.40
	UK TREASURY	740,000.00	1,577,614.14
	UK TREASURY	1,020,000.00	1,384,935.08
	UK TREASURY	230,000.00	500,898.60
	UK TREASURY	1,020,000.00	1,766,992.92
	UK TREASURY	720,000.00	1,590,070.74
	UK TREASURY	550,000.00	817,488.10
	英債券 小計	33,320,000.00	45,196,076.83 (5,913,454,692)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	4,610,000.00	5,004,025.92
	GOV OF SWEDEN	3,350,000.00	3,574,010.48
	GOV OF SWEDEN	2,620,000.00	2,995,597.96
	GOV OF SWEDEN	2,810,000.00	3,026,083.38
	GOV OF SWEDEN	1,860,000.00	1,987,080.58
	GOV OF SWEDEN	1,820,000.00	1,953,442.40
	GOV OF SWEDEN	2,060,000.00	3,267,469.00
	スウェーデンクローナ 小計	19,130,000.00	21,807,709.72 (239,666,729)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	3,600,000.00	3,750,048.00
	GOV OF NORWAY	2,200,000.00	2,309,128.80
	GOV OF NORWAY	3,550,000.00	3,892,425.90
	GOV OF NORWAY	1,240,000.00	1,310,145.18
	GOV OF NORWAY	970,000.00	1,011,341.40

	GOV OF NORWAY	2,150,000.00	2,288,483.22
	GOV OF NORWAY	1,280,000.00	1,383,731.20
	GOV OF NORWAY	1,110,000.00	1,184,530.95
	GOV OF NORWAY	1,300,000.00	1,341,743.00
	ノルウェークローネ 小計	17,400,000.00	18,471,577.65 (185,085,208)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	2,760,000.00	2,921,487.60
	GOV OF DENMARK	830,000.00	846,609.21
	GOV OF DENMARK	2,640,000.00	2,831,658.72
	GOV OF DENMARK	2,550,000.00	2,850,696.00
	GOV OF DENMARK	3,060,000.00	3,237,311.70
	GOV OF DENMARK	2,700,000.00	2,861,433.00
	GOV OF DENMARK	5,300,000.00	9,888,528.00
	デンマーククローネ 小計	19,840,000.00	25,437,724.23 (408,784,228)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	300,000.00	304,459.98
	GOV OF POLAND	1,050,000.00	1,040,903.11
	GOV OF POLAND	2,080,000.00	2,108,068.76
	GOV OF POLAND	1,110,000.00	1,195,980.60
	GOV OF POLAND	1,500,000.00	1,542,948.44
	GOV OF POLAND	450,000.00	440,183.97
	GOV OF POLAND	1,240,000.00	1,388,787.60
	GOV OF POLAND	440,000.00	459,651.41
	GOV OF POLAND	1,960,000.00	2,171,307.60
	GOV OF POLAND	1,600,000.00	1,703,299.36
	GOV OF POLAND	1,600,000.00	1,695,795.51
	GOV OF POLAND	1,510,000.00	1,658,305.10
	GOV OF POLAND	2,480,000.00	2,621,086.44
	GOV OF POLAND	860,000.00	910,197.85
	GOV OF POLAND	2,010,000.00	2,155,300.07
	GOV OF POLAND	540,000.00	715,095.00
	GOV OF POLAND	440,000.00	475,070.90
		ポーランドズロチ 小計	21,170,000.00
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,180,000.00	1,253,159.64

	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	401,586.35
	GOV OF AUSTRALIA	1,650,000.00	1,856,598.48
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	231,360.88
	GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	2,027,647.81
	GOV OF AUSTRALIA	980,000.00	1,073,944.84
	GOV OF AUSTRALIA	1,550,000.00	1,767,345.80
	GOV OF AUSTRALIA	770,000.00	940,776.67
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,495,193.08
	GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	587,771.83
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,116,115.49
	GOV OF AUSTRALIA	1,420,000.00	1,647,934.42
	GOV OF AUSTRALIA	1,740,000.00	2,101,476.64
	GOV OF AUSTRALIA	760,000.00	891,083.95
	GOV OF AUSTRALIA	1,580,000.00	1,825,189.14
	GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	603,656.33
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	174,924.79
	GOV OF AUSTRALIA	610,000.00	863,746.33
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	406,140.77
	GOV OF AUSTRALIA	590,000.00	793,460.19
	GOV OF AUSTRALIA	280,000.00	357,294.07
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	475,048.18
	GOV OF AUSTRALIA	630,000.00	795,097.54
	オーストラリアドル 小計	21,030,000.00	24,686,553.22 (1,634,743,554)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	385,588.08
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	331,252.35
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	141,960.00
	GOV OF SINGAPORE	200,000.00	209,800.00
	GOV OF SINGAPORE	250,000.00	254,450.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	367,990.00
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	144,186.00
	GOV OF SINGAPORE	360,000.00	387,255.60
	GOV OF SINGAPORE	230,000.00	241,960.00
	GOV OF SINGAPORE	180,000.00	187,830.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	374,220.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	380,100.00



	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	556,987.50
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	213,370.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	349,861.80
	GOV OF SINGAPORE	250,000.00	269,750.00
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	22,376.50
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	226,480.00
	GOV OF SINGAPORE	320,000.00	388,160.00
	シンガポールドル 小計	5,000,000.00	5,433,577.83 (416,646,748)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	680,000.00	689,559.37
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	871,961.56
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,190,705.66
	GOV OF MALAYSIA	480,000.00	487,287.16
	GOV OF MALAYSIA	660,000.00	664,632.80
	GOV OF MALAYSIA	950,000.00	960,106.38
	GOV OF MALAYSIA	540,000.00	542,954.66
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	615,042.50
	GOV OF MALAYSIA	600,000.00	609,316.92
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	761,397.86
	GOV OF MALAYSIA	560,000.00	576,788.57
	GOV OF MALAYSIA	670,000.00	686,876.16
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	354,926.88
	GOV OF MALAYSIA	1,080,000.00	1,102,117.32
	GOV OF MALAYSIA	310,000.00	321,194.78
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	899,189.50
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,017,643.78
	GOV OF MALAYSIA	490,000.00	486,660.60
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,352,988.22
	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	768,719.64
	GOV OF MALAYSIA	1,300,000.00	1,332,400.03
	GOV OF MALAYSIA	630,000.00	653,107.83
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	828,513.84
	GOV OF MALAYSIA	710,000.00	695,975.65
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,139,568.76
	GOV OF MALAYSIA	800,000.00	791,109.44

	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	275,648.37	
	GOV OF MALAYSIA	650,000.00	696,537.72	
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	799,839.43	
	GOV OF MALAYSIA	540,000.00	586,180.20	
	GOV OF MALAYSIA	590,000.00	615,819.52	
	GOV OF MALAYSIA	640,000.00	697,994.94	
	マレーシアリングット 小計	23,590,000.00	24,072,766.05	(603,504,244)
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	1,160,000.00	1,152,233.22	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,380,000.00	3,377,712.41	
	GOV OF SOUTH AFRICA	12,940,000.00	12,459,158.65	
	GOV OF SOUTH AFRICA	8,930,000.00	6,732,932.45	
	GOV OF SOUTH AFRICA	4,920,000.00	3,286,654.46	
	GOV OF SOUTH AFRICA	8,500,000.00	6,086,149.60	
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,910,000.00	5,062,408.34	
	GOV OF SOUTH AFRICA	4,140,000.00	2,221,247.86	
	GOV OF SOUTH AFRICA	8,270,000.00	5,696,672.89	
	GOV OF SOUTH AFRICA	4,550,000.00	3,242,786.82	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,510,000.00	788,685.08	
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,670,000.00	4,549,916.48	
	GOV OF SOUTH AFRICA	6,390,000.00	4,282,453.39	
	南アフリカランド 小計	78,270,000.00	58,939,011.65	(373,083,943)
合計			97,283,545,639	(97,283,545,639)

(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 217銘柄	100.0%	51.2%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	1.8%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.7%

ユーロ	国債証券	304銘柄	100.0%	35.7%
英ポンド	国債証券	41銘柄	100.0%	6.1%
スウェーデンクローナ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.2%
ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.4%
ポーランドズロチ	国債証券	17銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	23銘柄	100.0%	1.7%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	32銘柄	100.0%	0.6%
南アフリカランド	国債証券	13銘柄	100.0%	0.4%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M先進国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 3月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	37,642,805
金銭信託	32,621,040
国債証券	28,908,110,911
未収入金	2,918,074,996
未収利息	198,842,898
前払費用	15,236,762
流動資産合計	32,110,529,412
資産合計	32,110,529,412
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,356,949
未払解約金	2,908,360,000

2020年 3月25日現在

その他未払費用	8,371
流動負債合計	2,915,725,320
負債合計	2,915,725,320
純資産の部	
元本等	
元本	28,120,336,490
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,074,467,602
元本等合計	29,194,804,092
純資産合計	29,194,804,092
負債純資産合計	32,110,529,412

## 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 3月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	33,874,791,320円
期中追加設定元本額	12,642,912,766円
期中一部解約元本額	18,397,367,596円
期末元本額	28,120,336,490円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	3,760,106,982円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	1,076,502,582円
りそなラップ型ファンド（成長型）	534,702,089円
DCりそな グローバルバランス	68,981,880円

つみたてバランスファンド	240,657,170円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	419,545,619円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	78,443,861円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	14,729,240円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,906,251円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,496,346円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	134,528円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	112,994,021円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	116,392,856円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	21,112,786,067円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	242,845,492円
Smart-i 8資産バランス 安定型	132,972,310円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	72,319,685円
Smart-i 8資産バランス 成長型	28,590,456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)	1,505,651円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	99,723,404円
2. 計算日における受益権の総数	28,120,336,490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	1.0382円
(10,000口当たり純資産額)	(10,382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 3月25日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

#### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

##### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		633,490,274
合計		633,490,274

（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 3月25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	1,388,579,738	-	1,395,936,687	7,356,949
	米ドル	713,545,110	-	717,028,650	3,483,540
	カナダドル	24,652,316	-	24,779,664	127,348
	メキシコペソ	9,215,927	-	9,341,885	125,958
	ユーロ	526,056,890	-	527,504,096	1,447,206
	英ポンド	79,034,191	-	80,643,612	1,609,421
	スウェーデンクローナ	9,513,350	-	9,689,850	176,500
	ノルウェークローネ	8,447,031	-	8,710,702	263,671
	デンマーククローネ	7,473,998	-	7,493,596	19,598
	南アフリカランド	10,640,925	-	10,744,632	103,707
合計		1,388,579,738	-	1,395,936,687	7,356,949

## (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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	510,000.00	514,293.12	
		US TREASURY N/B	850,000.00	867,946.22	
		US TREASURY N/B	480,000.00	490,096.84	
		US TREASURY N/B	480,000.00	484,959.36	
		US TREASURY N/B	600,000.00	612,246.06	
		US TREASURY N/B	800,000.00	818,109.36	
		US TREASURY N/B	100,000.00	101,285.15	
		US TREASURY N/B	800,000.00	817,562.48	
		US TREASURY N/B	580,000.00	598,963.27	
		US TREASURY N/B	620,000.00	636,710.92	
		US TREASURY N/B	480,000.00	489,956.20	
		US TREASURY N/B	550,000.00	557,283.15	
		US TREASURY N/B	590,000.00	606,893.35	
		US TREASURY N/B	220,000.00	222,401.93	
		US TREASURY N/B	700,000.00	711,908.19	
		US TREASURY N/B	540,000.00	556,147.24	
		US TREASURY N/B	470,000.00	474,856.04	
		US TREASURY N/B	180,000.00	183,378.51	
		US TREASURY N/B	550,000.00	563,395.47	
		US TREASURY N/B	890,000.00	919,324.78	
		US TREASURY N/B	250,000.00	252,651.35	
		US TREASURY N/B	620,000.00	629,941.76	
		US TREASURY N/B	710,000.00	734,558.75	
		US TREASURY N/B	500,000.00	505,547.05	
		US TREASURY N/B	600,000.00	615,796.86	
		US TREASURY N/B	750,000.00	778,872.00	
		US TREASURY N/B	680,000.00	689,509.32	
		US TREASURY N/B	740,000.00	753,166.73	
		US TREASURY N/B	810,000.00	831,341.55	
		US TREASURY N/B	570,000.00	593,100.56	
US TREASURY N/B	590,000.00	603,436.29			



US TREASURY N/B	600,000.00	615,046.86
US TREASURY N/B	700,000.00	713,083.98
US TREASURY N/B	500,000.00	519,208.95
US TREASURY N/B	560,000.00	575,793.73
US TREASURY N/B	250,000.00	255,424.80
US TREASURY N/B	600,000.00	622,816.38
US TREASURY N/B	380,000.00	387,644.49
US TREASURY N/B	490,000.00	503,283.55
US TREASURY N/B	500,000.00	509,052.70
US TREASURY N/B	970,000.00	999,194.67
US TREASURY N/B	470,000.00	482,245.66
US TREASURY N/B	650,000.00	668,458.96
US TREASURY N/B	700,000.00	728,095.69
US TREASURY N/B	290,000.00	297,861.69
US TREASURY N/B	460,000.00	473,835.92
US TREASURY N/B	500,000.00	518,896.45
US TREASURY N/B	470,000.00	483,310.54
US TREASURY N/B	700,000.00	721,492.17
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,523,821.76
US TREASURY N/B	510,000.00	526,156.59
US TREASURY N/B	850,000.00	874,503.88
US TREASURY N/B	320,000.00	329,806.24
US TREASURY N/B	390,000.00	405,219.12
US TREASURY N/B	410,000.00	422,636.32
US TREASURY N/B	450,000.00	463,772.43
US TREASURY N/B	360,000.00	373,471.84
US TREASURY N/B	400,000.00	413,703.12
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,080,166.92
US TREASURY N/B	390,000.00	403,817.54
US TREASURY N/B	480,000.00	494,006.20
US TREASURY N/B	40,000.00	41,094.52
US TREASURY N/B	520,000.00	537,225.00
US TREASURY N/B	350,000.00	362,728.48
US TREASURY N/B	430,000.00	440,388.84
US TREASURY N/B	430,000.00	446,175.35

US TREASURY N/B	410,000.00	426,768.34
US TREASURY N/B	630,000.00	649,748.97
US TREASURY N/B	670,000.00	697,925.33
US TREASURY N/B	700,000.00	722,572.20
US TREASURY N/B	720,000.00	753,637.46
US TREASURY N/B	300,000.00	309,029.28
US TREASURY N/B	400,000.00	414,812.48
US TREASURY N/B	560,000.00	590,800.00
US TREASURY N/B	650,000.00	679,122.99
US TREASURY N/B	610,000.00	628,824.17
US TREASURY N/B	590,000.00	627,497.21
US TREASURY N/B	390,000.00	402,141.78
US TREASURY N/B	410,000.00	435,208.55
US TREASURY N/B	150,000.00	155,419.92
US TREASURY N/B	80,000.00	85,653.12
US TREASURY N/B	640,000.00	665,574.97
US TREASURY N/B	770,000.00	798,183.15
US TREASURY N/B	400,000.00	428,890.60
US TREASURY N/B	470,000.00	483,622.62
US TREASURY N/B	550,000.00	588,478.49
US TREASURY N/B	180,000.00	184,570.30
US TREASURY N/B	620,000.00	666,960.10
US TREASURY N/B	460,000.00	491,337.50
US TREASURY N/B	50,000.00	51,511.74
US TREASURY N/B	730,000.00	786,831.59
US TREASURY N/B	540,000.00	556,622.06
US TREASURY N/B	480,000.00	520,387.48
US TREASURY N/B	540,000.00	562,106.25
US TREASURY N/B	650,000.00	705,453.12
US TREASURY N/B	710,000.00	767,437.86
US TREASURY N/B	440,000.00	466,279.66
US TREASURY N/B	600,000.00	652,687.50
US TREASURY N/B	490,000.00	522,213.62
US TREASURY N/B	650,000.00	702,000.00
US TREASURY N/B	420,000.00	448,366.38

US TREASURY N/B	690,000.00	750,348.02
US TREASURY N/B	490,000.00	521,084.37
US TREASURY N/B	800,000.00	859,031.20
US TREASURY N/B	890,000.00	948,475.75
US TREASURY N/B	670,000.00	710,461.70
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,114,572.57
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,083,710.11
US TREASURY N/B	390,000.00	414,710.12
US TREASURY N/B	620,000.00	652,937.50
US TREASURY N/B	500,000.00	534,843.75
US TREASURY N/B	620,000.00	653,639.83
US TREASURY N/B	790,000.00	854,218.31
US TREASURY N/B	400,000.00	423,906.24
US TREASURY N/B	600,000.00	620,718.72
US TREASURY N/B	420,000.00	450,203.88
US TREASURY N/B	560,000.00	585,025.00
US TREASURY N/B	520,000.00	560,970.28
US TREASURY N/B	530,000.00	554,015.62
US TREASURY N/B	970,000.00	1,046,576.94
US TREASURY N/B	400,000.00	429,515.60
US TREASURY N/B	20,000.00	20,945.31
US TREASURY N/B	400,000.00	432,390.60
US TREASURY N/B	400,000.00	423,359.36
US TREASURY N/B	430,000.00	470,463.64
US TREASURY N/B	550,000.00	572,537.07
US TREASURY N/B	950,000.00	1,016,833.92
US TREASURY N/B	550,000.00	609,382.78
US TREASURY N/B	830,000.00	916,177.32
US TREASURY N/B	450,000.00	503,121.06
US TREASURY N/B	710,000.00	766,661.26
US TREASURY N/B	440,000.00	492,370.29
US TREASURY N/B	490,000.00	545,986.32
US TREASURY N/B	470,000.00	527,373.04
US TREASURY N/B	580,000.00	623,364.04
US TREASURY N/B	570,000.00	635,906.25

US TREASURY N/B	530,000.00	599,044.90
US TREASURY N/B	570,000.00	644,567.57
US TREASURY N/B	450,000.00	490,359.37
US TREASURY N/B	480,000.00	540,956.20
US TREASURY N/B	500,000.00	557,070.30
US TREASURY N/B	600,000.00	669,281.22
US TREASURY N/B	500,000.00	528,125.00
US TREASURY N/B	670,000.00	742,783.97
US TREASURY N/B	850,000.00	930,916.00
US TREASURY N/B	450,000.00	496,265.62
US TREASURY N/B	250,000.00	264,169.90
US TREASURY N/B	470,000.00	511,290.20
US TREASURY N/B	450,000.00	483,099.57
US TREASURY N/B	590,000.00	633,420.28
US TREASURY N/B	890,000.00	934,569.86
US TREASURY N/B	500,000.00	521,621.05
US TREASURY N/B	400,000.00	423,859.36
US TREASURY N/B	300,000.00	317,835.93
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,138,306.57
US TREASURY N/B	800,000.00	847,812.48
US TREASURY N/B	100,000.00	106,843.75
US TREASURY N/B	840,000.00	927,839.05
US TREASURY N/B	580,000.00	647,402.32
US TREASURY N/B	880,000.00	976,456.18
US TREASURY N/B	930,000.00	1,033,353.50
US TREASURY N/B	950,000.00	1,094,578.12
US TREASURY N/B	900,000.00	1,048,921.83
US TREASURY N/B	120,000.00	166,059.37
US TREASURY N/B	1,120,000.00	1,309,306.20
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,276,560.07
US TREASURY N/B	310,000.00	428,308.58
US TREASURY N/B	820,000.00	946,587.50
US TREASURY N/B	1,110,000.00	1,261,063.99
US TREASURY N/B	670,000.00	718,234.70
US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,367,247.52

US TREASURY N/B	310,000.00	330,047.04	
US TREASURY N/B	120,000.00	183,778.11	
US TREASURY N/B	200,000.00	293,984.36	
US TREASURY N/B	200,000.00	304,468.74	
US TREASURY N/B	90,000.00	146,816.01	
US TREASURY N/B	130,000.00	201,215.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	156,992.18	
US TREASURY N/B	70,000.00	98,710.93	
US TREASURY N/B	240,000.00	369,787.48	
US TREASURY N/B	190,000.00	301,587.87	
US TREASURY N/B	40,000.00	62,912.50	
US TREASURY N/B	390,000.00	633,125.37	
US TREASURY N/B	260,000.00	410,444.52	
US TREASURY N/B	250,000.00	372,324.20	
US TREASURY N/B	210,000.00	327,509.75	
US TREASURY N/B	230,000.00	381,512.50	
US TREASURY N/B	250,000.00	398,134.75	
US TREASURY N/B	230,000.00	338,827.72	
US TREASURY N/B	130,000.00	176,190.62	
US TREASURY N/B	180,000.00	244,075.77	
US TREASURY N/B	80,000.00	106,543.74	
US TREASURY N/B	300,000.00	384,140.61	
US TREASURY N/B	280,000.00	359,515.60	
US TREASURY N/B	470,000.00	639,383.58	
US TREASURY N/B	360,000.00	472,401.53	
US TREASURY N/B	480,000.00	704,606.20	
US TREASURY N/B	570,000.00	853,419.10	
US TREASURY N/B	740,000.00	1,089,476.54	
US TREASURY N/B	550,000.00	782,611.26	
US TREASURY N/B	760,000.00	1,041,882.78	
US TREASURY N/B	490,000.00	657,480.43	
US TREASURY N/B	680,000.00	842,350.00	
US TREASURY N/B	520,000.00	700,700.00	
US TREASURY N/B	480,000.00	635,906.20	
US TREASURY N/B	710,000.00	962,632.41	

	US TREASURY N/B	500,000.00	625,039.05
	US TREASURY N/B	460,000.00	575,790.60
	US TREASURY N/B	470,000.00	562,421.08
	US TREASURY N/B	500,000.00	670,312.50
	US TREASURY N/B	590,000.00	810,558.57
	US TREASURY N/B	400,000.00	549,703.12
	US TREASURY N/B	580,000.00	759,188.27
	US TREASURY N/B	670,000.00	878,014.02
	US TREASURY N/B	520,000.00	713,903.11
	US TREASURY N/B	830,000.00	1,163,588.62
	US TREASURY N/B	630,000.00	867,923.40
	US TREASURY N/B	560,000.00	824,446.84
	US TREASURY N/B	840,000.00	1,160,545.26
	US TREASURY N/B	720,000.00	974,531.23
	US TREASURY N/B	690,000.00	829,671.04
	US TREASURY N/B	650,000.00	805,784.13
	US TREASURY N/B	70,000.00	80,799.41
	米ドル 小計	118,800,000.00	132,785,430.06 (14,760,428,405)
カナダドル	GOV OF CANADA	250,000.00	250,327.50
	GOV OF CANADA	230,000.00	232,856.60
	GOV OF CANADA	170,000.00	175,230.90
	GOV OF CANADA	250,000.00	252,905.00
	GOV OF CANADA	210,000.00	210,352.80
	GOV OF CANADA	210,000.00	212,097.90
	GOV OF CANADA	100,000.00	101,680.00
	GOV OF CANADA	410,000.00	408,946.30
	GOV OF CANADA	60,000.00	61,103.40
	GOV OF CANADA	220,000.00	230,098.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	201,764.00
	GOV OF CANADA	240,000.00	247,507.20
	GOV OF CANADA	190,000.00	194,877.30
	GOV OF CANADA	70,000.00	73,105.90
	GOV OF CANADA	230,000.00	244,000.10
	GOV OF CANADA	160,000.00	171,844.80

	GOV OF CANADA	240,000.00	248,287.20
	GOV OF CANADA	130,000.00	133,393.00
	GOV OF CANADA	250,000.00	269,307.50
	GOV OF CANADA	220,000.00	229,823.00
	GOV OF CANADA	130,000.00	132,070.90
	GOV OF CANADA	60,000.00	90,102.60
	GOV OF CANADA	210,000.00	230,162.10
	GOV OF CANADA	120,000.00	171,666.00
	GOV OF CANADA	190,000.00	213,797.50
	GOV OF CANADA	120,000.00	124,153.20
	GOV OF CANADA	200,000.00	316,246.00
	GOV OF CANADA	190,000.00	304,201.40
	GOV OF CANADA	200,000.00	302,362.00
	GOV OF CANADA	220,000.00	325,430.60
	GOV OF CANADA	200,000.00	269,220.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	165,243.40
	GOV OF CANADA	50,000.00	74,948.50
	カナダドル 小計	6,070,000.00	6,869,112.60 (528,028,685)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,250,000.00	3,244,767.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,330,000.00	3,363,300.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,840,000.00	3,818,880.00
	UNITED MEXICAN STATE	800,000.00	798,824.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,320,000.00	3,424,912.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,400,000.00	2,475,936.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,810,000.00	4,223,232.60
	UNITED MEXICAN STATE	2,450,000.00	2,242,019.50
	UNITED MEXICAN STATE	3,950,000.00	3,902,521.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,680,000.00	3,835,958.40
	UNITED MEXICAN STATE	2,090,000.00	2,055,682.20
	UNITED MEXICAN STATE	1,060,000.00	1,034,104.20
	UNITED MEXICAN STATE	1,310,000.00	1,529,438.10
	UNITED MEXICAN STATE	1,900,000.00	1,896,352.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,670,000.00	2,433,384.60
	UNITED MEXICAN STATE	2,170,000.00	2,007,705.70

	メキシコペソ 小計	42,030,000.00	42,287,017.80 (188,600,099)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	127,090.80
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	173,504.80
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	141,451.94
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	66,080.22
	GOV OF AUSTRIA	170,000.00	171,620.10
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	225,476.16
	GOV OF AUSTRIA	30,000.00	30,288.06
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	130,108.80
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	235,397.36
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	206,913.12
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	115,080.24
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	186,036.30
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	188,647.03
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	105,301.70
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	113,898.73
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	59,128.92
	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	90,385.75
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	342,636.42
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	164,053.20
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	125,837.53
	GOV OF AUSTRIA	40,000.00	86,868.40
	GOV OF AUSTRIA	74,000.00	127,398.69
	GOV OF AUSTRIA	50,000.00	67,405.25
	GOV OF BELGIUM	270,000.00	289,244.68
	GOV OF BELGIUM	100,000.00	109,014.10
	GOV OF BELGIUM	210,000.00	234,806.88
	GOV OF BELGIUM	160,000.00	173,456.88
	GOV OF BELGIUM	140,000.00	142,438.94
	GOV OF BELGIUM	210,000.00	235,034.94
	GOV OF BELGIUM	150,000.00	154,428.30
	GOV OF BELGIUM	210,000.00	219,660.00
	GOV OF BELGIUM	160,000.00	203,501.12
	GOV OF BELGIUM	150,000.00	159,180.90



GOV OF BELGIUM	200,000.00	210,393.80
GOV OF BELGIUM	290,000.00	415,236.50
GOV OF BELGIUM	190,000.00	200,653.87
GOV OF BELGIUM	210,000.00	223,958.91
GOV OF BELGIUM	100,000.00	98,695.63
GOV OF BELGIUM	220,000.00	236,851.12
GOV OF BELGIUM	120,000.00	172,173.12
GOV OF BELGIUM	40,000.00	44,513.48
GOV OF BELGIUM	100,000.00	135,405.50
GOV OF BELGIUM	270,000.00	446,952.87
GOV OF BELGIUM	20,000.00	22,857.04
GOV OF BELGIUM	130,000.00	159,155.23
GOV OF BELGIUM	20,000.00	18,924.96
GOV OF BELGIUM	260,000.00	441,446.46
GOV OF BELGIUM	140,000.00	237,068.30
GOV OF BELGIUM	110,000.00	131,867.67
GOV OF BELGIUM	90,000.00	110,343.78
GOV OF BELGIUM	70,000.00	99,198.75
GOV OF BELGIUM	90,000.00	129,029.13
GOV OF FINLAND	100,000.00	104,271.80
GOV OF FINLAND	20,000.00	20,194.36
GOV OF FINLAND	90,000.00	94,485.33
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,059.89
GOV OF FINLAND	20,000.00	20,213.00
GOV OF FINLAND	90,000.00	98,365.86
GOV OF FINLAND	50,000.00	50,491.50
GOV OF FINLAND	80,000.00	97,667.68
GOV OF FINLAND	30,000.00	31,637.28
GOV OF FINLAND	100,000.00	103,556.70
GOV OF FINLAND	90,000.00	93,254.22
GOV OF FINLAND	60,000.00	73,421.16
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,173.20
GOV OF FINLAND	80,000.00	82,700.08
GOV OF FINLAND	60,000.00	63,846.66
GOV OF FINLAND	60,000.00	67,041.66

GOV OF FINLAND	50,000.00	48,603.85	
GOV OF FINLAND	50,000.00	74,467.58	
GOV OF FINLAND	50,000.00	62,208.22	
GOV OF FRANCE	490,000.00	512,602.23	
GOV OF FRANCE	340,000.00	341,929.16	
GOV OF FRANCE	480,000.00	508,598.40	
GOV OF FRANCE	400,000.00	403,004.02	
GOV OF FRANCE	800,000.00	857,828.80	
GOV OF FRANCE	330,000.00	333,215.57	
GOV OF FRANCE	670,000.00	716,901.34	
GOV OF FRANCE	250,000.00	252,936.25	
GOV OF FRANCE	710,000.00	758,152.91	
GOV OF FRANCE	640,000.00	746,631.04	
GOV OF FRANCE	310,000.00	313,616.49	
GOV OF FRANCE	560,000.00	619,319.84	
GOV OF FRANCE	580,000.00	633,396.54	
GOV OF FRANCE	310,000.00	312,534.56	
GOV OF FRANCE	610,000.00	630,999.86	
GOV OF FRANCE	340,000.00	456,455.44	
GOV OF FRANCE	550,000.00	584,529.55	
GOV OF FRANCE	630,000.00	766,126.93	
GOV OF FRANCE	470,000.00	485,876.60	
GOV OF FRANCE	430,000.00	437,038.24	
GOV OF FRANCE	380,000.00	405,999.60	
GOV OF FRANCE	670,000.00	807,423.70	
GOV OF FRANCE	500,000.00	527,061.00	
GOV OF FRANCE	460,000.00	485,530.00	
GOV OF FRANCE	620,000.00	921,236.30	
GOV OF FRANCE	410,000.00	423,416.84	
GOV OF FRANCE	120,000.00	117,903.12	
GOV OF FRANCE	590,000.00	726,776.16	
GOV OF FRANCE	500,000.00	568,302.00	
GOV OF FRANCE	490,000.00	818,552.84	
GOV OF FRANCE	350,000.00	389,485.25	
GOV OF FRANCE	410,000.00	668,435.30	

GOV OF FRANCE	440,000.00	490,987.13	
GOV OF FRANCE	360,000.00	579,762.54	
GOV OF FRANCE	260,000.00	315,556.02	
GOV OF FRANCE	520,000.00	918,354.32	
GOV OF FRANCE	340,000.00	536,804.24	
GOV OF FRANCE	380,000.00	496,633.78	
GOV OF FRANCE	310,000.00	366,652.50	
GOV OF FRANCE	10,000.00	9,724.53	
GOV OF FRANCE	280,000.00	547,181.04	
GOV OF FRANCE	220,000.00	450,514.68	
GOV OF FRANCE	180,000.00	237,259.80	
GOV OF GERMANY	210,000.00	211,382.52	
GOV OF GERMANY	410,000.00	412,613.75	
GOV OF GERMANY	140,000.00	141,078.98	
GOV OF GERMANY	280,000.00	293,861.40	
GOV OF GERMANY	250,000.00	260,379.00	
GOV OF GERMANY	200,000.00	201,859.89	
GOV OF GERMANY	310,000.00	313,131.00	
GOV OF GERMANY	110,000.00	111,236.51	
GOV OF GERMANY	120,000.00	125,722.21	
GOV OF GERMANY	100,000.00	101,274.32	
GOV OF GERMANY	140,000.00	141,857.03	
GOV OF GERMANY	360,000.00	379,762.20	
GOV OF GERMANY	250,000.00	263,278.75	
GOV OF GERMANY	170,000.00	172,761.65	
GOV OF GERMANY	270,000.00	286,852.86	
GOV OF GERMANY	280,000.00	285,385.52	
GOV OF GERMANY	320,000.00	341,495.68	
GOV OF GERMANY	240,000.00	261,582.24	
GOV OF GERMANY	340,000.00	347,546.98	
GOV OF GERMANY	220,000.00	240,230.14	
GOV OF GERMANY	130,000.00	133,029.00	
GOV OF GERMANY	210,000.00	228,179.81	
GOV OF GERMANY	290,000.00	310,104.56	
GOV OF GERMANY	320,000.00	327,948.16	

GOV OF GERMANY	310,000.00	325,985.77	
GOV OF GERMANY	60,000.00	61,572.60	
GOV OF GERMANY	320,000.00	346,650.93	
GOV OF GERMANY	270,000.00	286,064.46	
GOV OF GERMANY	260,000.00	268,155.42	
GOV OF GERMANY	430,000.00	451,668.56	
GOV OF GERMANY	140,000.00	212,089.78	
GOV OF GERMANY	330,000.00	353,796.63	
GOV OF GERMANY	170,000.00	251,506.16	
GOV OF GERMANY	290,000.00	311,857.30	
GOV OF GERMANY	190,000.00	272,680.97	
GOV OF GERMANY	280,000.00	295,875.44	
GOV OF GERMANY	300,000.00	317,058.60	
GOV OF GERMANY	170,000.00	175,616.12	
GOV OF GERMANY	210,000.00	348,181.47	
GOV OF GERMANY	120,000.00	123,906.00	
GOV OF GERMANY	250,000.00	410,308.75	
GOV OF GERMANY	270,000.00	467,490.42	
GOV OF GERMANY	290,000.00	497,901.29	
GOV OF GERMANY	240,000.00	447,210.00	
GOV OF GERMANY	220,000.00	441,124.17	
GOV OF GERMANY	170,000.00	298,096.36	
GOV OF GERMANY	370,000.00	599,503.97	
GOV OF GERMANY	380,000.00	630,913.62	
GOV OF GERMANY	240,000.00	323,194.08	
GOV OF GERMANY	100,000.00	98,586.00	
GOV OF IRELAND	80,000.00	81,772.08	
GOV OF IRELAND	50,000.00	50,342.40	
GOV OF IRELAND	120,000.00	134,830.27	
GOV OF IRELAND	130,000.00	147,738.50	
GOV OF IRELAND	160,000.00	202,337.68	
GOV OF IRELAND	140,000.00	147,121.24	
GOV OF IRELAND	120,000.00	126,299.20	
GOV OF IRELAND	120,000.00	128,652.48	
GOV OF IRELAND	120,000.00	144,256.38	

GOV OF IRELAND	100,000.00	110,017.05	
GOV OF IRELAND	60,000.00	66,164.58	
GOV OF IRELAND	60,000.00	58,261.56	
GOV OF IRELAND	90,000.00	104,945.49	
GOV OF IRELAND	120,000.00	152,715.30	
GOV OF IRELAND	50,000.00	57,049.60	
GOV OF ITALY	310,000.00	319,732.97	
GOV OF ITALY	50,000.00	49,817.60	
GOV OF ITALY	400,000.00	414,591.00	
GOV OF ITALY	130,000.00	130,035.36	
GOV OF ITALY	390,000.00	407,070.76	
GOV OF ITALY	420,000.00	445,544.65	
GOV OF ITALY	280,000.00	287,796.32	
GOV OF ITALY	140,000.00	139,767.60	
GOV OF ITALY	350,000.00	359,810.50	
GOV OF ITALY	210,000.00	228,073.44	
GOV OF ITALY	280,000.00	283,613.12	
GOV OF ITALY	190,000.00	193,075.53	
GOV OF ITALY	250,000.00	252,493.75	
GOV OF ITALY	170,000.00	171,350.48	
GOV OF ITALY	230,000.00	257,247.41	
GOV OF ITALY	120,000.00	122,499.60	
GOV OF ITALY	340,000.00	382,484.02	
GOV OF ITALY	210,000.00	206,655.54	
GOV OF ITALY	240,000.00	242,155.68	
GOV OF ITALY	300,000.00	302,593.80	
GOV OF ITALY	390,000.00	435,452.16	
GOV OF ITALY	340,000.00	385,288.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	359,602.36	
GOV OF ITALY	460,000.00	524,164.94	
GOV OF ITALY	170,000.00	176,587.50	
GOV OF ITALY	200,000.00	206,634.00	
GOV OF ITALY	370,000.00	414,257.18	
GOV OF ITALY	180,000.00	183,800.16	
GOV OF ITALY	380,000.00	405,555.00	

GOV OF ITALY	290,000.00	344,768.61	
GOV OF ITALY	200,000.00	203,549.70	
GOV OF ITALY	190,000.00	193,889.77	
GOV OF ITALY	220,000.00	236,283.08	
GOV OF ITALY	350,000.00	366,547.30	
GOV OF ITALY	390,000.00	463,803.21	
GOV OF ITALY	350,000.00	358,480.50	
GOV OF ITALY	300,000.00	315,755.40	
GOV OF ITALY	210,000.00	210,438.90	
GOV OF ITALY	250,000.00	243,510.00	
GOV OF ITALY	310,000.00	328,940.07	
GOV OF ITALY	110,000.00	115,512.65	
GOV OF ITALY	350,000.00	478,240.56	
GOV OF ITALY	280,000.00	293,505.52	
GOV OF ITALY	390,000.00	491,012.73	
GOV OF ITALY	220,000.00	243,566.40	
GOV OF ITALY	210,000.00	236,538.33	
GOV OF ITALY	510,000.00	675,533.81	
GOV OF ITALY	170,000.00	199,212.80	
GOV OF ITALY	240,000.00	235,077.60	
GOV OF ITALY	470,000.00	672,970.91	
GOV OF ITALY	300,000.00	300,073.35	
GOV OF ITALY	320,000.00	464,893.12	
GOV OF ITALY	30,000.00	32,348.91	
GOV OF ITALY	350,000.00	484,453.79	
GOV OF ITALY	210,000.00	249,149.88	
GOV OF ITALY	130,000.00	121,628.00	
GOV OF ITALY	120,000.00	124,977.74	
GOV OF ITALY	430,000.00	548,282.25	
GOV OF ITALY	160,000.00	180,700.00	
GOV OF ITALY	410,000.00	595,725.90	
GOV OF ITALY	110,000.00	126,425.94	
GOV OF ITALY	330,000.00	480,872.70	
GOV OF ITALY	260,000.00	376,580.30	
GOV OF ITALY	260,000.00	303,147.26	

GOV OF ITALY	200,000.00	213,552.80	
GOV OF ITALY	260,000.00	314,498.60	
GOV OF ITALY	150,000.00	194,564.77	
GOV OF ITALY	90,000.00	90,735.21	
GOV OF ITALY	120,000.00	127,367.90	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	251,980.36	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	151,484.92	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	159,728.10	
GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	291,478.90	
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	247,253.45	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	213,673.86	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	265,320.88	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	216,479.34	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	199,134.09	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	171,124.96	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	318,045.64	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	193,613.04	
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	144,562.60	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	251,428.52	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	364,905.64	
GOV OF NETHERLANDS	70,000.00	75,098.10	
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	409,644.03	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	350,864.15	
GOV OF SPAIN	350,000.00	371,509.60	
GOV OF SPAIN	230,000.00	232,953.43	
GOV OF SPAIN	280,000.00	281,042.72	
GOV OF SPAIN	330,000.00	366,790.38	
GOV OF SPAIN	230,000.00	232,648.39	
GOV OF SPAIN	250,000.00	253,180.00	
GOV OF SPAIN	340,000.00	391,534.14	
GOV OF SPAIN	90,000.00	89,711.73	
GOV OF SPAIN	170,000.00	171,180.31	
GOV OF SPAIN	310,000.00	357,387.53	
GOV OF SPAIN	250,000.00	293,997.25	
GOV OF SPAIN	280,000.00	320,157.88	

	GOV OF SPAIN	160,000.00	159,610.40	
	GOV OF SPAIN	380,000.00	421,471.30	
	GOV OF SPAIN	50,000.00	49,109.90	
	GOV OF SPAIN	330,000.00	350,154.75	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	489,146.80	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	218,690.00	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	249,883.73	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	532,568.00	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	219,654.38	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	338,435.52	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	274,102.66	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	210,531.20	
	GOV OF SPAIN	270,000.00	284,471.46	
	GOV OF SPAIN	320,000.00	436,588.80	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	491,354.40	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	306,346.72	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	293,613.00	
	GOV OF SPAIN	110,000.00	106,035.27	
	GOV OF SPAIN	330,000.00	364,228.60	
	GOV OF SPAIN	410,000.00	637,659.88	
	GOV OF SPAIN	170,000.00	197,152.99	
	GOV OF SPAIN	140,000.00	153,157.76	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	436,978.80	
	GOV OF SPAIN	300,000.00	489,941.70	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	388,128.00	
	GOV OF SPAIN	220,000.00	386,738.00	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	272,716.50	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	252,321.60	
	GOV OF SPAIN	160,000.00	245,264.64	
	ユーロ 小計	72,804,000.00	86,201,899.11 (10,338,193,760)	
英債券	UK TREASURY	400,000.00	421,379.84	
	UK TREASURY	180,000.00	193,633.20	
	UK TREASURY	320,000.00	322,972.67	
	UK TREASURY	290,000.00	301,556.15	



UK TREASURY	290,000.00	295,829.17
UK TREASURY	310,000.00	332,429.05
UK TREASURY	380,000.00	392,622.84
UK TREASURY	140,000.00	155,884.84
UK TREASURY	250,000.00	308,726.90
UK TREASURY	180,000.00	183,480.12
UK TREASURY	240,000.00	263,914.56
UK TREASURY	180,000.00	194,549.32
UK TREASURY	100,000.00	107,111.00
UK TREASURY	240,000.00	312,094.75
UK TREASURY	330,000.00	366,642.13
UK TREASURY	170,000.00	252,932.80
UK TREASURY	350,000.00	365,520.11
UK TREASURY	240,000.00	347,141.80
UK TREASURY	170,000.00	243,069.40
UK TREASURY	210,000.00	320,889.87
UK TREASURY	230,000.00	353,207.45
UK TREASURY	320,000.00	371,259.77
UK TREASURY	250,000.00	425,609.80
UK TREASURY	190,000.00	309,386.12
UK TREASURY	270,000.00	447,165.63
UK TREASURY	60,000.00	64,679.40
UK TREASURY	280,000.00	492,843.73
UK TREASURY	310,000.00	469,575.60
UK TREASURY	310,000.00	493,249.06
UK TREASURY	240,000.00	435,119.13
UK TREASURY	180,000.00	208,931.32
UK TREASURY	160,000.00	196,880.00
UK TREASURY	240,000.00	456,218.16
UK TREASURY	240,000.00	447,239.13
UK TREASURY	50,000.00	63,679.00
UK TREASURY	280,000.00	596,935.08
UK TREASURY	120,000.00	162,933.54
UK TREASURY	260,000.00	566,233.20
UK TREASURY	270,000.00	467,733.42

	UK TREASURY	220,000.00	485,854.95
	UK TREASURY	180,000.00	267,541.56
	英ポンド 小計	9,630,000.00	13,464,655.57 (1,761,715,534)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,370,000.00	1,487,096.64
	GOV OF SWEDEN	1,180,000.00	1,258,905.18
	GOV OF SWEDEN	830,000.00	948,987.14
	GOV OF SWEDEN	810,000.00	872,287.38
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	705,093.10
	GOV OF SWEDEN	680,000.00	729,857.60
	GOV OF SWEDEN	630,000.00	999,274.50
	スウェーデンクローナ 小計	6,160,000.00	7,001,501.54 (76,946,501)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,180,000.00	1,229,182.40
	GOV OF NORWAY	770,000.00	808,195.08
	GOV OF NORWAY	990,000.00	1,085,493.42
	GOV OF NORWAY	450,000.00	475,455.91
	GOV OF NORWAY	510,000.00	531,736.20
	GOV OF NORWAY	490,000.00	521,561.29
	GOV OF NORWAY	500,000.00	540,520.00
	GOV OF NORWAY	410,000.00	437,529.45
	GOV OF NORWAY	380,000.00	392,201.80
	ノルウェークローネ 小計	5,680,000.00	6,021,875.55 (60,339,193)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	920,000.00	973,829.20
	GOV OF DENMARK	280,000.00	285,603.10
	GOV OF DENMARK	830,000.00	890,256.34
	GOV OF DENMARK	830,000.00	927,873.60
	GOV OF DENMARK	1,180,000.00	1,248,375.10
	GOV OF DENMARK	790,000.00	837,234.10
	GOV OF DENMARK	1,790,000.00	3,339,710.40
	デンマーククローネ 小計	6,620,000.00	8,502,881.84 (136,641,311)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	170,000.00	172,527.32
	GOV OF POLAND	360,000.00	356,881.06
	GOV OF POLAND	480,000.00	486,477.39

	GOV OF POLAND	180,000.00	193,942.80
	GOV OF POLAND	570,000.00	586,320.41
	GOV OF POLAND	310,000.00	347,196.90
	GOV OF POLAND	580,000.00	605,904.13
	GOV OF POLAND	270,000.00	299,108.70
	GOV OF POLAND	510,000.00	542,926.66
	GOV OF POLAND	100,000.00	105,987.22
	GOV OF POLAND	480,000.00	527,143.34
	GOV OF POLAND	510,000.00	539,013.74
	GOV OF POLAND	530,000.00	560,935.88
	GOV OF POLAND	380,000.00	407,469.66
	GOV OF POLAND	170,000.00	225,122.50
	GOV OF POLAND	280,000.00	302,317.84
	ポーランドズロチ 小計	5,880,000.00	6,259,275.55 (162,928,942)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	371,699.89
	GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	236,832.97
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	461,336.59
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	199,811.66
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	428,702.68
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	449,303.45
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	421,882.54
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	610,893.95
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	514,472.80
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	460,997.52
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	345,995.80
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	545,443.08
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	458,943.16
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	515,890.70
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	450,521.37
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	232,990.16
	GOV OF AUSTRALIA	60,000.00	61,738.16
	GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	297,355.29
	GOV OF AUSTRALIA	140,000.00	167,234.43
	GOV OF AUSTRALIA	110,000.00	147,933.25

	GOV OF AUSTRALIA	150,000.00	191,407.54	
	GOV OF AUSTRALIA	90,000.00	106,885.84	
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	252,411.92	
	オーストラリアドル 小計	6,800,000.00	7,930,684.75 (525,169,944)	
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	91,323.49	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	130,493.35	
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,420.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	136,370.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	71,246.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	84,112.00	
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	133,887.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	75,299.70	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	73,640.00	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,175.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	124,740.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	76,020.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	77,978.25	
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	101,070.00	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	96,513.60	
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	53,950.00	
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	44,753.00	
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	83,440.00	
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	133,430.00	
	シンガポールドル 小計	1,540,000.00	1,670,861.39 (128,121,651)	
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	111,546.36	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	223,059.93	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	201,814.52	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,125.42	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	140,982.71	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	131,382.97	
	GOV OF MALAYSIA	160,000.00	160,875.45	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	100,826.64	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	121,863.38	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	170,312.68	

	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	205,995.92	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	102,518.83	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	101,407.68	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	193,891.01	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	196,861.31	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	80,826.02	
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	241,816.34	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	99,318.49	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	230,509.10	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	256,239.88	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	194,735.38	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	259,169.77	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	214,799.88	
	GOV OF MALAYSIA	340,000.00	333,284.11	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	41,438.86	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	98,888.68	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	71,464.39	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	192,887.37	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	129,703.69	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	151,972.64	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	83,500.95	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	163,592.56	
	マレーシアリングgit 小計	5,050,000.00	5,149,612.92 (129,100,795)	
南アフリカランド	GOV OF SOUTH AFRICA	940,000.00	933,706.23	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,010,000.00	1,009,316.43	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,980,000.00	2,869,265.28	
	GOV OF SOUTH AFRICA	2,340,000.00	1,764,284.65	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,940,000.00	1,295,957.24	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,340,000.00	959,463.58	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,457,914.99	
	GOV OF SOUTH AFRICA	930,000.00	498,975.96	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,990,000.00	1,370,783.44	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,480,000.00	1,054,796.59	
	GOV OF SOUTH AFRICA	1,160,000.00	605,877.28	

	GOV OF SOUTH AFRICA	1,950,000.00	1,330,185.48	
	GOV OF SOUTH AFRICA	3,770,000.00	2,526,580.48	
	南アフリカランド 小計	23,820,000.00	17,677,107.63	(111,896,091)
	合計		28,908,110,911	(28,908,110,911)

(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 223銘柄	100.0%	51.0%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	1.8%
メキシコペソ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 307銘柄	100.0%	35.8%
英ポンド	国債証券 41銘柄	100.0%	6.1%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 23銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.4%
南アフリカランド	国債証券 13銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

#### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

#### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 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 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	410,037,996
金銭信託	470,828,603
投資信託受益証券	3,330,829,050
未収入金	19,430,000
流動資産合計	4,231,125,649
資産合計	4,231,125,649
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,303,439
未払解約金	858,953,987
その他未払費用	4,446
流動負債合計	860,261,872
負債合計	860,261,872
純資産の部	
元本等	
元本	3,602,844,227
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	231,980,450
元本等合計	3,370,863,777
純資産合計	3,370,863,777
負債純資産合計	4,231,125,649

### 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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	2,387,673,835円
期中追加設定元本額	4,906,719,714円
期中一部解約元本額	3,691,549,322円
期末元本額	3,602,844,227円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	602,763,055円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	392,716,085円
りそなラップ型ファンド(成長型)	181,865,826円
DCりそな グローバルバランス	10,957,103円
つみたてバランスファンド	262,041,972円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	122,430,998円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	55,392,422円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	30,167,866円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,362,470円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,588,153円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	517,205円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	572,924円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	158,016,658円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,688,231,658円
Smart-i 8資産バランス 安定型	15,338,255円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	38,851,794円
Smart-i 8資産バランス 成長型	38,491,200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)	538,583円
2. 計算日における受益権の総数	3,602,844,227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	231,980,450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	0.9356円
(10,000口当たり純資産額)	(9,356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 3月25日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25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 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		751,286,690
合計		751,286,690

（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 3月25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	386,899,051	-	388,202,490	1,303,439
	米ドル	386,899,051	-	388,202,490	1,303,439
	合計	386,899,051	-	388,202,490	1,303,439

（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	374,285	18,313,765.05	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	420,748	11,650,512.12	
		米ドル 小計	795,033	29,964,277.17 (3,330,829,050)	
	合計			3,330,829,050 (3,330,829,050)	

(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。

## R A M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	17,268,595,219
株式	16,503,748,090
派生商品評価勘定	12,744,650
未収入金	578,464,344
未収配当金	60,006,857
前払金	8,695,000
差入委託証拠金	41,625,000
流動資産合計	34,473,879,160
資産合計	34,473,879,160
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,965,416,000
その他未払費用	57,241
流動負債合計	16,965,473,241
負債合計	16,965,473,241
純資産の部	
元本等	
元本	17,556,595,424
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	48,189,505
元本等合計	17,508,405,919
純資産合計	17,508,405,919
負債純資産合計	34,473,879,160

### 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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	23,799,735,532円
期中追加設定元本額	29,392,335,048円
期中一部解約元本額	35,635,475,156円
期末元本額	17,556,595,424円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	959,967,889円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	780,402,879円
りそなラップ型ファンド(成長型)	825,332,193円
DCりそな グローバルバランス	17,071,996円
つみたてバランスファンド	1,650,540,778円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	677,632,886円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	300,449,718円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	153,302,718円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	11,520,011円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	8,223,732円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,701,910円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,992,190円
FWりそな国内株式アクティブファンド	684,778,438円
FWりそな国内株式インデックスファンド	9,643,507,615円
Smart-i TOPIXインデックス	634,095,763円
Smart-i 8資産バランス 安定型	74,128,849円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	204,954,468円
Smart-i 8資産バランス 成長型	223,222,871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)	1,190,968円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	532,188,406円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	168,389,146円
2. 計算日における受益権の総数	17,556,595,424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	48,189,505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	0.9973円
(10,000口当たり純資産額)	(9,973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 3月25日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,761,895,786
合計		2,761,895,786

(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 3月25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	509,880,350	-	522,625,000	12,744,650
合計		509,880,350	-	522,625,000	12,744,650

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

（単位：円）

	評価額

銘柄	株式数	単価	金額	備考
極洋	400	2,663.00	1,065,200	
日本水産	11,500	493.00	5,669,500	
マルハニチロ	1,600	2,263.00	3,620,800	
カネコ種苗	700	1,191.00	833,700	
サカタのタネ	1,300	3,050.00	3,965,000	
ホクト	900	1,868.00	1,681,200	
ホクリヨウ	400	625.00	250,000	
住石ホールディングス	2,300	124.00	285,200	
日鉄鉱業	300	4,310.00	1,293,000	
三井松島ホールディングス	400	942.00	376,800	
国際石油開発帝石	44,500	628.20	27,954,900	
石油資源開発	1,500	1,813.00	2,719,500	
K&Oエナジーグループ	600	1,473.00	883,800	
ヒノキヤグループ	300	1,419.00	425,700	
ショーボンドホールディングス	1,700	4,005.00	6,808,500	
ミライト・ホールディングス	3,400	1,325.00	4,505,000	
タマホーム	600	1,162.00	697,200	
サンヨーホームズ	200	684.00	136,800	
日本アクア	500	606.00	303,000	
ファーストコーポレーション	700	460.00	322,000	
ベステラ	400	896.00	358,400	
TATERU	2,400	117.00	280,800	
キャンディル	200	436.00	87,200	
スペースバリューホールディングス	1,400	420.00	588,000	
ダイセキ環境ソリューション	200	861.00	172,200	
第一カッター興業	100	1,595.00	159,500	
明豊ファシリティワークス	600	507.00	304,200	
安藤・間	6,900	695.00	4,795,500	
東急建設	3,400	577.00	1,961,800	
コムシスホールディングス	3,900	2,673.00	10,424,700	
ピーアールホールディングス	1,300	496.00	644,800	
高松コンストラクショングループ	700	2,412.00	1,688,400	
東建コーポレーション	300	7,920.00	2,376,000	
ソネック	200	671.00	134,200	
ヤマウラ	500	907.00	453,500	



大成建設	8,500	3,330.00	28,305,000
大林組	25,600	938.00	24,012,800
清水建設	26,000	867.00	22,542,000
飛島建設	800	1,045.00	836,000
長谷工コーポレーション	9,900	1,225.00	12,127,500
松井建設	1,000	648.00	648,000
銭高組	100	3,095.00	309,500
鹿島建設	20,100	1,142.00	22,954,200
不動テトラ	700	1,280.00	896,000
大末建設	300	809.00	242,700
鉄建建設	600	2,226.00	1,335,600
西松建設	2,000	2,186.00	4,372,000
三井住友建設	6,400	495.00	3,168,000
大豊建設	600	2,293.00	1,375,800
前田建設工業	6,400	793.00	5,075,200
佐田建設	1,200	318.00	381,600
ナカノフード建設	700	371.00	259,700
奥村組	1,400	2,406.00	3,368,400
東鉄工業	1,100	2,866.00	3,152,600
イチケン	200	1,421.00	284,200
富士ピー・エス	800	480.00	384,000
浅沼組	300	4,295.00	1,288,500
戸田建設	10,600	629.00	6,667,400
熊谷組	1,200	2,596.00	3,115,200
北野建設	200	2,492.00	498,400
植木組	100	2,402.00	240,200
矢作建設工業	1,200	814.00	976,800
ピーエス三菱	900	552.00	496,800
日本ハウスホールディングス	1,800	294.00	529,200
大東建託	3,100	10,420.00	32,302,000
新日本建設	1,100	821.00	903,100
N I P P O	2,200	2,167.00	4,767,400
東亜道路工業	200	3,045.00	609,000
前田道路	2,800	2,306.00	6,456,800
日本道路	200	6,540.00	1,308,000
東亜建設工業	800	1,450.00	1,160,000

日本国土開発	1,900	519.00	986,100
若築建設	500	1,282.00	641,000
東洋建設	3,000	434.00	1,302,000
五洋建設	10,500	540.00	5,670,000
世紀東急工業	1,300	832.00	1,081,600
福田組	300	3,920.00	1,176,000
住友林業	6,500	1,368.00	8,892,000
日本基礎技術	900	379.00	341,100
バコーポレーション	1,200	332.00	398,400
大和ハウス工業	25,400	2,707.50	68,770,500
ライト工業	1,500	1,249.00	1,873,500
積水ハウス	28,000	1,848.00	51,744,000
日特建設	700	734.00	513,800
北陸電気工事	500	988.00	494,000
ユアテック	1,500	586.00	879,000
四電工	300	2,315.00	694,500
中電工	1,100	2,194.00	2,413,400
関電工	3,800	850.00	3,230,000
きんでん	6,100	1,550.00	9,455,000
東京エネシス	900	742.00	667,800
トーエネック	300	3,205.00	961,500
住友電設	800	2,100.00	1,680,000
日本電設工業	1,500	2,085.00	3,127,500
協和エクシオ	3,900	2,248.00	8,767,200
新日本空調	700	1,990.00	1,393,000
九電工	1,800	2,794.00	5,029,200
三機工業	1,900	1,204.00	2,287,600
日揮ホールディングス	7,900	899.00	7,102,100
中外炉工業	300	1,491.00	447,300
ヤマト	900	585.00	526,500
太平電業	600	2,292.00	1,375,200
高砂熱学工業	2,300	1,605.00	3,691,500
三晃金属工業	200	2,100.00	420,000
朝日工業社	200	3,150.00	630,000
明星工業	1,700	744.00	1,264,800
大気社	1,300	3,110.00	4,043,000

ダイダン	600	2,816.00	1,689,600	
日比谷総合設備	900	1,836.00	1,652,400	
フィル・カンパニー	100	2,747.00	274,700	
OSJBホールディングス	4,200	241.00	1,012,200	
東洋エンジニアリング	1,100	344.00	378,400	
レイズネクスト	1,400	1,184.00	1,657,600	
日本製粉	2,500	1,614.00	4,035,000	
日清製粉グループ本社	9,300	1,756.00	16,330,800	
日東富士製粉	100	5,730.00	573,000	
昭和産業	800	3,145.00	2,516,000	
鳥越製粉	800	787.00	629,600	
中部飼料	1,000	1,291.00	1,291,000	
フィード・ワン	5,700	154.00	877,800	
東洋精糖	300	1,100.00	330,000	
日本甜菜製糖	400	1,785.00	714,000	
三井製糖	700	2,026.00	1,418,200	
塩水港精糖	1,800	211.00	379,800	
日新製糖	400	2,016.00	806,400	
森永製菓	1,900	4,215.00	8,008,500	
中村屋	200	3,955.00	791,000	
江崎グリコ	2,400	4,320.00	10,368,000	
名糖産業	700	1,390.00	973,000	
井村屋グループ	400	1,820.00	728,000	
不二家	500	1,949.00	974,500	
山崎製パン	6,100	1,979.00	12,071,900	
第一屋製パン	300	900.00	270,000	
モロゾフ	100	5,080.00	508,000	
亀田製菓	500	4,605.00	2,302,500	
寿スピリッツ	800	4,950.00	3,960,000	
カルビー	3,700	2,765.00	10,230,500	
森永乳業	1,500	3,645.00	5,467,500	
六甲バター	600	1,266.00	759,600	
ヤクルト本社	5,600	6,200.00	34,720,000	
明治ホールディングス	5,400	7,140.00	38,556,000	
雪印メグミルク	2,000	2,260.00	4,520,000	
プリマハム	1,300	2,278.00	2,961,400	

日本ハム	3,100	3,770.00	11,687,000	
林兼産業	600	532.00	319,200	
丸大食品	900	1,910.00	1,719,000	
S Foods	700	2,184.00	1,528,800	
柿安本店	300	2,231.00	669,300	
伊藤ハム米久ホールディングス	5,500	631.00	3,470,500	
サッポロホールディングス	2,900	1,976.00	5,730,400	
アサヒグループホールディングス	17,200	3,650.00	62,780,000	
キリンホールディングス	34,800	2,273.50	79,117,800	
宝ホールディングス	6,300	803.00	5,058,900	
オエノンホールディングス	2,200	379.00	833,800	
養命酒製造	300	1,938.00	581,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	5,800	2,200.00	12,760,000	
サントリー食品インターナショナル	5,500	4,090.00	22,495,000	
ダイドーグループホールディングス	400	3,500.00	1,400,000	
伊藤園	2,500	5,000.00	12,500,000	
キーコーヒー	800	2,350.00	1,880,000	
ユニカフェ	200	894.00	178,800	
ジャパンフーズ	100	1,224.00	122,400	
日清オイリオグループ	1,100	3,330.00	3,663,000	
不二製油グループ本社	2,000	2,557.00	5,114,000	
かどや製油	100	3,980.00	398,000	
J - オイルミルズ	400	4,290.00	1,716,000	
キッコーマン	5,900	4,630.00	27,317,000	
味の素	18,100	1,869.50	33,837,950	
キューピー	4,600	2,091.00	9,618,600	
ハウス食品グループ本社	3,100	3,330.00	10,323,000	
カゴメ	3,100	2,698.00	8,363,800	
焼津水産化学工業	900	954.00	858,600	
アリアケジャパン	700	6,550.00	4,585,000	
ピエトロ	200	1,648.00	329,600	
エバラ食品工業	200	2,250.00	450,000	
やまみ	100	1,671.00	167,100	
ニチレイ	3,900	2,593.00	10,112,700	
東洋水産	4,200	4,725.00	19,845,000	

イトアンド	300	1,793.00	537,900	
大冷	200	1,858.00	371,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	500	934.00	467,000	
日清食品ホールディングス	3,500	8,330.00	29,155,000	
永谷園ホールディングス	400	2,200.00	880,000	
一正蒲鉾	300	923.00	276,900	
フジッコ	900	1,948.00	1,753,200	
ロック・フィールド	900	1,390.00	1,251,000	
日本たばこ産業	47,400	2,063.00	97,786,200	
ケンコーマヨネーズ	500	2,050.00	1,025,000	
わらべや日洋ホールディングス	600	1,596.00	957,600	
なとり	500	1,767.00	883,500	
イフジ産業	300	776.00	232,800	
ピクルスコーポレーション	200	2,176.00	435,200	
北の達人コーポレーション	3,000	565.00	1,695,000	
ユージェナ	3,600	705.00	2,538,000	
ミヨシ油脂	300	979.00	293,700	
理研ビタミン	400	4,190.00	1,676,000	
片倉工業	1,200	921.00	1,105,200	
グンゼ	600	3,675.00	2,205,000	
東洋紡	3,300	1,174.00	3,874,200	
ユニチカ	2,400	269.00	645,600	
富士紡ホールディングス	400	2,748.00	1,099,200	
倉敷紡績	800	2,307.00	1,845,600	
シキボウ	400	1,015.00	406,000	
日本毛織	2,700	867.00	2,340,900	
ダイトウボウ	2,700	111.00	299,700	
トーア紡コーポレーション	700	425.00	297,500	
ガイドーリミテッド	1,100	215.00	236,500	
帝国繊維	900	1,945.00	1,750,500	
帝人	6,500	1,754.00	11,401,000	
東レ	58,000	491.00	28,478,000	
サカイオーベックス	200	1,754.00	350,800	
住江織物	200	1,751.00	350,200	
日本フェルト	500	445.00	222,500	
イチカワ	200	1,319.00	263,800	

日東製網	200	1,249.00	249,800	
アツギ	700	631.00	441,700	
ダイニック	700	682.00	477,400	
セーレン	2,000	1,246.00	2,492,000	
ソトー	700	950.00	665,000	
東海染工	200	1,139.00	227,800	
小松マテーレ	1,400	689.00	964,600	
ワコールホールディングス	2,100	2,395.00	5,029,500	
ホギメディカル	900	3,130.00	2,817,000	
レナウン	4,300	78.00	335,400	
クラウドシアホールディングス	400	372.00	148,800	
T S Iホールディングス	2,800	402.00	1,125,600	
マツオカコーポレーション	200	1,673.00	334,600	
ワールド	1,200	1,679.00	2,014,800	
三陽商会	400	1,458.00	583,200	
ナイガイ	600	413.00	247,800	
オンワードホールディングス	5,000	469.00	2,345,000	
ルックホールディングス	300	792.00	237,600	
キムラタン	8,600	22.00	189,200	
ゴールドウイン	1,500	6,420.00	9,630,000	
デサント	1,600	1,281.00	2,049,600	
キング	400	518.00	207,200	
ヤマトインターナショナル	1,000	268.00	268,000	
特種東海製紙	500	3,525.00	1,762,500	
王子ホールディングス	33,500	536.00	17,956,000	
日本製紙	3,500	1,546.00	5,411,000	
三菱製紙	900	350.00	315,000	
北越コーポレーション	5,500	402.00	2,211,000	
中越パルプ工業	400	1,296.00	518,400	
巴川製紙所	500	670.00	335,000	
大王製紙	3,600	1,450.00	5,220,000	
阿波製紙	400	443.00	177,200	
レンゴー	7,600	781.00	5,935,600	
トーモク	500	1,461.00	730,500	
ザ・パック	600	3,415.00	2,049,000	
クラレ	12,600	1,088.00	13,708,800	

旭化成	53,100	753.70	40,021,470	
共和レザー	500	688.00	344,000	
昭和電工	5,700	2,231.00	12,716,700	
住友化学	58,800	329.00	19,345,200	
住友精化	400	2,674.00	1,069,600	
日産化学	4,500	3,620.00	16,290,000	
ラサ工業	300	1,280.00	384,000	
クレハ	700	4,630.00	3,241,000	
多木化学	200	3,660.00	732,000	
テイカ	600	1,419.00	851,400	
石原産業	1,500	560.00	840,000	
片倉コープアグリ	500	1,150.00	575,000	
日本曹達	1,200	2,599.00	3,118,800	
東ソー	12,400	1,267.00	15,710,800	
トクヤマ	2,400	2,165.00	5,196,000	
セントラル硝子	1,700	1,973.00	3,354,100	
東亜合成	5,200	917.00	4,768,400	
大阪ソーダ	800	2,500.00	2,000,000	
関東電化工業	2,000	806.00	1,612,000	
デンカ	3,000	2,335.00	7,005,000	
信越化学工業	13,700	10,860.00	148,782,000	
日本カーバイド工業	300	1,012.00	303,600	
堺化学工業	500	1,746.00	873,000	
第一稀元素化学工業	900	785.00	706,500	
エア・ウォーター	7,400	1,378.00	10,197,200	
大陽日酸	7,700	1,544.00	11,888,800	
日本化学工業	300	2,326.00	697,800	
東邦アセチレン	300	1,280.00	384,000	
日本パーカラライジング	4,200	1,064.00	4,468,800	
高圧ガス工業	1,300	690.00	897,000	
チタン工業	200	1,713.00	342,600	
四国化成工業	1,300	1,005.00	1,306,500	
戸田工業	200	1,305.00	261,000	
ステラ ケミファ	500	2,480.00	1,240,000	
保土谷化学工業	300	2,938.00	881,400	
日本触媒	1,200	5,200.00	6,240,000	

大日精化工業	700	2,099.00	1,469,300	
カネカ	2,100	2,704.00	5,678,400	
三菱瓦斯化学	7,400	1,261.00	9,331,400	
三井化学	7,300	2,172.00	15,855,600	
J S R	7,500	1,832.00	13,740,000	
東京応化工業	1,400	3,895.00	5,453,000	
大阪有機化学工業	800	1,454.00	1,163,200	
三菱ケミカルホールディングス	53,500	679.60	36,358,600	
K Hネオケム	1,500	1,567.00	2,350,500	
ダイセル	10,900	795.00	8,665,500	
住友ベークライト	1,300	2,463.00	3,201,900	
積水化学工業	17,200	1,410.00	24,252,000	
日本ゼオン	7,200	824.00	5,932,800	
アイカ工業	2,400	2,922.00	7,012,800	
宇部興産	4,000	1,752.00	7,008,000	
積水樹脂	1,500	2,022.00	3,033,000	
タキロンシーアイ	1,800	601.00	1,081,800	
旭有機材	500	1,366.00	683,000	
日立化成	3,800	4,585.00	17,423,000	
ニチバン	400	1,547.00	618,800	
リケンテクノス	2,100	379.00	795,900	
大倉工業	400	1,551.00	620,400	
積水化成成品工業	1,100	562.00	618,200	
群栄化学工業	200	2,399.00	479,800	
タイガースポリマー	900	451.00	405,900	
ミライアル	300	916.00	274,800	
ダイキアクシス	300	778.00	233,400	
ダイキョーニシカワ	1,800	521.00	937,800	
竹本容器	600	664.00	398,400	
森六ホールディングス	400	1,535.00	614,000	
日本化薬	5,100	1,031.00	5,258,100	
カーリットホールディングス	900	470.00	423,000	
日本精化	700	1,371.00	959,700	
扶桑化学工業	800	2,993.00	2,394,400	
トリケミカル研究所	200	7,980.00	1,596,000	
A D E K A	3,800	1,290.00	4,902,000	



日油	3,000	3,505.00	10,515,000
新日本理化	1,300	158.00	205,400
ハリマ化成グループ	700	1,031.00	721,700
花王	19,600	8,572.00	168,011,200
第一工業製薬	300	3,770.00	1,131,000
石原ケミカル	200	1,841.00	368,200
日華化学	600	724.00	434,400
ニイタカ	100	2,389.00	238,900
三洋化成工業	500	3,990.00	1,995,000
有機合成薬品工業	1,300	236.00	306,800
大日本塗料	900	820.00	738,000
日本ペイントホールディングス	6,600	5,150.00	33,990,000
関西ペイント	9,000	2,048.00	18,432,000
神東塗料	1,300	154.00	200,200
中国塗料	2,400	843.00	2,023,200
日本特殊塗料	600	782.00	469,200
藤倉化成	1,100	480.00	528,000
太陽ホールディングス	600	4,020.00	2,412,000
D I C	3,400	2,330.00	7,922,000
サカタインクス	1,800	855.00	1,539,000
東洋インキS Cホールディングス	1,700	1,964.00	3,338,800
T & K T O K A	600	736.00	441,600
富士フイルムホールディングス	15,700	4,908.00	77,055,600
資生堂	16,200	6,493.00	105,186,600
ライオン	10,600	2,035.00	21,571,000
高砂香料工業	500	1,852.00	926,000
マンダム	1,900	2,013.00	3,824,700
ミルボン	1,100	5,300.00	5,830,000
ファンケル	3,300	2,510.00	8,283,000
コーセー	1,500	13,610.00	20,415,000
コタ	400	1,447.00	578,800
シーボン	100	2,320.00	232,000
ポーラ・オルビスホールディングス	3,500	2,065.00	7,227,500
ノエビアホールディングス	800	5,320.00	4,256,000
アジュバンコスメジャパン	200	926.00	185,200
エステー	500	1,544.00	772,000

アグロ カネショウ	300	1,398.00	419,400
コニシ	1,400	1,339.00	1,874,600
長谷川香料	1,100	1,886.00	2,074,600
星光PMC	500	640.00	320,000
小林製薬	2,300	9,040.00	20,792,000
荒川化学工業	800	1,170.00	936,000
メック	600	1,417.00	850,200
日本高純度化学	200	2,435.00	487,000
タカラバイオ	2,200	2,069.00	4,551,800
JCU	1,000	2,356.00	2,356,000
新田ゼラチン	500	557.00	278,500
OATアグリオ	300	995.00	298,500
デクセリアルズ	2,200	711.00	1,564,200
アース製薬	600	5,270.00	3,162,000
北興化学工業	900	528.00	475,200
大成ラミック	300	2,487.00	746,100
クミアイ化学工業	3,500	755.00	2,642,500
日本農薬	1,500	397.00	595,500
アキレス	600	1,432.00	859,200
有沢製作所	1,300	818.00	1,063,400
日東電工	5,600	5,070.00	28,392,000
レック	900	1,057.00	951,300
三光合成	1,000	267.00	267,000
きもと	2,900	136.00	394,400
藤森工業	800	2,686.00	2,148,800
前澤化成工業	500	983.00	491,500
未来工業	500	1,918.00	959,000
ウェーブロックホールディングス	600	533.00	319,800
JSP	500	1,419.00	709,500
エフピコ	900	6,800.00	6,120,000
天馬	600	1,766.00	1,059,600
信越ポリマー	1,500	811.00	1,216,500
東リ	2,100	262.00	550,200
ニフコ	3,100	2,026.00	6,280,600
バルカー	700	1,734.00	1,213,800
ユニ・チャーム	15,800	3,672.00	58,017,600

ショーエイコーポレーション	200	744.00	148,800	
協和キリン	8,200	2,340.00	19,188,000	
武田薬品工業	68,000	3,345.00	227,460,000	
アステラス製薬	71,900	1,657.00	119,138,300	
大日本住友製薬	6,100	1,424.00	8,686,400	
塩野義製薬	10,400	5,037.00	52,384,800	
わかもと製薬	1,000	240.00	240,000	
あすか製薬	1,000	1,075.00	1,075,000	
日本新薬	2,100	7,500.00	15,750,000	
ピオフェルミン製薬	100	2,279.00	227,900	
中外製薬	8,500	11,530.00	98,005,000	
科研製薬	1,400	4,895.00	6,853,000	
エーザイ	9,800	7,593.00	74,411,400	
ロート製薬	4,200	3,075.00	12,915,000	
小野薬品工業	18,800	2,286.00	42,976,800	
久光製薬	2,200	4,975.00	10,945,000	
持田製薬	1,100	4,155.00	4,570,500	
参天製薬	15,200	1,825.00	27,740,000	
扶桑薬品工業	300	1,945.00	583,500	
日本ケミファ	200	2,325.00	465,000	
ツムラ	2,600	2,611.00	6,788,600	
日医工	2,400	1,300.00	3,120,000	
キッセイ薬品工業	1,500	2,484.00	3,726,000	
生化学工業	1,600	1,068.00	1,708,800	
栄研化学	1,500	1,830.00	2,745,000	
日水製薬	400	1,250.00	500,000	
鳥居薬品	500	2,501.00	1,250,500	
JCRファーマ	600	8,750.00	5,250,000	
東和薬品	1,100	2,190.00	2,409,000	
富士製薬工業	600	1,147.00	688,200	
沢井製薬	1,700	5,700.00	9,690,000	
ゼリア新薬工業	1,500	1,951.00	2,926,500	
第一三共	23,400	7,224.00	169,041,600	
キョーリン製薬ホールディングス	1,900	1,945.00	3,695,500	
大幸薬品	300	4,360.00	1,308,000	
ダイト	500	2,810.00	1,405,000	

大塚ホールディングス	15,600	3,950.00	61,620,000
大正製薬ホールディングス	1,700	6,340.00	10,778,000
ペプチドリーム	4,100	4,055.00	16,625,500
日本コークス工業	7,200	62.00	446,400
ニチレキ	1,000	1,376.00	1,376,000
ユシロ化学工業	500	1,163.00	581,500
ビービー・カストロール	300	1,190.00	357,000
富士石油	2,300	201.00	462,300
MORESCO	300	858.00	257,400
出光興産	9,200	2,654.00	24,416,800
JXTGホールディングス	122,900	386.40	47,488,560
コスモエネルギーホールディングス	2,500	1,608.00	4,020,000
横浜ゴム	4,700	1,467.00	6,894,900
TOYO TIRE	4,700	1,213.00	5,701,100
ブリヂストン	23,500	3,410.00	80,135,000
住友ゴム工業	7,300	1,045.00	7,628,500
藤倉コンポジット	700	371.00	259,700
オカモト	500	3,720.00	1,860,000
フコク	400	669.00	267,600
ニッタ	1,000	2,042.00	2,042,000
住友理工	1,600	587.00	939,200
三ツ星ベルト	1,100	1,289.00	1,417,900
バンドー化学	1,500	630.00	945,000
日東紡績	1,200	4,595.00	5,514,000
AGC	8,100	2,790.00	22,599,000
日本板硝子	4,100	382.00	1,566,200
石塚硝子	200	2,033.00	406,600
日本山村硝子	400	884.00	353,600
日本電気硝子	3,400	1,516.00	5,154,400
オハラ	300	893.00	267,900
住友大阪セメント	1,600	3,500.00	5,600,000
太平洋セメント	5,200	2,123.00	11,039,600
日本ヒューム	900	619.00	557,100
日本コンクリート工業	1,800	264.00	475,200
三谷セキサン	400	4,080.00	1,632,000
アジアパイルホールディングス	1,200	416.00	499,200

東海カーボン	8,600	903.00	7,765,800	
日本カーボン	400	3,205.00	1,282,000	
東洋炭素	500	1,575.00	787,500	
ノリタケカンパニーリミテド	500	3,390.00	1,695,000	
TOTO	5,800	3,790.00	21,982,000	
日本碍子	10,000	1,525.00	15,250,000	
日本特殊陶業	6,400	1,572.00	10,060,800	
ダントーホールディングス	1,400	75.00	105,000	
MARUWA	300	6,470.00	1,941,000	
品川リフラクトリーズ	200	2,349.00	469,800	
黒崎播磨	200	4,480.00	896,000	
ヨータイ	700	630.00	441,000	
イソライト工業	400	474.00	189,600	
東京窯業	1,100	252.00	277,200	
ニッカトー	400	553.00	221,200	
フジインコーポレーテッド	800	2,599.00	2,079,200	
クニミネ工業	300	982.00	294,600	
エーアンドエーマテリアル	300	1,142.00	342,600	
ニチアス	2,300	2,109.00	4,850,700	
ニチハ	1,200	2,068.00	2,481,600	
日本製鉄	36,200	1,085.00	39,277,000	
神戸製鋼所	14,800	391.00	5,786,800	
中山製鋼所	1,200	394.00	472,800	
合同製鐵	500	2,242.00	1,121,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	21,800	846.00	18,442,800	
東京製鐵	4,100	664.00	2,722,400	
共英製鋼	900	1,367.00	1,230,300	
大和工業	1,800	1,959.00	3,526,200	
東京鐵鋼	300	1,150.00	345,000	
大阪製鐵	400	1,221.00	488,400	
淀川製鋼所	1,100	1,811.00	1,992,100	
丸一鋼管	2,700	2,755.00	7,438,500	
モリ工業	300	2,200.00	660,000	
大同特殊鋼	1,300	3,575.00	4,647,500	
日本高周波鋼業	600	374.00	224,400	
日本冶金工業	700	1,678.00	1,174,600	

山陽特殊製鋼	600	1,025.00	615,000
愛知製鋼	500	3,070.00	1,535,000
日立金属	8,700	1,186.00	10,318,200
日本金属	400	670.00	268,000
大平洋金属	600	1,721.00	1,032,600
新日本電工	5,400	147.00	793,800
栗本鐵工所	400	1,853.00	741,200
虹技	300	1,014.00	304,200
日本鑄鉄管	200	1,362.00	272,400
三菱製鋼	600	775.00	465,000
日亜鋼業	1,200	282.00	338,400
日本精線	100	3,340.00	334,000
エンビプロ・ホールディングス	700	538.00	376,600
シンニッタン	1,300	234.00	304,200
新家工業	200	1,173.00	234,600
大紀アルミニウム工業所	1,400	580.00	812,000
日本軽金属ホールディングス	21,200	177.00	3,752,400
三井金属鉱業	2,200	1,905.00	4,191,000
東邦亜鉛	400	1,333.00	533,200
三菱マテリアル	5,300	2,253.00	11,940,900
住友金属鉱山	10,300	2,391.00	24,627,300
DOWAホールディングス	2,100	2,968.00	6,232,800
古河機械金属	1,500	1,126.00	1,689,000
エス・サイエンス	7,900	34.00	268,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	900	999.00	899,100
東邦チタニウム	1,500	680.00	1,020,000
UACJ	1,300	1,662.00	2,160,600
CKサンエツ	200	2,760.00	552,000
古河電気工業	2,600	2,012.00	5,231,200
住友電気工業	30,200	1,170.50	35,349,100
フジクラ	10,100	311.00	3,141,100
昭和電線ホールディングス	1,000	1,067.00	1,067,000
東京特殊電線	100	2,535.00	253,500
タツタ電線	1,700	470.00	799,000
カナレ電気	100	1,490.00	149,000
平河ヒューテック	300	900.00	270,000

リヨービ	1,000	1,279.00	1,279,000	
アーレスティ	1,100	369.00	405,900	
アサヒホールディングス	1,500	2,379.00	3,568,500	
稲葉製作所	500	1,210.00	605,000	
宮地エンジニアリンググループ	300	1,698.00	509,400	
トーカロ	2,300	961.00	2,210,300	
アルファC o	300	971.00	291,300	
SUMCO	9,700	1,419.00	13,764,300	
川田テクノロジーズ	200	5,480.00	1,096,000	
RS Technologies	200	2,155.00	431,000	
信和	400	803.00	321,200	
東洋製罐グループホールディングス	5,300	1,309.00	6,937,700	
ホッカンホールディングス	500	1,668.00	834,000	
コロナ	500	970.00	485,000	
横河ブリッジホールディングス	1,600	1,799.00	2,878,400	
駒井ハルテック	200	1,478.00	295,600	
高田機工	100	2,360.00	236,000	
三和ホールディングス	8,000	845.00	6,760,000	
文化シャッター	2,500	791.00	1,977,500	
三協立山	1,100	1,036.00	1,139,600	
アルインコ	600	924.00	554,400	
東洋シャッター	400	610.00	244,000	
LIXILグループ	11,900	1,329.00	15,815,100	
日本フィルコン	600	453.00	271,800	
ノーリツ	1,700	1,094.00	1,859,800	
長府製作所	900	2,275.00	2,047,500	
リンナイ	1,600	7,310.00	11,696,000	
ダイニチ工業	500	623.00	311,500	
日東精工	1,200	458.00	549,600	
三洋工業	200	1,700.00	340,000	
岡部	1,700	705.00	1,198,500	
ジーテクト	1,000	1,138.00	1,138,000	
東プレ	1,600	1,242.00	1,987,200	
高周波熱錬	1,600	659.00	1,054,400	
東京製綱	600	600.00	360,000	
サンコール	500	441.00	220,500	

モリテック スチール	1,300	273.00	354,900
パイオラックス	1,200	1,499.00	1,798,800
エイチワン	800	522.00	417,600
日本発條	8,700	730.00	6,351,000
中央発條	100	2,534.00	253,400
アドバネクス	100	1,368.00	136,800
立川ブラインド工業	400	1,031.00	412,400
三益半導体工業	700	1,714.00	1,199,800
日本ドライケミカル	200	1,424.00	284,800
日本製鋼所	2,500	1,259.00	3,147,500
三浦工業	3,500	3,515.00	12,302,500
タクマ	2,800	1,144.00	3,203,200
ツガミ	1,700	764.00	1,298,800
オークマ	1,000	3,765.00	3,765,000
東芝機械	900	2,235.00	2,011,500
アマダホールディングス	10,300	909.00	9,362,700
アイダエンジニアリング	2,200	707.00	1,555,400
滝澤鉄工所	300	1,094.00	328,200
F U J I	3,600	1,660.00	5,976,000
牧野フライス製作所	1,000	3,080.00	3,080,000
オーエスジー	3,700	1,497.00	5,538,900
ダイジェット工業	200	1,200.00	240,000
旭ダイヤモンド工業	2,200	482.00	1,060,400
D M G 森精機	5,300	1,027.00	5,443,100
ソディック	2,000	660.00	1,320,000
ディスコ	1,100	22,280.00	24,508,000
日東工器	500	1,669.00	834,500
日進工具	200	2,450.00	490,000
パンチ工業	800	424.00	339,200
富士ダイス	400	620.00	248,000
豊和工業	500	625.00	312,500
O K K	700	465.00	325,500
石川製作所	200	1,234.00	246,800
東洋機械金属	600	403.00	241,800
津田駒工業	300	810.00	243,000
エンシュウ	400	943.00	377,200



島精機製作所	1,300	1,556.00	2,022,800	
オプトラン	900	2,618.00	2,356,200	
NCホールディングス	500	542.00	271,000	
イワキポンプ	400	845.00	338,000	
フリュー	800	890.00	712,000	
ヤマシンフィルタ	1,800	745.00	1,341,000	
日阪製作所	1,000	754.00	754,000	
やまびこ	1,600	778.00	1,244,800	
平田機工	400	4,665.00	1,866,000	
ペガサスミシン製造	900	358.00	322,200	
マルマエ	300	695.00	208,500	
タツモ	400	1,082.00	432,800	
ナブテスコ	4,800	2,554.00	12,259,200	
三井海洋開発	900	1,375.00	1,237,500	
レオン自動機	800	1,161.00	928,800	
S M C	2,600	45,840.00	119,184,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディングス	700	743.00	520,100	
ホソカワミクロン	300	4,620.00	1,386,000	
ユニオンツール	300	2,513.00	753,900	
オイレス工業	1,100	1,328.00	1,460,800	
日精エー・エス・ピー機械	300	3,225.00	967,500	
サトーホールディングス	1,200	2,116.00	2,539,200	
技研製作所	700	3,635.00	2,544,500	
日本エアテック	300	786.00	235,800	
カワタ	500	730.00	365,000	
日精樹脂工業	700	964.00	674,800	
オカダアイヨン	300	911.00	273,300	
ワイエイシイホールディングス	800	424.00	339,200	
小松製作所	37,000	1,903.50	70,429,500	
住友重機械工業	4,700	2,093.00	9,837,100	
日立建機	3,300	2,454.00	8,098,200	
日工	1,200	617.00	740,400	
巴工業	400	1,872.00	748,800	
井関農機	800	1,126.00	900,800	
T O W A	900	763.00	686,700	

丸山製作所	200	1,079.00	215,800	
北川鉄工所	400	1,600.00	640,000	
ローツェ	400	3,185.00	1,274,000	
タカキタ	600	468.00	280,800	
クボタ	43,400	1,315.50	57,092,700	
荏原実業	200	2,106.00	421,200	
三菱化工機	300	1,640.00	492,000	
月島機械	1,600	1,272.00	2,035,200	
帝国電機製作所	700	1,267.00	886,900	
東京機械製作所	700	241.00	168,700	
新東工業	2,000	738.00	1,476,000	
澁谷工業	700	2,351.00	1,645,700	
アイチ コーポレーション	1,500	649.00	973,500	
小森コーポレーション	2,200	758.00	1,667,600	
鶴見製作所	700	1,956.00	1,369,200	
住友精密工業	100	2,156.00	215,600	
日本ギア工業	500	243.00	121,500	
酒井重工業	200	2,446.00	489,200	
荏原製作所	3,400	2,094.00	7,119,600	
石井鐵工所	100	2,266.00	226,600	
西島製作所	900	789.00	710,100	
北越工業	900	1,028.00	925,200	
ダイキン工業	10,400	14,040.00	146,016,000	
オルガノ	300	5,440.00	1,632,000	
トーヨーカネツ	400	2,033.00	813,200	
栗田工業	4,400	2,518.00	11,079,200	
椿本チエイン	1,200	2,506.00	3,007,200	
大同工業	400	667.00	266,800	
木村化工機	700	459.00	321,300	
アネスト岩田	1,300	894.00	1,162,200	
ダイフク	4,200	6,410.00	26,922,000	
サムコ	200	1,670.00	334,000	
加藤製作所	500	1,196.00	598,000	
油研工業	100	1,546.00	154,600	
タダノ	4,100	777.00	3,185,700	
フジテック	3,100	1,429.00	4,429,900	

C K D	2,400	1,478.00	3,547,200	
キトー	600	1,021.00	612,600	
平和	2,300	2,041.00	4,694,300	
理想科学工業	700	1,594.00	1,115,800	
S A N K Y O	1,800	3,175.00	5,715,000	
日本金銭機械	900	570.00	513,000	
マースグループホールディングス	500	1,694.00	847,000	
フクシマガリレイ	500	3,370.00	1,685,000	
オーイズミ	700	379.00	265,300	
ダイコク電機	400	1,191.00	476,400	
竹内製作所	1,400	1,375.00	1,925,000	
アマノ	2,200	2,511.00	5,524,200	
J U K I	1,200	575.00	690,000	
サンデンホールディングス	1,100	394.00	433,400	
蛇の目マシン工業	800	306.00	244,800	
マックス	1,300	1,605.00	2,086,500	
グローリー	2,100	2,435.00	5,113,500	
新晃工業	800	1,397.00	1,117,600	
大和冷機工業	1,200	917.00	1,100,400	
セガサミーホールディングス	8,100	1,304.00	10,562,400	
日本ピストンリング	300	1,269.00	380,700	
リケン	400	2,696.00	1,078,400	
T P R	1,100	1,277.00	1,404,700	
ツバキ・ナカシマ	1,700	700.00	1,190,000	
ホシザキ	2,400	9,110.00	21,864,000	
大豊工業	700	537.00	375,900	
日本精工	15,400	744.00	11,457,600	
N T N	19,600	211.00	4,135,600	
ジェイテクト	8,100	821.00	6,650,100	
不二越	800	2,923.00	2,338,400	
日本トムソン	2,500	384.00	960,000	
T H K	4,800	2,303.00	11,054,400	
ユーシン精機	700	675.00	472,500	
前澤給装工業	300	1,975.00	592,500	
イーグル工業	1,000	755.00	755,000	
前澤工業	1,100	304.00	334,400	

日本ピラー工業	900	1,220.00	1,098,000	
キット	3,400	612.00	2,080,800	
マキタ	10,700	3,305.00	35,363,500	
日立造船	6,700	356.00	2,385,200	
三菱重工業	13,700	2,961.50	40,572,550	
I H I	5,900	1,523.00	8,985,700	
スター精密	1,300	1,113.00	1,446,900	
日清紡ホールディングス	5,700	714.00	4,069,800	
イビデン	5,000	2,280.00	11,400,000	
コニカミノルタ	17,900	480.00	8,592,000	
ブラザー工業	10,000	1,667.00	16,670,000	
ミネベアミツミ	15,200	1,647.00	25,034,400	
日立製作所	39,300	3,207.00	126,035,100	
三菱電機	81,700	1,331.00	108,742,700	
富士電機	4,900	2,469.00	12,098,100	
東洋電機製造	300	1,160.00	348,000	
安川電機	8,800	3,075.00	27,060,000	
シンフォニアテクノロジー	1,100	955.00	1,050,500	
明電舎	1,600	1,620.00	2,592,000	
オリジン	200	1,398.00	279,600	
山洋電気	400	4,110.00	1,644,000	
デンヨー	700	1,877.00	1,313,900	
東芝テック	1,000	3,475.00	3,475,000	
芝浦メカトロニクス	200	2,581.00	516,200	
マブチモーター	2,300	3,225.00	7,417,500	
日本電産	9,800	11,200.00	109,760,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	242.00	242,000	
トレックス・セミコンダクター	500	1,008.00	504,000	
東光高岳	500	959.00	479,500	
ダブル・スコープ	1,300	490.00	637,000	
宮越ホールディングス	300	553.00	165,900	
ダイヘン	900	2,847.00	2,562,300	
ヤーマン	1,400	624.00	873,600	
JVCケンウッド	6,900	201.00	1,386,900	
ミマキエンジニアリング	800	407.00	325,600	
第一精工	300	1,838.00	551,400	

日新電機	2,000	881.00	1,762,000	
大崎電気工業	1,700	524.00	890,800	
オムロン	7,300	5,890.00	42,997,000	
日東工業	1,200	1,731.00	2,077,200	
I D E C	1,200	1,348.00	1,617,600	
正興電機製作所	400	943.00	377,200	
不二電機工業	200	1,099.00	219,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,800	1,567.00	4,387,600	
サクサホールディングス	200	1,467.00	293,400	
メルコホールディングス	300	2,101.00	630,300	
テクノメディカ	400	1,822.00	728,800	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	485.00	145,500	
日本電気	9,900	3,965.00	39,253,500	
富士通	7,900	9,528.00	75,271,200	
沖電気工業	3,400	1,068.00	3,631,200	
岩崎通信機	400	810.00	324,000	
電気興業	400	2,524.00	1,009,600	
サンケン電気	900	2,176.00	1,958,400	
ナカヨ	400	1,468.00	587,200	
アイホン	500	1,499.00	749,500	
ルネサスエレクトロニクス	39,100	433.00	16,930,300	
セイコーエプソン	10,100	1,260.00	12,726,000	
ワコム	5,700	308.00	1,755,600	
アルバック	1,500	2,791.00	4,186,500	
アクセル	700	586.00	410,200	
E I Z O	700	3,090.00	2,163,000	
ジャパンディスプレイ	24,500	49.00	1,200,500	
日本信号	2,200	1,116.00	2,455,200	
京三製作所	2,000	456.00	912,000	
能美防災	1,100	1,894.00	2,083,400	
ホーチキ	600	1,245.00	747,000	
星和電機	400	547.00	218,800	
エレコム	900	3,730.00	3,357,000	
パナソニック	93,400	842.90	78,726,860	
シャープ	9,500	1,161.00	11,029,500	

アンリツ	5,300	2,000.00	10,600,000	
富士通ゼネラル	2,300	1,884.00	4,333,200	
ソニー	51,700	6,500.00	336,050,000	
T D K	3,900	8,950.00	34,905,000	
帝国通信工業	400	1,150.00	460,000	
タムラ製作所	2,800	403.00	1,128,400	
アルプスアルパイン	7,200	1,117.00	8,042,400	
池上通信機	300	862.00	258,600	
日本電波工業	800	344.00	275,200	
鈴木	400	620.00	248,000	
日本トリム	100	2,926.00	292,600	
ローランド ディー . ジー .	500	1,202.00	601,000	
フォスター電機	900	1,101.00	990,900	
S M K	200	2,292.00	458,400	
ヨコオ	500	2,399.00	1,199,500	
ティアック	1,100	165.00	181,500	
ホシデン	2,300	753.00	1,731,900	
ヒロセ電機	1,300	11,110.00	14,443,000	
日本航空電子工業	1,900	1,288.00	2,447,200	
T O A	900	778.00	700,200	
マクセルホールディングス	1,800	1,187.00	2,136,600	
古野電気	1,100	811.00	892,100	
ユニデンホールディングス	200	1,839.00	367,800	
スミダコーポレーション	700	690.00	483,000	
アイコム	500	2,513.00	1,256,500	
リオン	400	2,245.00	898,000	
本多通信工業	700	396.00	277,200	
船井電機	900	459.00	413,100	
横河電機	7,500	1,325.00	9,937,500	
新電元工業	300	2,534.00	760,200	
アズビル	5,200	2,706.00	14,071,200	
東亜ディーケーケー	400	905.00	362,000	
日本光電工業	3,400	3,325.00	11,305,000	
チノー	300	1,220.00	366,000	
共和電業	900	380.00	342,000	
日本電子材料	300	875.00	262,500	

堀場製作所	1,600	5,450.00	8,720,000	
アドバンテスト	6,100	4,570.00	27,877,000	
小野測器	700	485.00	339,500	
エスベック	800	1,681.00	1,344,800	
キーエンス	7,400	34,550.00	255,670,000	
日置電機	400	2,985.00	1,194,000	
シスメックス	5,800	7,213.00	41,835,400	
日本マイクロニクス	1,500	783.00	1,174,500	
メガチップス	800	1,577.00	1,261,600	
O B A R A G R O U P	400	2,360.00	944,000	
澤藤電機	200	1,400.00	280,000	
原田工業	400	909.00	363,600	
コーセル	1,100	930.00	1,023,000	
イリソ電子工業	700	3,215.00	2,250,500	
オブテックスグループ	1,400	1,030.00	1,442,000	
千代田インテグレ	400	1,661.00	664,400	
アイ・オー・データ機器	300	820.00	246,000	
レーザーテック	3,600	5,300.00	19,080,000	
スタンレー電気	5,700	2,189.00	12,477,300	
岩崎電気	300	1,237.00	371,100	
ウシオ電機	4,900	1,115.00	5,463,500	
岡谷電機産業	600	314.00	188,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	800	274.00	219,200	
エノモト	500	836.00	418,000	
日本セラミック	900	1,897.00	1,707,300	
遠藤照明	400	562.00	224,800	
古河電池	600	564.00	338,400	
双信電機	800	356.00	284,800	
山一電機	600	1,469.00	881,400	
図研	600	2,097.00	1,258,200	
日本電子	1,700	2,584.00	4,392,800	
カシオ計算機	7,200	1,493.00	10,749,600	
ファナック	7,800	15,365.00	119,847,000	
日本シイエムケイ	2,000	451.00	902,000	
エンプラス	400	2,281.00	912,400	
大真空	300	1,494.00	448,200	

ローム	3,600	6,540.00	23,544,000	
浜松ホトニクス	5,900	4,185.00	24,691,500	
三井ハイテック	900	1,147.00	1,032,300	
新光電気工業	2,800	1,036.00	2,900,800	
京セラ	11,500	6,433.00	73,979,500	
太陽誘電	3,600	2,908.00	10,468,800	
村田製作所	24,000	5,510.00	132,240,000	
双葉電子工業	1,300	1,001.00	1,301,300	
北陸電気工業	300	900.00	270,000	
ニチコン	2,900	669.00	1,940,100	
日本ケミコン	600	1,287.00	772,200	
K O A	1,300	897.00	1,166,100	
市光工業	1,300	470.00	611,000	
小糸製作所	4,900	3,505.00	17,174,500	
ミツバ	1,600	457.00	731,200	
S C R E E Nホールディングス	1,400	4,235.00	5,929,000	
キャノン電子	900	1,560.00	1,404,000	
キャノン	44,000	2,479.00	109,076,000	
リコー	20,800	884.00	18,387,200	
象印マホービン	2,500	1,537.00	3,842,500	
M U T O Hホールディングス	200	1,649.00	329,800	
東京エレクトロン	5,400	21,170.00	114,318,000	
トヨタ紡織	2,500	1,313.00	3,282,500	
芦森工業	200	963.00	192,600	
ユニプレス	1,600	1,010.00	1,616,000	
豊田自動織機	6,600	5,190.00	34,254,000	
モリタホールディングス	1,500	1,641.00	2,461,500	
三櫻工業	1,100	742.00	816,200	
デンソー	18,000	3,633.00	65,394,000	
東海理化電機製作所	2,200	1,404.00	3,088,800	
三井E & Sホールディングス	3,100	578.00	1,791,800	
川崎重工業	6,400	1,733.00	11,091,200	
名村造船所	2,700	204.00	550,800	
サノヤスホールディングス	2,200	150.00	330,000	
日本車輛製造	300	2,547.00	764,100	
三菱ロジスネクスト	1,100	906.00	996,600	



近畿車輛	300	1,161.00	348,300	
日産自動車	96,400	401.10	38,666,040	
いすゞ自動車	23,700	770.00	18,249,000	
トヨタ自動車	91,200	6,919.00	631,012,800	
日野自動車	10,200	632.00	6,446,400	
三菱自動車工業	30,300	333.00	10,089,900	
エフテック	600	483.00	289,800	
レシップホールディングス	700	429.00	300,300	
G M B	300	603.00	180,900	
ファルテック	300	696.00	208,800	
武蔵精密工業	1,900	811.00	1,540,900	
日産車体	1,700	843.00	1,433,100	
新明和工業	2,300	1,199.00	2,757,700	
極東開発工業	1,600	1,180.00	1,888,000	
日信工業	1,700	2,171.00	3,690,700	
トピー工業	700	1,321.00	924,700	
ティラド	300	1,363.00	408,900	
曙ブレーキ工業	4,700	161.00	756,700	
タチエス	1,400	1,004.00	1,405,600	
N O K	4,400	1,165.00	5,126,000	
フタバ産業	2,400	463.00	1,111,200	
K Y B	900	2,257.00	2,031,300	
大同メタル工業	1,600	565.00	904,000	
プレス工業	4,200	247.00	1,037,400	
ミクニ	1,100	272.00	299,200	
太平洋工業	1,800	967.00	1,740,600	
ケーヒン	1,900	2,534.00	4,814,600	
河西工業	1,100	571.00	628,100	
アイシン精機	6,700	2,850.00	19,095,000	
マツダ	24,000	655.00	15,720,000	
今仙電機製作所	800	668.00	534,400	
本田技研工業	64,300	2,594.00	166,794,200	
スズキ	16,200	2,911.50	47,166,300	
S U B A R U	25,400	2,251.50	57,188,100	
安永	400	950.00	380,000	
ヤマハ発動機	10,700	1,413.00	15,119,100	

ショーワ	2,000	2,226.00	4,452,000	
T B K	1,000	498.00	498,000	
エクセディ	1,200	1,656.00	1,987,200	
豊田合成	2,700	1,970.00	5,319,000	
愛三工業	1,300	486.00	631,800	
盟和産業	300	878.00	263,400	
日本プラスト	700	475.00	332,500	
ヨロズ	800	1,093.00	874,400	
エフ・シー・シー	1,400	1,625.00	2,275,000	
シマノ	3,100	14,670.00	45,477,000	
テイ・エス テック	1,900	2,580.00	4,902,000	
ジャムコ	400	731.00	292,400	
テルモ	23,100	3,558.00	82,189,800	
クリエートメディック	300	1,092.00	327,600	
日機装	2,500	823.00	2,057,500	
日本エム・ディ・エム	500	1,602.00	801,000	
島津製作所	9,800	2,763.00	27,077,400	
J M S	700	734.00	513,800	
クボテック	400	269.00	107,600	
長野計器	600	777.00	466,200	
ブイ・テクノロジー	400	3,445.00	1,378,000	
東京計器	500	716.00	358,000	
愛知時計電機	100	4,045.00	404,500	
インターアクション	500	2,183.00	1,091,500	
オーバル	1,500	235.00	352,500	
東京精密	1,500	3,040.00	4,560,000	
マニー	3,300	2,567.00	8,471,100	
ニコン	13,200	1,033.00	13,635,600	
トプコン	4,300	826.00	3,551,800	
オリンパス	45,200	1,601.50	72,387,800	
理研計器	700	2,165.00	1,515,500	
タムロン	700	1,858.00	1,300,600	
H O Y A	16,300	8,979.00	146,357,700	
シード	400	808.00	323,200	
ノーリツ鋼機	600	932.00	559,200	
エー・アンド・デイ	800	665.00	532,000	

朝日インテック	6,900	2,662.00	18,367,800
シチズン時計	9,900	374.00	3,702,600
リズム時計工業	300	668.00	200,400
大研医器	600	551.00	330,600
メニコン	1,200	4,035.00	4,842,000
シンシア	200	320.00	64,000
松風	400	1,782.00	712,800
セイコーホールディングス	1,200	1,819.00	2,182,800
ニプロ	5,700	1,101.00	6,275,700
中本パックス	200	1,217.00	243,400
スノーピーク	400	749.00	299,600
パラマウントベッドホールディングス	900	4,240.00	3,816,000
トランザクション	500	785.00	392,500
粧美堂	500	333.00	166,500
ニホンフラッシュ	400	2,165.00	866,000
前田工織	900	1,934.00	1,740,600
永大産業	1,100	290.00	319,000
アートネイチャー	900	652.00	586,800
バンダイナムコホールディングス	8,400	5,369.00	45,099,600
アイフィスジャパン	400	616.00	246,400
共立印刷	1,400	153.00	214,200
S H O E I	400	4,090.00	1,636,000
フランスベッドホールディングス	1,200	851.00	1,021,200
パイロットコーポレーション	1,300	3,460.00	4,498,000
萩原工業	500	1,270.00	635,000
トッパン・フォームズ	1,800	914.00	1,645,200
フジシールインターナショナル	1,900	1,909.00	3,627,100
タカラトミー	3,800	823.00	3,127,400
廣濟堂	600	724.00	434,400
エステールホールディングス	500	621.00	310,500
アーク	3,200	73.00	233,600
タカノ	700	714.00	499,800
プロネクサス	700	1,035.00	724,500
ホクシン	1,100	124.00	136,400
ウッドワン	600	1,136.00	681,600
大建工業	600	1,624.00	974,400

凸版印刷	11,500	1,686.00	19,389,000
大日本印刷	10,700	2,246.00	24,032,200
共同印刷	300	2,693.00	807,900
N I S S H A	1,700	742.00	1,261,400
光村印刷	100	1,265.00	126,500
T A K A R A & C O M P A N Y	400	1,652.00	660,800
アシックス	6,700	1,008.00	6,753,600
ツツミ	300	1,820.00	546,000
小松ウオール工業	300	1,925.00	577,500
ヤマハ	4,900	4,545.00	22,270,500
河合楽器製作所	300	2,428.00	728,400
クリナップ	800	545.00	436,000
ピジョン	4,900	3,795.00	18,595,500
オリバー	200	3,200.00	640,000
兼松サステック	100	1,483.00	148,300
キングジム	700	805.00	563,500
リンテック	2,000	2,163.00	4,326,000
イトーキ	1,800	325.00	585,000
任天堂	5,000	39,640.00	198,200,000
三菱鉛筆	1,400	1,312.00	1,836,800
タカラスタANDARD	1,800	1,581.00	2,845,800
コクヨ	3,900	1,442.00	5,623,800
ナカバヤシ	800	530.00	424,000
グローブライド	400	1,878.00	751,200
オカムラ	3,000	862.00	2,586,000
美津濃	800	1,879.00	1,503,200
東京電力ホールディングス	65,200	382.00	24,906,400
中部電力	25,000	1,412.50	35,312,500
関西電力	31,000	1,120.50	34,735,500
中国電力	11,800	1,459.00	17,216,200
北陸電力	7,500	720.00	5,400,000
東北電力	20,400	985.00	20,094,000
四国電力	7,600	831.00	6,315,600
九州電力	16,800	861.00	14,464,800
北海道電力	7,900	448.00	3,539,200
沖縄電力	1,600	1,816.00	2,905,600

電源開発	6,500	2,159.00	14,033,500	
エフオン	500	492.00	246,000	
イーレックス	1,200	1,211.00	1,453,200	
レノバ	1,400	886.00	1,240,400	
東京瓦斯	15,700	2,409.50	37,829,150	
大阪瓦斯	15,900	1,904.00	30,273,600	
東邦瓦斯	4,000	4,620.00	18,480,000	
北海道瓦斯	500	1,560.00	780,000	
広島ガス	1,700	359.00	610,300	
西部瓦斯	1,000	2,508.00	2,508,000	
静岡ガス	2,400	836.00	2,006,400	
メタウォーター	400	3,680.00	1,472,000	
SBSホールディングス	700	1,681.00	1,176,700	
東武鉄道	8,600	3,710.00	31,906,000	
相鉄ホールディングス	2,600	2,834.00	7,368,400	
東急	20,600	1,711.00	35,246,600	
京浜急行電鉄	10,500	1,859.00	19,519,500	
小田急電鉄	12,200	2,425.00	29,585,000	
京王電鉄	4,200	6,300.00	26,460,000	
京成電鉄	5,700	3,230.00	18,411,000	
富士急行	1,100	2,899.00	3,188,900	
新京成電鉄	200	2,297.00	459,400	
東日本旅客鉄道	14,400	8,400.00	120,960,000	
西日本旅客鉄道	7,300	7,449.00	54,377,700	
東海旅客鉄道	6,800	18,150.00	123,420,000	
西武ホールディングス	11,000	1,311.00	14,421,000	
鴻池運輸	1,400	1,150.00	1,610,000	
西日本鉄道	2,300	2,630.00	6,049,000	
ハマキョウレックス	700	2,625.00	1,837,500	
サカイ引越センター	400	5,670.00	2,268,000	
近鉄グループホールディングス	7,700	5,200.00	40,040,000	
阪急阪神ホールディングス	10,300	3,700.00	38,110,000	
南海電気鉄道	3,700	2,384.00	8,820,800	
京阪ホールディングス	3,400	4,835.00	16,439,000	
神戸電鉄	200	3,890.00	778,000	
名古屋鉄道	6,400	3,115.00	19,936,000	

山陽電気鉄道	600	2,120.00	1,272,000	
日本通運	2,700	5,270.00	14,229,000	
ヤマトホールディングス	13,600	1,659.00	22,562,400	
山九	2,200	4,085.00	8,987,000	
丸運	1,000	237.00	237,000	
丸全昭和運輸	700	2,103.00	1,472,100	
センコーグループホールディングス	4,400	816.00	3,590,400	
トナミホールディングス	200	4,075.00	815,000	
ニッコンホールディングス	2,800	2,110.00	5,908,000	
日本石油輸送	100	2,729.00	272,900	
福山通運	1,000	3,885.00	3,885,000	
セイノーホールディングス	5,800	1,185.00	6,873,000	
エスライン	500	835.00	417,500	
神奈川中央交通	200	4,150.00	830,000	
日立物流	1,500	2,432.00	3,648,000	
丸和運輸機関	800	2,472.00	1,977,600	
C & F ロジホールディングス	800	1,310.00	1,048,000	
九州旅客鉄道	6,900	3,145.00	21,700,500	
S Gホールディングス	8,100	2,440.00	19,764,000	
日本郵船	6,500	1,441.00	9,366,500	
商船三井	4,900	1,958.00	9,594,200	
川崎汽船	2,500	924.00	2,310,000	
N S ユナイテッド海運	400	1,515.00	606,000	
明治海運	900	335.00	301,500	
飯野海運	3,800	310.00	1,178,000	
共栄タンカー	300	909.00	272,700	
乾汽船	500	1,270.00	635,000	
日本航空	13,900	2,163.00	30,065,700	
A N Aホールディングス	14,100	2,915.50	41,108,550	
パスコ	300	1,438.00	431,400	
トランコム	200	6,610.00	1,322,000	
日新	700	1,568.00	1,097,600	
三菱倉庫	2,500	2,283.00	5,707,500	
三井倉庫ホールディングス	900	1,445.00	1,300,500	
住友倉庫	3,000	1,213.00	3,639,000	
澁澤倉庫	400	1,958.00	783,200	

東陽倉庫	1,500	335.00	502,500
日本トランスシティ	1,800	421.00	757,800
ケイヒン	300	1,144.00	343,200
中央倉庫	1,000	1,229.00	1,229,000
川西倉庫	300	916.00	274,800
安田倉庫	700	877.00	613,900
ファイズホールディングス	300	930.00	279,000
東洋埠頭	200	1,323.00	264,600
宇徳	700	523.00	366,100
上組	4,400	1,908.00	8,395,200
サンリツ	400	541.00	216,400
キムラユニティー	200	954.00	190,800
キューソー流通システム	200	1,648.00	329,600
近鉄エクスプレス	1,700	1,595.00	2,711,500
東海運	1,000	263.00	263,000
エーアイティー	600	701.00	420,600
内外トランスライン	300	1,079.00	323,700
日本コンセプト	300	1,325.00	397,500
N E C ネットエスアイ	800	3,710.00	2,968,000
クロスキャット	200	797.00	159,400
システナ	3,000	1,442.00	4,326,000
デジタルアーツ	400	4,715.00	1,886,000
日鉄ソリューションズ	1,200	2,769.00	3,322,800
キューブシステム	400	579.00	231,600
エイジア	300	1,233.00	369,900
コア	400	1,176.00	470,400
ソリトンシステムズ	400	940.00	376,000
ソフトクリエイティブホールディングス	400	1,642.00	656,800
T I S	2,700	5,270.00	14,229,000
ネオス	700	514.00	359,800
電算システム	300	2,036.00	610,800
グリー	5,100	405.00	2,065,500
コーエーテクモホールディングス	1,700	2,533.00	4,306,100
三菱総合研究所	400	3,250.00	1,300,000
ボルテージ	300	310.00	93,000
電算	100	2,172.00	217,200

A G S	500	740.00	370,000
ファインデックス	700	689.00	482,300
ブレインパッド	200	4,470.00	894,000
K L a b	1,600	651.00	1,041,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,000	742.00	742,000
イーブックイニシアティブジャパン	100	1,185.00	118,500
ネクソン	22,800	1,682.00	38,349,600
アイスタイル	2,300	224.00	515,200
エムアップ	200	2,120.00	424,000
エイチーム	600	640.00	384,000
エニグモ	600	820.00	492,000
テクノスジャパン	600	361.00	216,600
e n i s h	800	401.00	320,800
コロブラ	2,700	836.00	2,257,200
オルトプラス	600	1,012.00	607,200
ブロードリーフ	4,100	464.00	1,902,400
クロス・マーケティンググループ	700	269.00	188,300
デジタルハーツホールディングス	400	732.00	292,800
システム情報	400	627.00	250,800
メディアドゥホールディングス	300	2,856.00	856,800
じげん	2,100	287.00	602,700
ブイキューブ	500	770.00	385,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	625.00	187,500
サイバーリンクス	300	917.00	275,100
ディー・エル・イー	1,200	118.00	141,600
フィックスターズ	900	1,045.00	940,500
C A R T A H O L D I N G S	400	851.00	340,400
オブティム	200	3,700.00	740,000
セレス	300	735.00	220,500
S H I F T	200	6,890.00	1,378,000
ティーガイア	700	2,015.00	1,410,500
セック	100	2,754.00	275,400
日本アジアグループ	900	259.00	233,100
豆蔵ホールディングス	600	1,885.00	1,131,000
テクマトリックス	600	2,149.00	1,289,400



プロシップ	200	1,098.00	219,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,000	1,551.00	3,102,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,300	7,490.00	9,737,000	
ザッパラス	900	323.00	290,700	
システムリサーチ	200	1,470.00	294,000	
インターネットイニシアティブ	1,200	3,100.00	3,720,000	
さくらインターネット	900	444.00	399,600	
ヴィンクス	500	720.00	360,000	
GMOクラウド	200	1,746.00	349,200	
SRAホールディングス	400	2,112.00	844,800	
システムインテグレータ	300	616.00	184,800	
朝日ネット	600	636.00	381,600	
eBASE	500	1,505.00	752,500	
アバント	600	827.00	496,200	
アドソル日進	300	2,179.00	653,700	
フリービット	400	614.00	245,600	
コムチュア	900	2,040.00	1,836,000	
サイバーコム	100	1,519.00	151,900	
アステリア	1,100	326.00	358,600	
アイル	300	1,486.00	445,800	
マークライنز	400	1,569.00	627,600	
メディカル・データ・ビジョン	600	638.00	382,800	
gumi	1,100	596.00	655,600	
ショーケース	400	446.00	178,400	
モバイルファクトリー	200	1,113.00	222,600	
テラスカイ	300	2,587.00	776,100	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	300	1,148.00	344,400	
PCIホールディングス	200	1,784.00	356,800	
パイブドHD	200	1,244.00	248,800	
アイビーシー	300	808.00	242,400	
ネオジャパン	300	900.00	270,000	
PR TIMES	100	1,860.00	186,000	
ランドコンピュータ	300	1,014.00	304,200	
ダブルスタンダード	100	3,505.00	350,500	
オープンドア	400	845.00	338,000	

マイネット	300	669.00	200,700
アカツキ	300	3,735.00	1,120,500
ベネフィットジャパン	100	1,393.00	139,300
Ubicomホールディングス	200	1,386.00	277,200
LINE	1,900	5,070.00	9,633,000
カナミックネットワーク	500	500.00	250,000
ノムラシステムコーポレーション	400	339.00	135,600
チェンジ	200	3,080.00	616,000
シンクロ・フード	700	226.00	158,200
オークネット	500	1,080.00	540,000
セグエグループ	300	595.00	178,500
エイトレッド	200	1,264.00	252,800
AOI TYO Holdings	800	450.00	360,000
マクロミル	1,700	673.00	1,144,100
ビーグリー	300	1,146.00	343,800
オロ	200	2,894.00	578,800
ユーザーローカル	100	2,378.00	237,800
テモナ	200	557.00	111,400
ニーズウェル	200	525.00	105,000
サインポスト	100	1,459.00	145,900
ソルクシーズ	700	576.00	403,200
フェイス	600	586.00	351,600
プロトコーポレーション	700	906.00	634,200
ハイマックス	100	1,901.00	190,100
野村総合研究所	11,400	2,323.00	26,482,200
サイバネットシステム	600	566.00	339,600
CEホールディングス	500	415.00	207,500
日本システム技術	300	965.00	289,500
インテージホールディングス	1,000	774.00	774,000
東邦システムサイエンス	200	865.00	173,000
ソースネクスト	3,900	293.00	1,142,700
インフォコム	900	2,269.00	2,042,100
HEROZ	100	3,180.00	318,000
ラクスル	400	2,298.00	919,200
FIG	900	230.00	207,000
システムサポート	100	2,124.00	212,400

イーソル	300	1,020.00	306,000	
アルテリア・ネットワークス	900	1,794.00	1,614,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	755.00	302,000	
フォーカスシステムズ	500	728.00	364,000	
クレスコ	500	1,384.00	692,000	
フジ・メディア・ホールディングス	7,700	1,099.00	8,462,300	
オービック	2,800	12,810.00	35,868,000	
ジャストシステム	1,300	4,965.00	6,454,500	
TDCソフト	700	749.00	524,300	
Zホールディングス	110,100	344.00	37,874,400	
トレンドマイクロ	3,600	5,280.00	19,008,000	
IDホールディングス	300	1,365.00	409,500	
日本オラクル	1,600	9,100.00	14,560,000	
アルファシステムズ	300	2,790.00	837,000	
フューチャー	1,000	1,368.00	1,368,000	
CAC Holdings	500	939.00	469,500	
S Bテクノロジー	300	2,000.00	600,000	
トーセ	500	728.00	364,000	
オービックビジネスコンサルタント	800	4,415.00	3,532,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	3,700	2,933.00	10,852,100	
アイティフォー	1,000	575.00	575,000	
東計電算	100	3,790.00	379,000	
エクスネット	300	941.00	282,300	
大塚商会	4,300	4,295.00	18,468,500	
サイボウズ	1,000	1,571.00	1,571,000	
ソフトブレーン	1,000	393.00	393,000	
電通国際情報サービス	500	3,735.00	1,867,500	
デジタルガレージ	1,500	3,300.00	4,950,000	
EMシステムズ	1,200	903.00	1,083,600	
ウェザーニューズ	300	3,390.00	1,017,000	
C I J	600	778.00	466,800	
ビジネスエンジニアリング	100	2,500.00	250,000	
日本エンタープライズ	1,700	202.00	343,400	
WOWOW	400	2,390.00	956,000	
スカラ	600	452.00	271,200	

インテリジェント ウェイブ	400	501.00	200,400	
I M A G I C A G R O U P	700	356.00	249,200	
ネットワンシステムズ	3,100	2,215.00	6,866,500	
システムソフト	3,900	69.00	269,100	
アルゴグラフィックス	700	3,435.00	2,404,500	
マーベラス	1,300	565.00	734,500	
エイベックス	1,400	951.00	1,331,400	
日本ユニシス	2,500	2,776.00	6,940,000	
兼松エレクトロニクス	400	3,350.00	1,340,000	
東京放送ホールディングス	4,900	1,515.00	7,423,500	
日本テレビホールディングス	6,700	1,300.00	8,710,000	
朝日放送グループホールディングス	800	688.00	550,400	
テレビ朝日ホールディングス	2,300	1,574.00	3,620,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	5,500	389.00	2,139,500	
テレビ東京ホールディングス	700	2,207.00	1,544,900	
日本BS放送	300	987.00	296,100	
ビジョン	800	760.00	608,000	
スマートパリュー	200	841.00	168,200	
U S E N - N E X T H O L D I N G S	300	1,367.00	410,100	
ワイヤレスゲート	800	400.00	320,000	
コネクシオ	500	1,320.00	660,000	
日本通信	6,500	168.00	1,092,000	
クロップス	300	540.00	162,000	
日本電信電話	107,200	2,503.00	268,321,600	
K D D I	59,800	3,242.00	193,871,600	
ソフトバンク	72,900	1,419.00	103,445,100	
光通信	800	18,700.00	14,960,000	
N T T ドコモ	59,200	3,182.00	188,374,400	
エムティーアイ	800	513.00	410,400	
G M O インターネット	3,200	1,729.00	5,532,800	
ファイバーゲート	200	1,033.00	206,600	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	387.00	193,500	
K A D O K A W A	2,200	1,270.00	2,794,000	
学研ホールディングス	300	7,250.00	2,175,000	
ゼンリン	1,700	1,021.00	1,735,700	
昭文社	800	387.00	309,600	

インプレスホールディングス	1,500	135.00	202,500	
アイネット	400	1,328.00	531,200	
松竹	500	12,160.00	6,080,000	
東宝	4,700	3,435.00	16,144,500	
東映	300	13,540.00	4,062,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	21,400	1,093.00	23,390,200	
ピー・シー・エー	100	2,965.00	296,500	
ビジネスブレイン太田昭和	100	2,436.00	243,600	
D T S	1,900	1,901.00	3,611,900	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,400	4,570.00	15,538,000	
シーイーシー	900	1,312.00	1,180,800	
カプコン	3,800	3,120.00	11,856,000	
アイ・エス・ビー	200	1,497.00	299,400	
ジャステック	500	992.00	496,000	
S C S K	1,900	4,595.00	8,730,500	
日本システムウエア	300	1,764.00	529,200	
アイネス	800	1,319.00	1,055,200	
T K C	700	4,535.00	3,174,500	
富士ソフト	1,000	3,470.00	3,470,000	
N S D	2,700	1,464.00	3,952,800	
コナミホールディングス	2,900	3,385.00	9,816,500	
福井コンピュータホールディングス	300	2,442.00	732,600	
J B C Cホールディングス	600	1,598.00	958,800	
ミロク情報サービス	700	2,420.00	1,694,000	
ソフトバンクグループ	63,600	4,170.00	265,212,000	
ハウスイ	100	708.00	70,800	
高千穂交易	300	1,002.00	300,600	
伊藤忠食品	200	4,290.00	858,000	
エレマテック	800	744.00	595,200	
J A L U X	200	1,663.00	332,600	
あらた	600	4,470.00	2,682,000	
トーメンデバイス	100	3,425.00	342,500	
東京エレクトロン デバイス	300	2,284.00	685,200	
フィールズ	600	315.00	189,000	
双日	44,500	278.00	12,371,000	
アルフレッサ ホールディングス	8,900	1,946.00	17,319,400	

横浜冷凍	2,300	891.00	2,049,300	
神栄	200	446.00	89,200	
ラサ商事	400	877.00	350,800	
ラクーンホールディングス	800	493.00	394,400	
アルコニックス	900	1,027.00	924,300	
神戸物産	2,800	3,915.00	10,962,000	
あい ホールディングス	1,200	1,295.00	1,554,000	
ディーブイエックス	300	918.00	275,400	
ダイワボウホールディングス	700	5,370.00	3,759,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	2,000	1,405.00	2,810,000	
ラクト・ジャパン	300	3,010.00	903,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,600	1,093.00	1,748,800	
八洲電機	600	818.00	490,800	
メディアスホールディングス	500	759.00	379,500	
レスターホールディングス	900	1,577.00	1,419,300	
ジューテックホールディングス	200	1,081.00	216,200	
大光	700	580.00	406,000	
OCHIホールディングス	200	1,475.00	295,000	
TOKAIホールディングス	4,400	917.00	4,034,800	
黒谷	400	331.00	132,400	
Cominix	300	727.00	218,100	
三洋貿易	800	865.00	692,000	
ビューティガレージ	300	1,357.00	407,100	
ウイン・パートナーズ	600	952.00	571,200	
ミタチ産業	500	493.00	246,500	
シップヘルスケアホールディングス	1,300	4,195.00	5,453,500	
明治電機工業	300	1,361.00	408,300	
デリカフーズホールディングス	600	652.00	391,200	
スターティアホールディングス	400	495.00	198,000	
コメダホールディングス	1,800	1,697.00	3,054,600	
ピーバンドットコム	100	842.00	84,200	
アセンテック	100	2,748.00	274,800	
富士興産	500	394.00	197,000	
協栄産業	200	1,078.00	215,600	
小野建	700	1,128.00	789,600	
南陽	200	1,344.00	268,800	

佐島電機	600	838.00	502,800
エコートレーディング	400	467.00	186,800
伯東	500	1,049.00	524,500
コンドーテック	600	921.00	552,600
中山福	500	515.00	257,500
ナガイレーベン	1,200	2,353.00	2,823,600
三菱食品	900	2,690.00	2,421,000
松田産業	600	1,249.00	749,400
第一興商	1,200	3,325.00	3,990,000
メディパルホールディングス	8,700	1,927.00	16,764,900
S P K	200	2,592.00	518,400
萩原電気ホールディングス	300	2,195.00	658,500
アズワン	500	9,220.00	4,610,000
スズデン	300	1,234.00	370,200
尾家産業	500	1,263.00	631,500
シモジマ	500	1,249.00	624,500
ドウシシャ	800	1,222.00	977,600
小津産業	200	1,595.00	319,000
高速	500	1,294.00	647,000
たけびし	300	1,330.00	399,000
リックス	200	1,600.00	320,000
丸文	700	503.00	352,100
ハピネット	700	1,150.00	805,000
橋本総業ホールディングス	200	1,919.00	383,800
日本ライフライン	2,500	1,292.00	3,230,000
タカショー	800	415.00	332,000
マルカ	300	1,881.00	564,300
I D O M	2,300	425.00	977,500
進和	500	1,732.00	866,000
エスケイジャパン	300	301.00	90,300
ダイトロン	400	1,424.00	569,600
シークス	1,100	833.00	916,300
田中商事	500	677.00	338,500
オーハシテクニカ	500	1,341.00	670,500
白銅	300	1,206.00	361,800
伊藤忠商事	56,300	2,300.50	129,518,150

丸紅	83,800	623.60	52,257,680
高島	100	1,555.00	155,500
長瀬産業	4,500	1,284.00	5,778,000
蝶理	500	1,594.00	797,000
豊田通商	9,000	2,728.00	24,552,000
三共生興	1,300	491.00	638,300
兼松	3,100	1,107.00	3,431,700
ツカモトコーポレーション	300	1,138.00	341,400
三井物産	70,700	1,651.00	116,725,700
日本紙パルプ商事	500	3,420.00	1,710,000
日立ハイテク	2,900	7,940.00	23,026,000
カメイ	1,100	930.00	1,023,000
東都水産	100	2,648.00	264,800
OUGホールディングス	300	2,570.00	771,000
スターゼン	300	4,485.00	1,345,500
山善	3,300	899.00	2,966,700
樺本興業	200	3,535.00	707,000
住友商事	50,800	1,347.00	68,427,600
内田洋行	400	3,435.00	1,374,000
三菱商事	56,500	2,464.00	139,216,000
第一実業	400	3,400.00	1,360,000
キヤノンマーケティングジャパン	2,400	2,080.00	4,992,000
西華産業	500	1,031.00	515,500
佐藤商事	700	882.00	617,400
菱洋エレクトロ	800	2,038.00	1,630,400
東京産業	800	495.00	396,000
ユアサ商事	800	2,855.00	2,284,000
神鋼商事	200	1,958.00	391,600
小林産業	1,000	259.00	259,000
阪和興業	1,600	1,804.00	2,886,400
正栄食品工業	500	3,355.00	1,677,500
カナデン	700	1,200.00	840,000
菱電商事	600	1,296.00	777,600
フルサト工業	500	1,472.00	736,000
岩谷産業	1,800	3,650.00	6,570,000
すてきナイスグループ	400	939.00	375,600



昭光通商	600	586.00	351,600	
ニチモウ	100	1,652.00	165,200	
極東貿易	200	1,415.00	283,000	
イワキ	1,100	419.00	460,900	
三愛石油	2,100	981.00	2,060,100	
稲畑産業	1,800	1,165.00	2,097,000	
G S Iクレオス	400	1,034.00	413,600	
明和産業	800	583.00	466,400	
クワザワ	600	565.00	339,000	
ワキタ	1,800	940.00	1,692,000	
東邦ホールディングス	2,600	2,215.00	5,759,000	
サンゲツ	2,300	1,558.00	3,583,400	
ミツウロコグループホールディングス	1,200	1,046.00	1,255,200	
シナネンホールディングス	300	2,600.00	780,000	
伊藤忠エネクス	1,800	844.00	1,519,200	
サンリオ	2,300	1,597.00	3,673,100	
サンワテクノス	600	870.00	522,000	
リョーサン	900	2,402.00	2,161,800	
新光商事	1,300	812.00	1,055,600	
トーホー	400	1,535.00	614,000	
三信電気	400	1,359.00	543,600	
東陽テクニカ	1,000	920.00	920,000	
モスフードサービス	1,100	2,636.00	2,899,600	
加賀電子	800	1,715.00	1,372,000	
ソーダニッカ	900	631.00	567,900	
立花エレテック	600	1,458.00	874,800	
フォーバル	400	1,167.00	466,800	
P A L T A C	1,300	5,110.00	6,643,000	
三谷産業	1,100	320.00	352,000	
太平洋興発	300	698.00	209,400	
西本W i s m e t t a cホールディングス	200	2,139.00	427,800	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,479.00	295,800	
国際紙パルプ商事	2,000	230.00	460,000	
ヤマタネ	400	1,069.00	427,600	
丸紅建材リース	200	1,611.00	322,200	
日鉄物産	600	3,700.00	2,220,000	

泉州電業	300	2,434.00	730,200
トラスコ中山	1,700	2,343.00	3,983,100
オートバックスセブン	3,100	1,279.00	3,964,900
モリト	600	607.00	364,200
加藤産業	1,300	3,360.00	4,368,000
北恵	300	658.00	197,400
イノテック	500	862.00	431,000
イエローハット	1,600	1,559.00	2,494,400
J Kホールディングス	800	701.00	560,800
日伝	800	1,950.00	1,560,000
北沢産業	1,300	288.00	374,400
杉本商事	500	1,819.00	909,500
因幡電機産業	2,300	2,358.00	5,423,400
東テク	300	1,928.00	578,400
ミスミグループ本社	10,100	2,194.00	22,159,400
アルテック	1,300	179.00	232,700
タキヒヨー	300	1,421.00	426,300
蔵王産業	200	1,445.00	289,000
スズケン	3,400	3,800.00	12,920,000
ジェコス	600	796.00	477,600
グローセル	800	417.00	333,600
ローソン	2,000	5,780.00	11,560,000
サンエー	700	4,420.00	3,094,000
カワチ薬品	600	2,286.00	1,371,600
エービーシー・マート	1,300	5,470.00	7,111,000
ハードオフコーポレーション	300	731.00	219,300
アスクル	900	3,155.00	2,839,500
ゲオホールディングス	1,500	1,312.00	1,968,000
アダストリア	1,200	1,475.00	1,770,000
ジーフット	500	420.00	210,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	412.00	82,400
くら寿司	400	4,320.00	1,728,000
キャンドウ	400	1,660.00	664,000
パルグループホールディングス	900	1,284.00	1,155,600
エディオン	3,800	928.00	3,526,400
サーラコーポレーション	1,700	526.00	894,200

ワッツ	400	535.00	214,000	
ハローズ	300	2,471.00	741,300	
フジオフードシステム	700	1,382.00	967,400	
あみやき亭	200	3,170.00	634,000	
ひらまつ	1,500	177.00	265,500	
大黒天物産	200	2,859.00	571,800	
ハニーズホールディングス	700	1,184.00	828,800	
ファーマライズホールディングス	400	622.00	248,800	
アルペン	600	1,624.00	974,400	
ハブ	500	719.00	359,500	
クオールホールディングス	1,200	1,263.00	1,515,600	
ジーンズホールディングス	400	6,220.00	2,488,000	
ビックカメラ	5,000	945.00	4,725,000	
D C Mホールディングス	4,500	972.00	4,374,000	
ペッパーフードサービス	700	576.00	403,200	
MonotaRO	5,700	2,999.00	17,094,300	
東京一番フーズ	400	530.00	212,000	
D Dホールディングス	300	907.00	272,100	
きちりホールディングス	500	595.00	297,500	
アークランドサービスホールディングス	600	1,529.00	917,400	
J . フロント リテイリング	9,600	962.00	9,235,200	
ドトール・日レスホールディングス	1,300	1,720.00	2,236,000	
マツモトキヨシホールディングス	3,300	3,825.00	12,622,500	
ブロンコピリー	400	2,240.00	896,000	
Z O Z O	5,500	1,512.00	8,316,000	
トレジャー・ファクトリー	500	645.00	322,500	
物語コーポレーション	200	6,880.00	1,376,000	
ココカラファイン	800	5,180.00	4,144,000	
三越伊勢丹ホールディングス	14,100	699.00	9,855,900	
H a m e e	300	929.00	278,700	
ウエルシアホールディングス	2,400	6,750.00	16,200,000	
クリエイトSDホールディングス	1,400	2,599.00	3,638,600	
丸善C H Iホールディングス	1,000	368.00	368,000	
ミサワ	300	416.00	124,800	
ティーライフ	200	948.00	189,600	
エー・ピーカンパニー	300	483.00	144,900	

チムニー	300	1,878.00	563,400	
シュッピン	600	675.00	405,000	
ネクステージ	1,200	718.00	861,600	
ジョイフル本田	2,400	1,147.00	2,752,800	
鳥貴族	300	1,860.00	558,000	
キリン堂ホールディングス	300	1,664.00	499,200	
ホットランド	600	998.00	598,800	
すかいらーくホールディングス	9,000	1,794.00	16,146,000	
SFPホールディングス	400	1,547.00	618,800	
綿半ホールディングス	300	1,447.00	434,100	
ヨシックス	100	2,164.00	216,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	2,400	939.00	2,253,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	400	482.00	192,800	
B E E N O S	300	849.00	254,700	
あさひ	600	1,156.00	693,600	
日本調剤	300	3,320.00	996,000	
コスモス薬品	400	22,900.00	9,160,000	
トーエル	400	743.00	297,200	
オンリー	300	625.00	187,500	
セブン&アイ・ホールディングス	31,500	3,600.00	113,400,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4,500	776.00	3,492,000	
ツルハホールディングス	1,700	13,000.00	22,100,000	
サンマルクホールディングス	700	1,911.00	1,337,700	
フェリシモ	400	966.00	386,400	
トリドールホールディングス	1,000	2,531.00	2,531,000	
T O K Y O B A S E	700	282.00	197,400	
ウイルプラスホールディングス	300	519.00	155,700	
J Mホールディングス	400	1,980.00	792,000	
サツドラホールディングス	100	1,852.00	185,200	
アレンザホールディングス	400	695.00	278,000	
串カツ田中ホールディングス	100	1,397.00	139,700	
パロックジャパンリミテッド	600	667.00	400,200	
クスリのアオキホールディングス	700	8,070.00	5,649,000	
力の源ホールディングス	400	709.00	283,600	
スシローグローバルホールディングス	900	7,260.00	6,534,000	

LIXILビバ	800	1,701.00	1,360,800	
メディカルシステムネットワーク	800	420.00	336,000	
はるやまホールディングス	400	832.00	332,800	
ノジマ	1,500	1,864.00	2,796,000	
カッパ・クリエイト	1,200	1,438.00	1,725,600	
ライトオン	600	532.00	319,200	
ジーンズメイト	400	236.00	94,400	
良品計画	10,700	1,228.00	13,139,600	
三城ホールディングス	900	250.00	225,000	
アドヴァン	1,300	1,029.00	1,337,700	
アルビス	300	1,987.00	596,100	
コナカ	1,000	309.00	309,000	
ハウス オブ ローゼ	200	1,678.00	335,600	
G-7ホールディングス	500	1,978.00	989,000	
イオン北海道	1,100	648.00	712,800	
コジマ	1,400	382.00	534,800	
ヒマラヤ	300	720.00	216,000	
コーナン商事	1,200	2,094.00	2,512,800	
エコス	300	1,663.00	498,900	
ワタミ	1,000	1,045.00	1,045,000	
マルシェ	500	602.00	301,000	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	17,700	1,860.00	32,922,000	
西松屋チェーン	1,800	769.00	1,384,200	
ゼンショーホールディングス	3,900	2,225.00	8,677,500	
幸楽苑ホールディングス	500	1,547.00	773,500	
ハークスレイ	200	1,224.00	244,800	
サイゼリヤ	1,400	2,163.00	3,028,200	
V Tホールディングス	3,500	319.00	1,116,500	
魚力	200	1,549.00	309,800	
ポプラ	400	442.00	176,800	
フジ・コーポレーション	200	1,799.00	359,800	
ユナイテッドアローズ	900	1,870.00	1,683,000	
ハイデイ日高	1,200	1,583.00	1,899,600	
京都きもの友禅	1,100	253.00	278,300	
コロワイド	2,700	1,750.00	4,725,000	

ピーシーデボコーポレーション	1,100	383.00	421,300	
壱番屋	600	4,585.00	2,751,000	
トップカルチャー	500	289.00	144,500	
P L A N T	400	405.00	162,000	
スギホールディングス	1,600	5,430.00	8,688,000	
薬王堂ホールディングス	400	2,325.00	930,000	
ヴィア・ホールディングス	1,000	550.00	550,000	
スクロール	1,300	308.00	400,400	
ヨンドシーホールディングス	800	1,911.00	1,528,800	
ファミリーマート	6,400	1,999.00	12,793,600	
木曽路	1,100	2,553.00	2,808,300	
S R S ホールディングス	1,000	1,020.00	1,020,000	
千趣会	1,500	358.00	537,000	
タカキュー	1,400	143.00	200,200	
ケーヨー	1,700	482.00	819,400	
上新電機	1,000	1,932.00	1,932,000	
日本瓦斯	1,300	3,285.00	4,270,500	
ロイヤルホールディングス	1,500	1,899.00	2,848,500	
東天紅	100	835.00	83,500	
いなげや	1,000	1,455.00	1,455,000	
島忠	1,500	2,679.00	4,018,500	
チヨダ	900	1,142.00	1,027,800	
ライフコーポレーション	600	2,531.00	1,518,600	
リンガーハット	1,000	2,142.00	2,142,000	
Mr M a x H D	1,100	333.00	366,300	
テンアライド	800	418.00	334,400	
A O K I ホールディングス	1,700	814.00	1,383,800	
オークワ	1,300	1,535.00	1,995,500	
コメリ	1,300	1,894.00	2,462,200	
青山商事	1,700	1,051.00	1,786,700	
しまむら	900	7,260.00	6,534,000	
はせがわ	900	399.00	359,100	
高島屋	5,900	1,013.00	5,976,700	
松屋	1,700	682.00	1,159,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,000	874.00	3,496,000	
近鉄百貨店	300	2,600.00	780,000	

丸井グループ	7,400	2,097.00	15,517,800
アクシアル リテイリング	700	3,615.00	2,530,500
井筒屋	900	167.00	150,300
イオン	31,000	2,324.00	72,044,000
イズミ	1,700	2,758.00	4,688,600
平和堂	1,700	1,778.00	3,022,600
フジ	1,000	1,766.00	1,766,000
ヤオコー	900	6,180.00	5,562,000
ゼビオホールディングス	1,000	911.00	911,000
ケーズホールディングス	7,800	1,115.00	8,697,000
Olympicグループ	400	577.00	230,800
日産東京販売ホールディングス	1,200	227.00	272,400
シルバーライフ	100	1,884.00	188,400
Genky DrugStores	400	1,917.00	766,800
ナルミヤ・インターナショナル	300	590.00	177,000
総合メディカルホールディングス	700	2,550.00	1,785,000
ブックオフグループホールディングス	500	910.00	455,000
アインホールディングス	1,000	5,980.00	5,980,000
元気寿司	200	2,477.00	495,400
ヤマダ電機	24,500	473.00	11,588,500
アークランドサカモト	1,300	952.00	1,237,600
ニトリホールディングス	3,500	14,580.00	51,030,000
グルメ杵屋	600	1,090.00	654,000
愛眼	1,300	216.00	280,800
ケーユーホールディングス	400	796.00	318,400
吉野家ホールディングス	2,700	2,221.00	5,996,700
松屋フーズホールディングス	400	4,250.00	1,700,000
サガミホールディングス	1,100	1,300.00	1,430,000
関西スーパーマーケット	700	1,018.00	712,600
王将フードサービス	600	5,950.00	3,570,000
プレナス	900	1,862.00	1,675,800
ミニストップ	600	1,477.00	886,200
アークス	1,700	1,790.00	3,043,000
パローホールディングス	1,800	1,719.00	3,094,200
藤久	100	599.00	59,900
ベルク	400	5,310.00	2,124,000

大庄	400	1,262.00	504,800
ファーストリテイリング	1,100	50,440.00	55,484,000
サンドラッグ	3,000	3,350.00	10,050,000
サクスパー ホールディングス	700	679.00	475,300
ヤマザワ	200	1,580.00	316,000
やまや	200	2,188.00	437,600
ペルーナ	1,800	492.00	885,600
島根銀行	300	457.00	137,100
じもとホールディングス	5,700	97.00	552,900
めぶきフィナンシャルグループ	41,900	214.00	8,966,600
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,100	1,180.00	1,298,000
九州フィナンシャルグループ	13,700	412.00	5,644,400
ゆうちょ銀行	22,800	1,021.00	23,278,800
富山第一銀行	2,000	266.00	532,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	47,400	333.00	15,784,200
西日本フィナンシャルホールディングス	5,700	600.00	3,420,000
関西みらいフィナンシャルグループ	4,900	425.00	2,082,500
三十三フィナンシャルグループ	800	1,401.00	1,120,800
第四北越フィナンシャルグループ	1,400	2,261.00	3,165,400
新生銀行	5,900	1,413.00	8,336,700
あおぞら銀行	4,800	2,377.00	11,409,600
三菱UFJフィナンシャル・グループ	551,400	448.70	247,413,180
りそなホールディングス	88,500	356.90	31,585,650
三井住友トラスト・ホールディングス	15,200	3,336.00	50,707,200
三井住友フィナンシャルグループ	55,700	2,950.50	164,342,850
千葉銀行	27,700	502.00	13,905,400
群馬銀行	16,400	330.00	5,412,000
武蔵野銀行	1,200	1,356.00	1,627,200
千葉興業銀行	2,300	223.00	512,900
筑波銀行	3,500	169.00	591,500
七十七銀行	2,800	1,342.00	3,757,600
青森銀行	600	2,423.00	1,453,800
秋田銀行	500	1,578.00	789,000
山形銀行	900	1,176.00	1,058,400
岩手銀行	500	2,457.00	1,228,500
東邦銀行	7,500	244.00	1,830,000



東北銀行	400	928.00	371,200	
みちのく銀行	500	1,144.00	572,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	6,800	1,582.00	10,757,600	
静岡銀行	20,000	688.00	13,760,000	
十六銀行	1,000	1,877.00	1,877,000	
スルガ銀行	8,600	400.00	3,440,000	
八十二銀行	19,500	372.00	7,254,000	
山梨中央銀行	1,000	736.00	736,000	
大垣共立銀行	1,600	2,045.00	3,272,000	
福井銀行	700	1,440.00	1,008,000	
北國銀行	800	3,070.00	2,456,000	
清水銀行	300	1,803.00	540,900	
富山銀行	200	1,565.00	313,000	
滋賀銀行	1,600	2,482.00	3,971,200	
南都銀行	1,400	2,042.00	2,858,800	
百五銀行	7,500	288.00	2,160,000	
京都銀行	2,900	3,520.00	10,208,000	
紀陽銀行	2,900	1,558.00	4,518,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	5,400	966.00	5,216,400	
広島銀行	11,900	459.00	5,462,100	
山陰合同銀行	5,000	541.00	2,705,000	
中国銀行	6,900	929.00	6,410,100	
鳥取銀行	300	1,235.00	370,500	
伊予銀行	11,500	521.00	5,991,500	
百十四銀行	900	1,850.00	1,665,000	
四国銀行	1,300	807.00	1,049,100	
阿波銀行	1,400	2,170.00	3,038,000	
大分銀行	500	1,994.00	997,000	
宮崎銀行	600	2,246.00	1,347,600	
佐賀銀行	500	1,173.00	586,500	
沖縄銀行	800	3,075.00	2,460,000	
琉球銀行	1,900	983.00	1,867,700	
セブン銀行	26,900	284.00	7,639,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,095,300	134.80	147,646,440	
高知銀行	600	618.00	370,800	
山口フィナンシャルグループ	10,400	589.00	6,125,600	

長野銀行	300	1,170.00	351,000
名古屋銀行	700	2,411.00	1,687,700
北洋銀行	12,600	202.00	2,545,200
愛知銀行	300	2,933.00	879,900
中京銀行	300	2,099.00	629,700
大光銀行	600	1,261.00	756,600
愛媛銀行	1,200	1,109.00	1,330,800
トマト銀行	300	995.00	298,500
京葉銀行	3,600	522.00	1,879,200
栃木銀行	4,000	157.00	628,000
北日本銀行	300	1,929.00	578,700
東和銀行	1,500	646.00	969,000
福島銀行	1,600	157.00	251,200
大東銀行	400	585.00	234,000
トモニホールディングス	6,500	348.00	2,262,000
フィデアホールディングス	8,100	106.00	858,600
池田泉州ホールディングス	9,600	162.00	1,555,200
F P G	2,600	577.00	1,500,200
マーキュリアインベストメント	400	576.00	230,400
S B Iホールディングス	9,000	1,709.00	15,381,000
日本アジア投資	1,400	193.00	270,200
ジャフコ	1,300	3,070.00	3,991,000
大和証券グループ本社	64,700	453.30	29,328,510
野村ホールディングス	141,800	490.00	69,482,000
岡三証券グループ	7,100	350.00	2,485,000
丸三証券	2,500	450.00	1,125,000
東洋証券	3,000	137.00	411,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	9,600	266.00	2,553,600
光世証券	400	525.00	210,000
水戸証券	2,400	186.00	446,400
いちよし証券	1,600	514.00	822,400
松井証券	4,800	839.00	4,027,200
だいこう証券ビジネス	400	550.00	220,000
マネックスグループ	6,300	183.00	1,152,900
極東証券	1,100	652.00	717,200
岩井コスモホールディングス	800	1,077.00	861,600

藍澤證券	1,500	760.00	1,140,000	
マネーパートナーズグループ	1,700	185.00	314,500	
スパークス・グループ	2,900	192.00	556,800	
小林洋行	400	243.00	97,200	
かんぽ生命保険	3,000	1,393.00	4,179,000	
S O M P Oホールディングス	15,200	3,243.00	49,293,600	
アニコム ホールディングス	700	3,500.00	2,450,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	21,100	3,010.00	63,511,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	6,600	1,834.00	12,104,400	
第一生命ホールディングス	45,600	1,362.00	62,107,200	
東京海上ホールディングス	28,800	5,022.00	144,633,600	
T & Dホールディングス	24,100	905.00	21,810,500	
アドバンスクリエイト	200	1,536.00	307,200	
全国保証	2,300	3,590.00	8,257,000	
ジェイリース	500	263.00	131,500	
イントラスト	600	513.00	307,800	
日本モーゲージサービス	200	1,939.00	387,800	
C a s a	300	1,023.00	306,900	
アルヒ	1,300	1,148.00	1,492,400	
プレミアグループ	500	1,522.00	761,000	
クレディセゾン	5,600	1,298.00	7,268,800	
芙蓉総合リース	800	5,590.00	4,472,000	
みずほリース	1,300	2,253.00	2,928,900	
東京センチュリー	1,600	3,665.00	5,864,000	
日本証券金融	3,700	494.00	1,827,800	
アイフル	12,800	232.00	2,969,600	
リコーリース	700	2,994.00	2,095,800	
イオンフィナンシャルサービス	5,100	1,170.00	5,967,000	
アコム	16,200	432.00	6,998,400	
ジャックス	900	1,831.00	1,647,900	
オリエントコーポレーション	22,600	124.00	2,802,400	
日立キャピタル	1,900	2,059.00	3,912,100	
アプラスフィナンシャル	4,000	62.00	248,000	
オリックス	50,400	1,397.50	70,434,000	
三菱U F Jリース	20,500	552.00	11,316,000	

九州リースサービス	800	484.00	387,200
日本取引所グループ	23,100	1,803.00	41,649,300
イー・ギャランティ	900	1,352.00	1,216,800
アサックス	400	635.00	254,000
NECキャピタルソリューション	300	1,923.00	576,900
いちご	10,700	259.00	2,771,300
日本駐車場開発	9,200	133.00	1,223,600
スター・マイカ・ホールディングス	400	1,258.00	503,200
ヒューリック	17,200	1,062.00	18,266,400
三栄建築設計	300	1,210.00	363,000
野村不動産ホールディングス	4,900	1,944.00	9,525,600
三重交通グループホールディングス	1,700	525.00	892,500
サムティ	1,200	1,203.00	1,443,600
ディア・ライフ	1,100	419.00	460,900
コーセーアールイー	500	427.00	213,500
エー・ディー・ワークス	15,500	21.00	325,500
日本商業開発	500	1,508.00	754,000
プレサンスコーポレーション	1,400	1,039.00	1,454,600
ユニゾホールディングス	1,300	5,960.00	7,748,000
THEグローバル社	900	312.00	280,800
ハウスコム	200	1,209.00	241,800
日本管理センター	600	1,114.00	668,400
サンセイランディック	500	677.00	338,500
エストラスト	200	530.00	106,000
フージャースホールディングス	1,700	646.00	1,098,200
オープンハウス	2,400	2,254.00	5,409,600
東急不動産ホールディングス	21,900	606.00	13,271,400
飯田グループホールディングス	6,700	1,496.00	10,023,200
イーランド	300	647.00	194,100
ムゲンエステート	600	440.00	264,000
ビーロッド	200	1,254.00	250,800
ファーストブラザーズ	400	694.00	277,600
ハウスドゥ	400	703.00	281,200
シーアールイー	200	1,040.00	208,000
プロパティエージェント	300	854.00	256,200
ケイアイスター不動産	300	1,260.00	378,000

アグレ都市デザイン	300	484.00	145,200
グッドコムアセット	200	1,215.00	243,000
ジェイ・エス・ビー	100	4,110.00	411,000
テンポイノベーション	400	718.00	287,200
グローバル・リンク・マネジメント	300	555.00	166,500
パーク24	4,300	1,813.00	7,795,900
バラカ	200	1,680.00	336,000
三井不動産	39,800	1,935.00	77,013,000
三菱地所	56,500	1,695.00	95,767,500
平和不動産	1,500	2,640.00	3,960,000
東京建物	8,500	1,237.00	10,514,500
ダイビル	2,200	923.00	2,030,600
京阪神ビルディング	1,400	1,181.00	1,653,400
住友不動産	18,100	3,034.00	54,915,400
テーオーシー	1,600	580.00	928,000
東京楽天地	100	4,060.00	406,000
レオパレス21	11,000	285.00	3,135,000
スターツコーポレーション	1,100	1,961.00	2,157,100
フジ住宅	1,000	551.00	551,000
空港施設	800	401.00	320,800
明和地所	500	563.00	281,500
ゴールドクレスト	700	1,658.00	1,160,600
エスリード	300	1,577.00	473,100
日神グループホールディングス	1,200	430.00	516,000
日本エスコン	1,500	626.00	939,000
タカラレーベン	3,800	375.00	1,425,000
A V A N T I A	500	617.00	308,500
イオンモール	4,000	1,463.00	5,852,000
毎日コムネット	400	729.00	291,600
ファースト住建	400	899.00	359,600
ランド	45,600	8.00	364,800
カチタス	1,000	3,310.00	3,310,000
トーセイ	1,200	956.00	1,147,200
穴吹興産	200	1,337.00	267,400
サンフロンティア不動産	1,200	910.00	1,092,000
エフ・ジェー・ネクスト	700	884.00	618,800

インテリックス	500	504.00	252,000	
ランドビジネス	700	391.00	273,700	
日本社宅サービス	400	899.00	359,600	
グランディハウス	600	410.00	246,000	
日本空港ビルデング	2,600	4,325.00	11,245,000	
日本工営	500	2,908.00	1,454,000	
L I F U L L	2,800	317.00	887,600	
ジェイエイシーリクルートメント	500	1,077.00	538,500	
日本M&Aセンター	5,900	2,967.00	17,505,300	
メンバーズ	200	1,366.00	273,200	
中広	100	407.00	40,700	
UTグループ	1,000	1,391.00	1,391,000	
アイティメディア	500	750.00	375,000	
タケエイ	800	803.00	642,400	
E・Jホールディングス	100	1,299.00	129,900	
ビーネックスグループ	1,000	525.00	525,000	
コシダカホールディングス	2,000	414.00	828,000	
アルトナー	400	636.00	254,400	
パソナグループ	900	938.00	844,200	
C D S	200	1,142.00	228,400	
リンクアンドモチベーション	1,800	329.00	592,200	
G C A	1,000	586.00	586,000	
エス・エム・エス	2,500	2,147.00	5,367,500	
サニーサイドアップグループ	400	630.00	252,000	
パーソルホールディングス	7,800	1,096.00	8,548,800	
リニカル	400	810.00	324,000	
クックパッド	2,800	269.00	753,200	
エスクリ	500	434.00	217,000	
アイ・ケイ・ケイ	400	601.00	240,400	
学情	300	1,402.00	420,600	
スタジオアリス	400	1,601.00	640,400	
シミックホールディングス	400	1,421.00	568,400	
エプコ	300	785.00	235,500	
N J S	200	1,688.00	337,600	
総合警備保障	3,100	5,140.00	15,934,000	
カカクコム	5,800	2,203.00	12,777,400	

アイロムグループ	300	1,285.00	385,500	
セントケア・ホールディング	500	398.00	199,000	
サイネックス	300	619.00	185,700	
ルネサンス	500	1,175.00	587,500	
ディップ	1,100	1,966.00	2,162,600	
オプトホールディング	400	1,336.00	534,400	
新日本科学	900	531.00	477,900	
ツクイ	1,900	394.00	748,600	
キャリアデザインセンター	400	778.00	311,200	
ベネフィット・ワン	2,200	1,465.00	3,223,000	
エムスリー	17,200	3,000.00	51,600,000	
ツカダ・グローバルホールディング	500	349.00	174,500	
プラス	200	428.00	85,600	
アウトソーシング	4,600	517.00	2,378,200	
ウェルネット	800	459.00	367,200	
ワールドホールディングス	300	1,261.00	378,300	
ディー・エヌ・エー	3,800	1,256.00	4,772,800	
博報堂D Yホールディングス	10,900	1,163.00	12,676,700	
ぐるなび	1,400	592.00	828,800	
タカミヤ	900	446.00	401,400	
ジャパンベストレスキューシステム	500	664.00	332,000	
ファンコミュニケーションズ	2,200	389.00	855,800	
ライク	300	1,405.00	421,500	
ビジネス・ブレークスルー	700	352.00	246,400	
エスプール	1,600	541.00	865,600	
WDBホールディングス	400	2,100.00	840,000	
ティア	500	520.00	260,000	
C D G	200	1,395.00	279,000	
バリューコマース	500	1,679.00	839,500	
インフォマート	8,600	678.00	5,830,800	
J Pホールディングス	2,500	263.00	657,500	
エコナックホールディングス	3,100	90.00	279,000	
E P Sホールディングス	1,200	1,068.00	1,281,600	
レグス	400	842.00	336,800	
プレステージ・インターナショナル	3,000	783.00	2,349,000	
アミューズ	400	2,249.00	899,600	

ドリームインキュベータ	200	896.00	179,200	
クイック	500	1,059.00	529,500	
T A C	900	169.00	152,100	
ケネディクス	7,600	428.00	3,252,800	
電通グループ	8,000	2,460.00	19,680,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	300	615.00	184,500	
ぴあ	200	2,900.00	580,000	
イオンファンタジー	300	1,706.00	511,800	
シーティーエス	900	525.00	472,500	
ネクシィーズグループ	300	1,057.00	317,100	
みらかホールディングス	2,200	2,254.00	4,958,800	
アルプス技研	700	1,567.00	1,096,900	
サニックス	1,400	287.00	401,800	
ダイオーズ	300	1,093.00	327,900	
日本空調サービス	800	666.00	532,800	
オリエンタルランド	8,300	14,835.00	123,130,500	
ダスキン	2,000	2,826.00	5,652,000	
明光ネットワークジャパン	1,000	729.00	729,000	
ファルコホールディングス	400	1,765.00	706,000	
秀英予備校	300	399.00	119,700	
田谷	300	585.00	175,500	
ラウンドワン	2,300	671.00	1,543,300	
リゾートトラスト	3,700	1,173.00	4,340,100	
ピー・エム・エル	1,000	2,658.00	2,658,000	
ワタベウェディング	200	378.00	75,600	
りらいあコミュニケーションズ	1,500	1,000.00	1,500,000	
リソー教育	3,700	295.00	1,091,500	
早稲田アカデミー	300	868.00	260,400	
ユー・エス・エス	8,700	1,549.00	13,476,300	
東京個別指導学院	600	470.00	282,000	
サイバーエージェント	4,500	3,830.00	17,235,000	
楽天	36,400	830.00	30,212,000	
クリーク・アンド・リバー社	400	733.00	293,200	
テー・オー・ダブリュー	600	593.00	355,800	
山田コンサルティンググループ	400	925.00	370,000	
セントラルスポーツ	300	2,417.00	725,100	



フルキャストホールディングス	800	1,330.00	1,064,000	
エン・ジャパン	1,400	2,235.00	3,129,000	
リソルホールディングス	100	3,800.00	380,000	
テクノプロ・ホールディングス	1,600	5,410.00	8,656,000	
アトラ	300	215.00	64,500	
インターワークス	300	464.00	139,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	300	5,660.00	1,698,000	
K e e P e r 技研	300	1,364.00	409,200	
ファーストロジック	400	590.00	236,000	
三機サービス	100	918.00	91,800	
G u n o s y	500	942.00	471,000	
デザインワン・ジャパン	200	184.00	36,800	
イー・ガーディアン	400	1,471.00	588,400	
リブセンス	1,000	239.00	239,000	
ジャパンマテリアル	2,500	1,337.00	3,342,500	
ベクトル	1,000	720.00	720,000	
ウチヤマホールディングス	800	349.00	279,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	700	789.00	552,300	
ライクキッズ	400	504.00	201,600	
キャリアリンク	500	384.00	192,000	
I B J	600	569.00	341,400	
アサンテ	300	1,550.00	465,000	
N・フィールド	600	379.00	227,400	
バリューHR	200	2,661.00	532,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	600	2,628.00	1,576,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	300	1,238.00	371,400	
E R Iホールディングス	500	596.00	298,000	
アピスト	100	2,040.00	204,000	
シグマクシス	600	1,283.00	769,800	
ウィルグループ	500	634.00	317,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	154.00	338,800	
リクルートホールディングス	55,900	3,107.00	173,681,300	
エラン	500	1,312.00	656,000	
土木管理総合試験所	700	341.00	238,700	
ネットマーケティング	200	619.00	123,800	
日本郵政	64,000	873.00	55,872,000	

ベルシステム24ホールディングス	1,400	1,121.00	1,569,400	
鎌倉新書	600	1,195.00	717,000	
S MN	300	646.00	193,800	
一蔵	200	518.00	103,600	
L I T A L I C O	300	2,090.00	627,000	
グローバルキッズCOMPANY	200	530.00	106,000	
エアトリ	400	854.00	341,600	
アトラエ	200	2,422.00	484,400	
ストライク	300	3,250.00	975,000	
ソラスト	2,200	987.00	2,171,400	
セラク	500	702.00	351,000	
インソース	400	2,185.00	874,000	
ペイカレント・コンサルティング	500	5,580.00	2,790,000	
Orchestra Holdings	400	781.00	312,400	
アイモバイル	500	561.00	280,500	
キャリアインデックス	600	292.00	175,200	
MS - J a p a n	300	756.00	226,800	
船場	300	884.00	265,200	
グレイステクノロジー	400	2,548.00	1,019,200	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	900	2,360.00	2,124,000	
フルテック	200	1,233.00	246,600	
グリーンズ	600	458.00	274,800	
ツナググループ・ホールディングス	200	362.00	72,400	
GameWith	400	467.00	186,800	
ソウルドアウト	100	2,075.00	207,500	
MS&Consulting	200	531.00	106,200	
ミダック	200	997.00	199,400	
日総工産	500	524.00	262,000	
キュービーネットホールディングス	300	1,776.00	532,800	
RPAホールディングス	500	898.00	449,000	
スプリックス	300	691.00	207,300	
マネジメントソリューションズ	100	2,752.00	275,200	
カーブスホールディングス	4,100	578.00	2,369,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	400	641.00	256,400	
リログループ	4,300	2,233.00	9,601,900	

東祥	500	1,028.00	514,000
エイチ・アイ・エス	1,300	1,555.00	2,021,500
ラックランド	200	1,537.00	307,400
共立メンテナンス	1,300	2,563.00	3,331,900
イチネンホールディングス	900	1,196.00	1,076,400
建設技術研究所	600	1,620.00	972,000
スペース	500	1,006.00	503,000
長大	300	830.00	249,000
燦ホールディングス	400	1,211.00	484,400
東京テアトル	300	1,220.00	366,000
タナベ経営	300	1,272.00	381,600
ナガワ	200	6,870.00	1,374,000
よみうりランド	200	3,710.00	742,000
東京都競馬	500	2,830.00	1,415,000
常磐興産	300	1,461.00	438,300
カナモト	1,300	2,033.00	2,642,900
東京ドーム	3,300	757.00	2,498,100
西尾レントオール	800	2,209.00	1,767,200
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	10,900	22.00	239,800
トランス・コスモス	800	1,865.00	1,492,000
乃村工藝社	3,500	844.00	2,954,000
藤田観光	400	1,806.00	722,400
KNT-CTホールディングス	500	804.00	402,000
日本管財	900	1,758.00	1,582,200
トーカイ	800	2,630.00	2,104,000
白洋舎	200	2,468.00	493,600
セコム	8,300	8,840.00	73,372,000
セントラル警備保障	400	4,095.00	1,638,000
丹青社	1,500	704.00	1,056,000
メイテック	1,000	4,440.00	4,440,000
応用地質	900	1,189.00	1,070,100
船井総研ホールディングス	1,700	2,239.00	3,806,300
進学会ホールディングス	600	474.00	284,400
オオバ	600	522.00	313,200
いであ	100	1,541.00	154,100
学究社	200	1,214.00	242,800

ベネッセホールディングス	2,600	2,679.00	6,965,400	
イオンディライト	1,000	3,160.00	3,160,000	
ナック	400	787.00	314,800	
ニチイ学館	1,200	1,074.00	1,288,800	
ダイセキ	1,400	2,213.00	3,098,200	
ステップ	300	1,400.00	420,000	
合 計	9,840,400		16,503,748,090	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2020年 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	4,883,443,783
金銭信託	349,857,797
株式	23,975,988,732
投資証券	628,222,809
派生商品評価勘定	287,591,240
未収入金	2,605,497,260
未収配当金	67,884,721
差入委託証拠金	1,191,358,628
流動資産合計	33,989,844,970
資産合計	33,989,844,970
負債の部	

2020年 3月25日現在

流動負債	
派生商品評価勘定	4,395,210
未払解約金	3,653,301,674
その他未払費用	34,341
流動負債合計	3,657,731,225
負債合計	3,657,731,225
純資産の部	
元本等	
元本	28,882,414,604
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,449,699,141
元本等合計	30,332,113,745
純資産合計	30,332,113,745
負債純資産合計	33,989,844,970

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <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	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	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	16,899,742,836円
期中追加設定元本額	48,887,419,759円
期中一部解約元本額	36,904,747,991円
期末元本額	28,882,414,604円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,294,587,256円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	5,735,554,226円
りそなラップ型ファンド（成長型）	3,853,429,836円
DCりそな グローバルバランス	24,086,731円
つみたてバランスファンド	1,006,587,148円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	620,781,884円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	275,918,529円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	157,940,490円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	11,158,607円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	8,068,900円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,517,399円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,938,173円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	162,309,962円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	56,493,460円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	12,915,190,531円
Smart-i 先進国株式インデックス	2,138,509,496円
Smart-i 8資産バランス 安定型	74,402,216円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	188,204,408円
Smart-i 8資産バランス 成長型	199,928,650円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	4,995,809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）	148,810,893円
2. 計算日における受益権の総数	28,882,414,604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	1.0502円
(10,000口当たり純資産額)	(10,502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 3月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25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 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		8,541,404,960
投資証券		305,872,392
合計		8,847,277,352

(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 3月25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	6,332,895,839	-	6,620,161,127	287,265,288
	合計	6,332,895,839	-	6,620,161,127	287,265,288

(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 3月25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	838,360,783	-	838,304,200	56,583
	米ドル	631,150,240	-	631,104,800	45,440
	カナダドル	20,749,365	-	20,744,100	5,265
	ユーロ	94,717,840	-	94,721,000	3,160



英ポンド	28,774,020	-	28,773,800	220
スイスフラン	26,027,720	-	26,029,100	1,380
スウェーデンク ローナ	6,810,390	-	6,807,600	2,790
ノルウェークロー ネ	1,803,492	-	1,801,800	1,692
デンマーククロー ネ	7,067,412	-	7,066,400	1,012
オーストラリアド ル	9,931,050	-	9,928,500	2,550
香港ドル	9,029,790	-	9,027,900	1,890
シンガポールドル	2,299,464	-	2,299,200	264
売建	701,821,825	-	705,834,500	4,012,675
米ドル	563,004,900	-	565,753,500	2,748,600
カナダドル	12,999,050	-	13,066,200	67,150
ユーロ	34,083,435	-	34,177,200	93,765
英ポンド	25,002,705	-	25,511,850	509,145
スイスフラン	22,589,600	-	22,636,000	46,400
スウェーデンク ローナ	6,683,600	-	6,807,600	124,000
デンマーククロー ネ	5,045,670	-	5,058,900	13,230
オーストラリアド ル	19,202,435	-	19,531,950	329,515
香港ドル	9,413,580	-	9,457,800	44,220
シンガポールドル	3,796,850	-	3,833,500	36,650
合計	1,540,182,608	-	1,544,138,700	4,069,258

## (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ではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	APACHE CORP	2,974	5.58	16,594.92	
	BAKER HUGHES COMPANY	4,558	11.25	51,277.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,861	16.35	46,777.35	
	CHENIERE ENERGY INC	1,608	33.58	53,996.64	
	CHEVRON CORP	13,811	66.55	919,122.05	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	44.25	79,517.25	
	CONOCOPHILLIPS	7,887	30.74	242,446.38	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	381	10.30	3,924.30	
	DEVON ENERGY CORP	3,284	7.41	24,334.44	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	24.12	39,966.84	
	EOG RESOURCES INC	4,143	39.80	164,891.40	
	EXXON MOBIL CORP	30,943	35.44	1,096,619.92	
	HALLIBURTON CO	7,683	6.63	50,938.29	
	HESS CORP	1,923	34.52	66,381.96	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	19.31	32,962.17	
	KINDER MORGAN INC	14,583	12.88	187,829.04	
	MARATHON OIL CORP	6,470	3.61	23,356.70	
	MARATHON PETROLEUM CORP	4,554	17.50	79,695.00	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	11.14	34,010.42	
	NOBLE ENERGY INC	5,029	5.83	29,319.07	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	6,265	10.72	67,160.80	
	ONEOK INC	2,897	22.05	63,878.85	
	PHILLIPS 66	3,173	45.58	144,625.34	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,162	72.62	84,384.44	
SCHLUMBERGER LTD	9,847	14.65	144,258.55		
TARGA RESOURCES CORP	1,839	8.02	14,748.78		
TECHNIPFMC PLC	3,213	7.09	22,780.17		
VALERO ENERGY CORP	2,906	34.65	100,692.90		

WILLIAMS COS INC	8,501	12.92	109,832.92
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	1,597	194.42	310,488.74
ALBEMARLE CORP	740	56.03	41,462.20
AMCOR PLC	11,306	7.52	85,021.12
AVERY DENNISON CORP	583	96.76	56,411.08
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	14.73	24,834.78
BALL CORP	2,216	58.22	129,015.52
CELANESE CORP	844	66.91	56,472.04
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	25.62	39,839.10
CORTEVA INC	5,299	22.33	118,326.67
CROWN HOLDINGS INC	946	52.74	49,892.04
DOW INC	5,284	28.47	150,435.48
DUPONT DE NEMOURS INC	5,307	32.46	172,265.22
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	41.58	51,683.94
ECOLAB INC	1,877	152.97	287,124.69
FMC CORP	905	68.72	62,191.60
FREEPORT-MCMORAN INC	13,013	6.99	90,960.87
INTERNATIONAL PAPER CO	2,600	27.91	72,566.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	708	100.95	71,472.60
LINDE PLC	3,916	164.81	645,395.96
LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,861	45.29	84,284.69
MARTIN MARIETTA MATERIALS	436	160.42	69,943.12
MOSAIC CO/THE	3,288	10.70	35,181.60
NEWMONT CORP	5,917	47.50	281,057.50
NUCOR CORP	2,116	31.98	67,669.68
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	79.58	67,483.84
PPG INDUSTRIES INC	1,678	82.05	137,679.90
RPM INTERNATIONAL INC	905	54.23	49,078.15
SEALED AIR CORP	1,397	22.11	30,887.67
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	599	454.02	271,957.98
STEEL DYNAMICS INC	2,352	20.87	49,086.24
VULCAN MATERIALS CO	924	85.44	78,946.56
WESTLAKE CHEMICAL CORP	164	37.65	6,174.60
WESTROCK CO	2,274	26.24	59,669.76
3M CO	4,198	132.72	557,158.56

ACUITY BRANDS INC	445	84.03	37,393.35
AERCAP HOLDINGS NV	853	21.79	18,586.87
ALLEGION PLC	656	84.92	55,707.52
AMETEK INC	1,629	67.94	110,674.26
ARCONIC INC	3,134	15.15	47,480.10
BOEING CO/THE	3,893	127.68	497,058.24
CATERPILLAR INC	4,025	101.34	407,893.50
CUMMINS INC	1,042	124.49	129,718.58
DEERE & CO	2,168	126.00	273,168.00
DOVER CORP	1,026	74.74	76,683.24
EATON CORP PLC	2,988	71.21	212,775.48
EMERSON ELECTRIC CO	4,394	44.30	194,654.20
FASTENAL CO	4,114	31.37	129,056.18
FLOWSERVE CORP	1,171	21.34	24,989.14
FORTIVE CORP	2,147	49.92	107,178.24
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	40.37	44,568.48
GENERAL DYNAMICS CORP	1,779	114.21	203,179.59
GENERAL ELECTRIC CO	63,622	7.01	445,990.22
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	26.77	40,797.48
HEICO CORP	242	74.57	18,045.94
HEICO CORP-CLASS A	819	66.85	54,750.15
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	5,218	119.51	623,603.18
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	165.38	47,794.82
IDEX CORP	537	119.99	64,434.63
ILLINOIS TOOL WORKS	2,337	137.70	321,804.90
INGERSOLL-RAND INC	2,498	22.41	55,980.18
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	69.49	74,979.71
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	1,600	45.55	72,880.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	20.89	48,047.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	5,541	25.36	140,519.76
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	1,604	162.07	259,960.28
LENNOX INTERNATIONAL INC	245	170.24	41,708.80
LOCKHEED MARTIN CORP	1,854	288.91	535,639.14
MASCO CORP	2,007	31.62	63,461.34
MIDDLEBY CORP	299	48.99	14,648.01

NORTHROP GRUMMAN CORP	1,165	281.28	327,691.20
OWENS CORNING	860	35.51	30,538.60
PACCAR INC	2,481	57.00	141,417.00
PARKER HANNIFIN CORP	912	115.53	105,363.36
PENTAIR PLC	1,289	27.01	34,815.89
RAYTHEON COMPANY	2,016	133.57	269,277.12
ROCKWELL AUTOMATION INC	823	141.90	116,783.70
ROPER TECHNOLOGIES INC	753	282.88	213,008.64
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	27.44	46,154.08
SMITH (A.O.) CORP	762	36.49	27,805.38
SNAP-ON INC	437	106.59	46,579.83
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,077	25.58	27,549.66
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,075	90.27	97,040.25
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	258	265.62	68,529.96
TEXTRON INC	1,613	22.98	37,066.74
TRANE TECHNOLOGIES PLC	1,720	76.81	132,113.20
TRANSDIGM GROUP INC	341	325.68	111,056.88
UNITED RENTALS INC	621	86.61	53,784.81
UNITED TECHNOLOGIES CORP	5,978	86.76	518,651.28
WABCO HOLDINGS INC	362	131.50	47,603.00
WABTEC CORP	1,287	45.95	59,137.65
WW GRAINGER INC	323	238.69	77,096.87
XYLEM INC	1,273	62.00	78,926.00
CINTAS CORP	633	173.80	110,015.40
COPART INC	1,501	68.98	103,538.98
COSTAR GROUP INC	265	540.65	143,272.25
EQUIFAX INC	870	113.66	98,884.20
IHS MARKIT LTD	2,754	58.30	160,558.20
MANPOWERGROUP INC	288	55.70	16,041.60
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	13.28	36,294.24
REPUBLIC SERVICES INC	1,609	71.49	115,027.41
ROBERT HALF INTL INC	673	39.18	26,368.14
ROLLINS INC	1,190	33.81	40,233.90
TRANSUNION	1,344	61.69	82,911.36
VERISK ANALYTICS INC	1,125	137.28	154,440.00

WASTE CONNECTIONS INC	1,908	75.34	143,748.72
WASTE MANAGEMENT INC	3,091	92.07	284,588.37
AMERCO	106	274.62	29,109.72
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	198	13.92	2,756.16
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	973	63.55	61,834.15
CSX CORP	5,322	55.50	295,371.00
DELTA AIR LINES INC	1,316	26.89	35,387.24
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,175	63.09	74,130.75
FEDEX CORP	1,768	120.04	212,230.72
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	85.98	63,109.32
KANSAS CITY SOUTHERN	684	122.36	83,694.24
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	31.19	32,562.36
NORFOLK SOUTHERN CORP	1,875	140.23	262,931.25
OLD DOMINION FREIGHT LINE	521	187.87	97,880.27
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	37.66	34,195.28
UBER TECHNOLOGIES INC	3,921	26.39	103,475.19
UNION PACIFIC CORP	5,051	128.87	650,922.37
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	364	33.00	12,012.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	5,092	95.26	485,063.92
XPO LOGISTICS INC	977	46.19	45,127.63
APTIV PLC	2,242	49.52	111,023.84
AUTOLIV INC	743	45.96	34,148.28
BORGWARNER INC	2,199	22.79	50,115.21
FORD MOTOR CO	27,285	4.95	135,060.75
GENERAL MOTORS CO	9,091	21.11	191,911.01
HARLEY-DAVIDSON INC	1,270	19.48	24,739.60
LEAR CORP	352	87.94	30,954.88
TESLA INC	976	505.00	492,880.00
CAPRI HOLDINGS LTD	1,619	11.11	17,987.09
DR HORTON INC	2,408	32.89	79,199.12
GARMIN LTD	915	70.37	64,388.55
HANESBRANDS INC	4,021	9.00	36,189.00
HASBRO INC	1,095	63.11	69,105.45
LEGGETT & PLATT INC	1,466	26.49	38,834.34
LENNAR CORP-A	1,925	35.60	68,530.00

LULULEMON ATHLETICA INC	775	192.74	149,373.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	77.29	43,591.56
NEWELL RUBBERMAID INC	2,767	12.46	34,476.82
NIKE INC -CL B	9,068	72.33	655,888.44
NVR INC	24	2,633.49	63,203.76
POLARIS INC	641	46.93	30,082.13
PULTEGROUP INC	2,237	22.08	49,392.96
PVH CORP	792	35.52	28,131.84
RALPH LAUREN CORP	478	69.47	33,206.66
TAPESTRY INC	2,976	13.72	40,830.72
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	409	9.15	3,742.35
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	1,055	8.01	8,450.55
VF CORP	2,398	52.43	125,727.14
WHIRLPOOL CORP	435	83.21	36,196.35
ARAMARK	2,216	18.66	41,350.56
CARNIVAL CORP	3,704	13.68	50,670.72
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	182	664.05	120,857.10
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	53.89	59,440.67
DOMINO'S PIZZA INC	267	343.56	91,730.52
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,871	69.39	129,828.69
LAS VEGAS SANDS CORP	2,391	44.84	107,212.44
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	1,954	79.14	154,639.56
MCDONALD'S CORP	5,488	161.95	888,781.60
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	13.86	15,246.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	12.18	55,881.84
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	1,591	13.75	21,876.25
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	34.47	54,048.96
STARBUCKS CORP	8,572	64.88	556,151.36
VAIL RESORTS INC	293	142.62	41,787.66
WYNN RESORTS LTD	1,017	66.56	67,691.52
YUM! BRANDS INC	2,130	69.66	148,375.80
ACTIVISION BLIZZARD INC	5,507	54.43	299,746.01
ALPHABET INC-CL A	2,193	1,130.01	2,478,111.93
ALPHABET INC-CL C	2,263	1,134.46	2,567,282.98
ALTICE USA INC- A	872	21.24	18,521.28

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,084	419.40	454,629.60
COMCAST CORP-CLASS A	33,118	34.64	1,147,207.52
DISCOVERY INC - A	1,722	20.03	34,491.66
DISCOVERY INC-C	3,336	18.08	60,314.88
DISH NETWORK CORP-A	2,183	20.74	45,275.42
ELECTRONIC ARTS INC	2,062	94.30	194,446.60
FACEBOOK INC-A	17,614	160.98	2,835,501.72
FOX CORP - CLASS A	2,378	22.29	53,005.62
FOX CORP- CLASS B	1,836	21.65	39,749.40
IAC/INTERACTIVECORP	529	159.51	84,380.79
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	14.77	54,486.53
LIBERTY BROADBAND-C	717	101.67	72,897.39
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	17.19	22,450.14
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	16.18	56,678.54
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	23.88	51,413.64
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	28.26	49,652.82
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	27.84	26,336.64
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	42.94	67,158.16
MATCH GROUP INC	610	57.86	35,294.60
NETFLIX INC	3,194	357.32	1,141,280.08
NEWS CORP - CLASS A	2,810	8.68	24,390.80
OMNICOM GROUP	1,467	51.48	75,521.16
PINTEREST INC- CLASS A	1,570	14.26	22,388.20
ROKU INC	751	97.20	72,997.20
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	4.98	51,727.26
SNAP INC - A	6,244	11.00	68,684.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	763	112.22	85,623.86
TRIPADVISOR INC	467	18.55	8,662.85
TWITTER INC	5,080	25.85	131,318.00
VIACOMCBS INC - CLASS B	4,599	14.75	67,835.25
WALT DISNEY CO/THE	13,148	98.12	1,290,081.76
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	36.82	51,842.56
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	86.38	50,705.06
AMAZON.COM INC	3,092	1,940.10	5,998,789.20
AUTOZONE INC	171	808.43	138,241.53



BEST BUY CO INC	1,687	59.20	99,870.40
BOOKING HOLDINGS INC	305	1,259.47	384,138.35
BURLINGTON STORES INC	580	154.54	89,633.20
CARMAX INC	1,166	56.32	65,669.12
DOLLAR GENERAL CORP	1,867	141.82	264,777.94
DOLLAR TREE INC	1,693	79.66	134,864.38
EBAY INC	5,580	27.67	154,398.60
EXPEDIA GROUP INC	988	59.48	58,766.24
GAP INC/THE	2,396	8.13	19,479.48
GENUINE PARTS CO	1,255	60.81	76,316.55
GRUBHUB INC	988	34.65	34,234.20
HOME DEPOT INC	7,988	184.72	1,475,543.36
KOHL'S CORP	1,564	16.63	26,009.32
LKQ CORP	2,845	16.96	48,251.20
LOWE'S COS INC	5,593	77.30	432,338.90
MERCADOLIBRE INC	322	490.00	157,780.00
NORDSTROM INC	1,281	18.56	23,775.36
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	545	277.13	151,035.85
ROSS STORES INC	2,607	71.58	186,609.06
TARGET CORP	3,691	100.56	371,166.96
TIFFANY & CO	766	126.61	96,983.26
TJX COMPANIES INC	8,803	41.04	361,275.12
TRACTOR SUPPLY COMPANY	839	80.02	67,136.78
ULTA BEAUTY INC	498	177.59	88,439.82
WAYFAIR INC- CLASS A	341	43.48	14,826.68
COSTCO WHOLESALE CORP	3,241	284.94	923,490.54
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	3.96	396.00
KROGER CO	5,869	30.15	176,950.35
SYSCO CORP	3,541	38.98	138,028.18
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	5,559	45.25	251,544.75
WALMART INC	10,435	115.03	1,200,338.05
ALTRIA GROUP INC	13,627	32.38	441,242.26
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	3,987	32.32	128,859.84
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	2,204	48.97	107,929.88
BUNGE LTD	1,423	35.00	49,805.00

CAMPBELL SOUP CO	1,169	43.50	50,851.50
COCA-COLA CO/THE	29,804	39.45	1,175,767.80
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,555	30.79	47,878.45
CONAGRA BRANDS INC	3,745	26.53	99,354.85
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,202	123.82	148,831.64
GENERAL MILLS INC	4,380	48.23	211,247.40
HERSHEY CO/THE	1,060	121.92	129,235.20
HORMEL FOODS CORP	2,088	44.85	93,646.80
INGREDION INC	744	69.74	51,886.56
JM SMUCKER CO/THE	810	105.73	85,641.30
KELLOGG CO	1,830	56.27	102,974.10
KRAFT HEINZ CO/THE	4,792	22.99	110,168.08
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	55.04	71,552.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	884	124.93	110,438.12
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	37.47	54,818.61
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	10,498	46.66	489,836.68
MONSTER BEVERAGE CORP	2,901	53.73	155,870.73
PEPSICO INC	10,209	113.84	1,162,192.56
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	11,370	63.60	723,132.00
TYSON FOODS INC-CL A	2,093	59.99	125,559.07
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,785	62.75	112,008.75
CLOROX COMPANY	915	168.32	154,012.80
COLGATE-PALMOLIVE CO	5,960	61.18	364,632.80
COTY INC-CL A	2,506	5.10	12,780.60
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	1,626	157.83	256,631.58
KIMBERLY-CLARK CORP	2,508	117.38	294,389.04
PROCTER & GAMBLE CO/THE	18,296	103.27	1,889,427.92
ABBOTT LABORATORIES	12,959	69.69	903,112.71
ABIOMED INC	325	143.67	46,692.75
ALIGN TECHNOLOGY INC	539	165.28	89,085.92
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,113	79.85	88,873.05
ANTHEM INC	1,853	196.84	364,744.52
BAXTER INTERNATIONAL INC	3,540	73.91	261,641.40
BECTON DICKINSON AND CO	1,978	202.85	401,237.30
BOSTON SCIENTIFIC CORP	10,168	28.22	286,940.96

CARDINAL HEALTH INC	2,109	43.54	91,825.86
CENTENE CORP	4,253	48.73	207,248.69
CERNER CORP	2,277	58.42	133,022.34
CIGNA CORP	2,729	147.20	401,708.80
COOPER COS INC/THE	357	255.89	91,352.73
CVS HEALTH CORP	9,520	54.35	517,412.00
DANAHER CORP	4,581	129.15	591,636.15
DAVITA INC	653	68.65	44,828.45
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	33.81	69,242.88
DEXCOM INC	663	236.21	156,607.23
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,521	184.89	281,217.69
HCA HEALTHCARE INC	1,967	86.75	170,637.25
HENRY SCHEIN INC	1,305	46.98	61,308.90
HOLOGIC INC	1,929	31.44	60,647.76
HUMANA INC	965	234.06	225,867.90
IDEXX LABORATORIES INC	621	204.99	127,298.79
INSULET CORP	445	157.51	70,091.95
INTUITIVE SURGICAL INC	844	431.90	364,523.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	698	117.77	82,203.46
MCKESSON CORP	1,174	126.31	148,287.94
MEDTRONIC PLC	9,816	80.35	788,715.60
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,176	79.28	93,233.28
RESMED INC	1,044	135.06	141,002.64
STERIS PLC	740	118.11	87,401.40
STRYKER CORP	2,461	143.44	353,005.84
TELEFLEX INC	333	255.88	85,208.04
UNITEDHEALTH GROUP INC	6,946	219.80	1,526,730.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	78.16	51,038.48
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	716	102.32	73,261.12
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	953	144.93	138,118.29
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	532	135.48	72,075.36
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,489	93.40	139,072.60
ABBVIE INC	10,828	67.49	730,781.72
AGILENT TECHNOLOGIES INC	2,243	67.00	150,281.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,601	85.93	137,573.93

ALLERGAN PLC	2,398	170.85	409,698.30
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	800	99.94	79,952.00
AMGEN INC	4,352	202.34	880,583.68
BEIGENE LTD-ADR	300	129.27	38,781.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	160	343.15	54,904.00
BIOGEN INC	1,318	276.19	364,018.42
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,292	79.88	103,204.96
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	17,168	49.24	845,352.32
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,830	18.61	71,276.30
ELI LILLY & CO	6,329	122.89	777,770.81
EXACT SCIENCES CORP	1,138	54.79	62,351.02
GILEAD SCIENCES INC	9,262	73.96	685,017.52
ILLUMINA INC	1,070	254.18	271,972.60
INCYTE CORP	1,315	67.43	88,670.45
IONIS PHARMACEUTICALS INC	958	44.83	42,947.14
IQVIA HOLDINGS INC	1,189	96.91	115,225.99
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	406	95.62	38,821.72
JOHNSON & JOHNSON	19,304	119.18	2,300,650.72
MERCK & CO. INC.	18,661	69.05	1,288,542.05
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	176	645.53	113,613.28
MYLAN NV	4,542	15.14	68,765.88
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	628	86.23	54,152.44
PERKINELMER INC	797	74.31	59,225.07
PERRIGO CO PLC	998	45.21	45,119.58
PFIZER INC	40,562	29.70	1,204,691.40
REGENERON PHARMACEUTICALS	590	449.53	265,222.70
SAREPTA THERAPEUTICS INC	535	92.72	49,605.20
SEATTLE GENETICS INC	860	101.87	87,608.20
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,561	8.12	77,635.32
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2,937	282.03	828,322.11
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,878	223.13	419,038.14
WATERS CORP	535	180.68	96,663.80
ZOETIS INC	2,695	103.76	279,633.20
BANK OF AMERICA CORP	62,549	21.03	1,315,405.47
CITIGROUP INC	15,925	40.66	647,510.50

CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	17.80	64,436.00
COMERICA INC	1,325	30.50	40,412.50
EAST WEST BANCORP INC	1,540	29.65	45,661.00
FIFTH THIRD BANCORP	4,985	14.41	71,833.85
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,192	82.79	98,685.68
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	7.43	66,810.56
JPMORGAN CHASE & CO	22,979	88.43	2,032,032.97
KEYCORP	8,597	9.77	83,992.69
M & T BANK CORP	886	98.77	87,510.22
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	11.49	39,330.27
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	3,174	90.18	286,231.32
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	8.85	76,773.75
SIGNATURE BANK	590	78.90	46,551.00
SVB FINANCIAL GROUP	416	158.37	65,881.92
TRUIST FINANCIAL CORP	9,715	30.12	292,615.80
US BANCORP	10,780	31.20	336,336.00
WELLS FARGO & CO	29,362	28.92	849,149.04
ZIONS BANCORPORATION	1,197	25.18	30,140.46
ALLY FINANCIAL INC	3,571	14.27	50,958.17
AMERICAN EXPRESS CO	5,054	84.05	424,788.70
AMERIPRISE FINANCIAL INC	890	100.06	89,053.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	5,961	31.00	184,791.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	9,625	178.20	1,715,175.00
BLACKROCK INC	840	371.70	312,228.00
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	4,747	39.92	189,500.24
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	3,334	50.91	169,733.94
CBOE GLOBAL MARKETS INC	778	78.15	60,800.70
CME GROUP INC	2,604	152.26	396,485.04
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	33.78	94,584.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	32.88	63,885.84
EATON VANCE CORP	1,192	28.54	34,019.68
EQUITABLE HOLDINGS INC	2,938	13.42	39,427.96
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	231.36	79,587.84
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	16.56	45,341.28
GOLDMAN SACHS GROUP INC	2,312	153.60	355,123.20

INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	4,034	73.66	297,144.44
INVESCO LTD	2,612	8.52	22,254.24
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	2,716	13.42	36,448.72
KKR & CO INC -A	4,300	21.84	93,912.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	266	326.72	86,907.52
MOODY'S CORP	1,226	195.75	239,989.50
MORGAN STANLEY	8,788	33.22	291,937.36
MSCI INC	605	273.31	165,352.55
NASDAQ INC	805	82.99	66,806.95
NORTHERN TRUST CORP	1,421	69.86	99,271.06
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	59.42	62,569.26
S&P GLOBAL INC	1,774	218.66	387,902.84
SCHWAB (CHARLES) CORP	8,355	30.72	256,665.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	896	40.98	36,718.08
STATE STREET CORP	2,586	48.57	125,602.02
SYNCHRONY FINANCIAL	4,080	14.74	60,139.20
T ROWE PRICE GROUP INC	1,681	89.50	150,449.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,896	31.42	59,572.32
VOYA FINANCIAL INC	845	34.68	29,304.60
AFLAC INC	5,251	29.11	152,856.61
ALLEGHANY CORP	101	486.74	49,160.74
ALLSTATE CORP	2,332	77.92	181,709.44
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	59.13	45,884.88
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	6,201	22.93	142,188.93
AON PLC	1,696	166.04	281,603.84
ARCH CAPITAL GROUP LTD	2,854	25.60	73,062.40
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,321	77.27	102,073.67
ASSURANT INC	506	98.12	49,648.72
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	20.98	26,644.60
BROWN & BROWN INC	1,686	35.54	59,920.44
CHUBB LTD	3,292	102.56	337,627.52
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,099	78.02	85,743.98
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	152.95	22,330.70
EVEREST RE GROUP LTD	313	185.58	58,086.54
FNF GROUP	1,937	24.32	47,107.84

GLOBE LIFE INC	921	65.38	60,214.98
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,122	34.63	108,114.86
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	22.85	47,071.00
LOEWS CORP	1,885	33.74	63,599.90
MARKEL CORP	97	854.00	82,838.00
MARSH & MCLENNAN COS	3,662	86.93	318,337.66
METLIFE INC	5,615	27.61	155,030.15
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	29.61	72,514.89
PROGRESSIVE CORP	4,243	69.04	292,936.72
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	2,876	47.47	136,523.72
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	63.98	30,070.60
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	357	136.90	48,873.30
TRAVELERS COS INC/THE	1,852	93.74	173,606.48
UNUM GROUP	1,141	13.10	14,947.10
WILLIS TOWERS WATSON PLC	922	169.85	156,601.70
WR BERKLEY CORP	1,291	48.10	62,097.10
CBRE GROUP INC - A	2,186	33.86	74,017.96
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	8,400	3.70	31,080.00
JONES LANG LASALLE INC	468	87.24	40,828.32
ACCENTURE PLC-CL A	4,639	156.85	727,627.15
ADOBE INC	3,542	310.00	1,098,020.00
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,152	89.98	103,656.96
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	259	42.01	10,880.59
ANSYS INC	603	217.43	131,110.29
AUTODESK INC	1,588	149.96	238,136.48
AUTOMATIC DATA PROCESSING	3,148	120.96	380,782.08
BLACK KNIGHT INC	1,055	54.90	57,919.50
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	990	63.22	62,587.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	809	94.83	76,717.47
CADENCE DESIGN SYS INC	1,998	63.34	126,553.32
CDK GLOBAL INC	1,236	33.55	41,467.80
CHECK POINT SOFTWARE TECH	807	91.94	74,195.58
CITRIX SYSTEMS INC	930	122.00	113,460.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	3,949	46.41	183,273.09
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	279	86.95	24,259.05

DOCUSIGN INC	745	85.00	63,325.00
DROPBOX INC-CLASS A	1,047	18.80	19,683.60
DXC TECHNOLOGY CO	2,725	14.99	40,847.75
EPAM SYSTEMS INC	480	178.31	85,588.80
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	4,479	119.16	533,717.64
FISERV INC	4,201	86.65	364,016.65
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	620	190.43	118,066.60
FORTINET INC	1,025	99.78	102,274.50
GARTNER INC	792	91.66	72,594.72
GLOBAL PAYMENTS INC	2,181	141.23	308,022.63
GODADDY INC - CLASS A	1,543	57.31	88,429.33
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	582	77.86	45,314.52
INTL BUSINESS MACHINES CORP	6,469	105.48	682,350.12
INTUIT INC	1,896	233.82	443,322.72
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	544	142.23	77,373.12
LEIDOS HOLDINGS INC	948	78.46	74,380.08
MASTERCARD INC-CLASS A	6,575	237.07	1,558,735.25
MICROSOFT CORP	53,174	148.34	7,887,831.16
MONGODB INC	444	136.43	60,574.92
NORTONLIFELOCK INC	4,396	17.35	76,270.60
OKTA INC	752	123.97	93,225.44
ORACLE CORP	16,796	47.84	803,520.64
PALO ALTO NETWORKS INC	694	160.72	111,539.68
PAYCHEX INC	2,312	59.56	137,702.72
PAYCOM SOFTWARE INC	437	201.62	88,107.94
PAYPAL HOLDINGS INC	8,151	97.29	793,010.79
PTC INC	1,110	53.79	59,706.90
RINGCENTRAL INC-CLASS A	530	205.08	108,692.40
SABRE CORP	2,780	4.68	13,010.40
SALESFORCE.COM INC	6,090	153.64	935,667.60
SERVICENOW INC	1,372	272.00	373,184.00
SPLUNK INC	1,101	121.10	133,331.10
SQUARE INC - A	2,464	46.31	114,107.84
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	38.72	77,478.72
SYNOPSYS INC	1,074	120.63	129,556.62



TWILIO INC - A	835	97.53	81,437.55
TYLER TECHNOLOGIES INC	275	270.98	74,519.50
VERISIGN INC	755	170.53	128,750.15
VISA INC-CLASS A SHARES	12,549	154.53	1,939,196.97
VMWARE INC-CLASS A	730	112.53	82,146.90
WESTERN UNION CO	2,957	19.11	56,508.27
WIX.COM LTD	437	107.10	46,802.70
WORKDAY INC-CLASS A	1,174	132.39	155,425.86
AMPHENOL CORP-CL A	2,116	74.15	156,901.40
APPLE INC	32,598	246.88	8,047,794.24
ARISTA NETWORKS INC	373	186.56	69,586.88
ARROW ELECTRONICS INC	902	52.27	47,147.54
CDW CORP/DE	1,006	93.83	94,392.98
CISCO SYSTEMS INC	31,028	38.60	1,197,680.80
COGNEX CORP	1,193	44.12	52,635.16
CORNING INC	5,453	20.02	109,169.06
DELL TECHNOLOGIES -C	1,389	38.85	53,962.65
F5 NETWORKS INC	613	102.71	62,961.23
FLEX LTD	4,584	7.66	35,113.44
FLIR SYSTEMS INC	1,041	29.37	30,574.17
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	9,037	8.94	80,790.78
HP INC	10,561	15.47	163,378.67
IPG PHOTONICS CORP	259	121.20	31,390.80
JUNIPER NETWORKS INC	2,337	19.45	45,454.65
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	1,329	85.06	113,044.74
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,230	130.81	160,896.30
NETAPP INC	1,594	38.28	61,018.32
SEAGATE TECHNOLOGY	2,020	43.46	87,789.20
TE CONNECTIVITY LTD	2,377	60.56	143,951.12
TRIMBLE INC	2,244	28.52	63,998.88
WESTERN DIGITAL CORP	2,541	40.47	102,834.27
XEROX HOLDINGS CORP	2,113	17.53	37,040.89
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	377	180.55	68,067.35
AT&T INC	53,610	28.09	1,505,904.90
CENTURYLINK INC	7,172	9.95	71,361.40

SPRINT CORP	7,702	8.02	61,770.04
T-MOBILE US INC	2,507	78.65	197,175.55
VERIZON COMMUNICATIONS INC	30,352	49.99	1,517,296.48
AES CORP	4,924	12.66	62,337.84
ALLIANT ENERGY CORP	1,752	43.86	76,842.72
AMEREN CORPORATION	1,778	65.29	116,085.62
AMERICAN ELECTRIC POWER	3,601	72.05	259,452.05
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,310	103.95	136,174.50
ATMOS ENERGY CORP	921	88.59	81,591.39
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	13.63	53,865.76
CMS ENERGY CORP	2,048	51.43	105,328.64
CONSOLIDATED EDISON INC	2,417	70.51	170,422.67
DOMINION ENERGY INC	6,015	65.67	395,005.05
DTE ENERGY COMPANY	1,382	86.52	119,570.64
DUKE ENERGY CORP	5,352	71.50	382,668.00
EDISON INTERNATIONAL	2,589	50.38	130,433.82
ENERGY CORP	1,437	86.33	124,056.21
ESSENTIAL UTILITIES INC	1,545	36.59	56,531.55
EVERGY INC	1,636	50.71	82,961.56
EVERSOURCE ENERGY	2,352	71.44	168,026.88
EXELON CORP	7,071	34.51	244,020.21
FIRSTENERGY CORP	3,908	35.48	138,655.84
NEXTERA ENERGY INC	3,578	206.53	738,964.34
NISOURCE INC	2,749	21.94	60,313.06
NRG ENERGY INC	1,800	25.76	46,368.00
OGE ENERGY CORP	1,432	27.03	38,706.96
PINNACLE WEST CAPITAL	828	71.04	58,821.12
PPL CORP	5,213	21.24	110,724.12
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	3,656	40.78	149,091.68
SEMPRA ENERGY	2,048	104.03	213,053.44
SOUTHERN CO/THE	7,660	49.04	375,646.40
UGI CORP	1,566	24.33	38,100.78
VISTRA ENERGY CORP	2,849	14.61	41,623.89
WEC ENERGY GROUP INC	2,295	80.21	184,081.95
XCEL ENERGY INC	3,814	54.05	206,146.70

	ADVANCED MICRO DEVICES	7,725	46.22	357,049.50	
	ANALOG DEVICES INC	2,684	93.73	251,571.32	
	APPLIED MATERIALS INC	6,740	45.14	304,243.60	
	BROADCOM INC	2,902	212.76	617,429.52	
	INTEL CORP	31,897	52.40	1,671,402.80	
	KLA CORP	1,146	136.36	156,268.56	
	LAM RESEARCH CORP	1,057	230.64	243,786.48	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	5,363	21.86	117,235.18	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,332	48.04	112,029.28	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,727	75.72	130,768.44	
	MICRON TECHNOLOGY INC	8,080	43.27	349,621.60	
	NVIDIA CORP	4,260	249.18	1,061,506.80	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	2,007	85.73	172,060.11	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	13.85	44,306.15	
	QORVO INC	837	78.79	65,947.23	
	QUALCOMM INC	8,355	65.46	546,918.30	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,228	87.29	107,192.12	
	TERADYNE INC	1,207	52.82	63,753.74	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	6,846	105.36	721,294.56	
	XILINX INC	1,824	76.91	140,283.84	
	米ドル 小計	2,224,520		152,362,637.96	(16,936,630,835)
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	9.70	23,900.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	8,172	13.69	111,874.68	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	2.57	26,566.09	
	ENBRIDGE INC	14,691	39.37	578,384.67	
	HUSKY ENERGY INC	1,391	3.15	4,381.65	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	14.22	40,910.94	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	8.48	29,434.08	
	KEYERA CORP	2,259	13.40	30,270.60	
	OVINTIV INC	1,701	4.10	6,974.10	
	PARKLAND FUEL CORP	1,790	21.68	38,807.20	
	PEMBINA PIPELINE CORP	3,677	28.52	104,868.04	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	517	7.39	3,820.63	
	SUNCOR ENERGY INC	10,908	17.42	190,017.36	

TC ENERGY CORP	6,741	55.62	374,934.42
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,032	64.23	130,515.36
BARRICK GOLD CORP	12,772	28.38	362,469.36
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	38.14	63,808.22
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	7.15	30,652.05
FRANCO-NEVADA CORP	1,343	160.91	216,102.13
KINROSS GOLD CORP	10,281	6.60	67,854.60
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,324	45.75	106,323.00
LUNDIN MINING CORP	7,300	5.04	36,792.00
METHANEX CORP	131	16.71	2,189.01
NUTRIEN LTD	4,033	41.81	168,619.73
TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,246	11.48	37,264.08
WEST FRASER TIMBER CO LTD	335	27.76	9,299.60
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	3,116	40.72	126,883.52
BOMBARDIER INC-B	8,071	0.44	3,551.24
CAE INC	3,196	17.02	54,395.92
WSP GLOBAL INC	718	69.52	49,915.36
THOMSON REUTERS CORP	1,425	82.34	117,334.50
AIR CANADA	840	15.11	12,692.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	5,175	108.80	563,040.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	979	299.55	293,259.45
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,534	42.33	107,264.22
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	16.38	29,484.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	1,880	56.00	105,280.00
STARS GROUP INC/THE	2,811	25.19	70,809.09
QUEBECOR INC -CL B	1,274	28.99	36,933.26
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,882	19.31	55,651.42
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	83.80	41,900.00
DOLLARAMA INC	2,070	37.87	78,390.90
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	6,356	34.20	217,375.20
EMPIRE CO LTD 'A'	864	27.19	23,492.16
LOBLAW COMPANIES LTD	1,439	63.64	91,577.96
METRO INC	1,851	55.14	102,064.14
WESTON (GEORGE) LTD	817	92.88	75,882.96
SAPUTO INC	1,654	33.36	55,177.44

AURORA CANNABIS INC	4,385	1.05	4,604.25
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	21.63	70,881.51
CANOPY GROWTH CORP	1,137	19.10	21,716.70
CRONOS GROUP INC	1,000	7.98	7,980.00
BANK OF MONTREAL	4,597	64.10	294,667.70
BANK OF NOVA SCOTIA	8,835	52.26	461,717.10
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	3,194	75.10	239,869.40
NATIONAL BANK OF CANADA	2,887	46.31	133,696.97
ROYAL BANK OF CANADA	10,458	81.75	854,941.50
TORONTO-DOMINION BANK	13,196	55.89	737,524.44
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	6,439	56.14	361,485.46
CI FINANCIAL CORP	775	12.58	9,749.50
IGM FINANCIAL INC	81	21.64	1,752.84
ONEX CORPORATION	908	45.90	41,677.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	185	417.23	77,187.55
GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	22.28	41,128.88
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	35.71	44,780.34
INTACT FINANCIAL CORP	974	115.67	112,662.58
MANULIFE FINANCIAL CORP	13,911	15.58	216,733.38
POWER CORP OF CANADA	4,873	21.24	103,502.52
SUN LIFE FINANCIAL INC	4,184	40.13	167,903.92
BLACKBERRY LTD	1,407	5.24	7,372.68
CGI INC	1,689	71.41	120,611.49
CONSTELLATION SOFTWARE INC	143	1,240.00	177,320.00
OPEN TEXT CORP	1,878	46.50	87,327.00
SHOPIFY INC - CLASS A	751	628.40	471,928.40
BCE INC	1,116	50.85	56,748.60
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	2,631	52.75	138,785.25
TELUS CORP	640	20.48	13,107.20
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	4,426	15.24	67,452.24
ALTAGAS LTD	2,930	10.89	31,907.70
ATCO LTD -CLASS I	863	32.02	27,633.26
CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	27.30	26,945.10
EMERA INC	1,699	45.96	78,086.04
FORTIS INC	3,685	45.90	169,141.50

	HYDRO ONE LTD	2,283	23.11	52,760.13
	カナダドル 小計	288,529		10,642,679.87 (818,102,801)
ユーロ	ENI SPA	18,047	8.37	151,143.62
	GALP ENERGIA SGPS SA	4,618	9.39	43,381.49
	NESTE OYJ	2,948	25.90	76,353.20
	OMV AG	1,475	25.40	37,465.00
	REPSOL SA	10,083	7.18	72,456.43
	TENARIS SA	5,062	5.35	27,081.70
	TOTAL SA	17,481	30.47	532,733.47
	VOPAK	762	46.20	35,204.40
	AIR LIQUIDE SA	3,439	108.80	374,163.20
	AKZO NOBEL	1,654	54.90	90,804.60
	ARCELORMITTAL	4,462	8.54	38,105.48
	ARKEMA	463	58.54	27,104.02
	BASF SE	6,680	43.30	289,244.00
	COVESTRO AG	1,223	27.72	33,901.56
	CRH PLC	5,629	21.00	118,209.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	18.79	33,699.43
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	33.44	1,872.64
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	37.29	51,534.78
	KONINKLIJKE DSM NV	1,277	99.66	127,265.82
	LANXESS AG	745	33.84	25,210.80
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	23.86	54,543.96
	SOLVAY SA	516	68.94	35,573.04
	STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	8.27	46,439.00
	SYMRISE AG	911	82.52	75,175.72
	THYSSENKRUPP AG	2,040	4.89	9,991.92
	UMICORE	1,389	34.50	47,920.50
	UPM-KYMMENE OYJ	3,744	22.47	84,127.68
	VOESTALPINE AG	712	18.17	12,940.60
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	14.50	41,687.50
	AIRBUS SE	4,235	55.98	237,075.30
	ALSTOM	1,324	36.93	48,895.32
	ANDRITZ AG	352	26.80	9,433.60

BOUYGUES SA	1,779	29.22	51,982.38
BRENTAG AG	1,535	31.43	48,245.05
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	4.97	47,671.89
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	3,477	20.07	69,800.77
DASSAULT AVIATION SA	11	737.00	8,107.00
EIFFAGE	782	60.38	47,217.16
FERROVIAL SA	3,504	19.74	69,168.96
GEA GROUP AG	1,676	18.17	30,452.92
HOCHTIEF AG	17	56.10	953.70
KINGSPAN GROUP PLC	1,226	47.10	57,744.60
KION GROUP AG	740	36.75	27,195.00
KNORR-BREMSE AG	297	78.04	23,177.88
KONE OYJ-B	2,439	46.96	114,535.44
LEGRAND SA	1,912	58.52	111,890.24
LEONARDO SPA	3,148	5.25	16,527.00
METSO OYJ	751	20.01	15,027.51
MTU AERO ENGINES AG	373	118.10	44,051.30
PRYSMIAN SPA	1,283	16.84	21,605.72
SAFRAN SA	2,357	68.98	162,585.86
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,023	75.90	305,345.70
SIEMENS AG-REG	5,590	75.30	420,927.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	13.94	31,978.36
THALES SA	738	66.78	49,283.64
VINCI SA	3,734	69.10	258,019.40
WARTSILA OYJ ABP	2,705	6.25	16,917.07
BUREAU VERITAS SA	2,067	17.68	36,544.56
RANDSTAD NV	825	31.45	25,946.25
TELEPERFORMANCE	517	175.70	90,836.90
WOLTERS KLUWER	1,945	56.78	110,437.10
ADP	314	107.20	33,660.80
AENA SME SA	466	106.70	49,722.20
ATLANTIA SPA	3,792	11.93	45,238.56
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	9.61	13,521.27
DEUTSCHE POST AG-REG	7,088	23.29	165,114.96
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	37.00	14,245.00

GETLINK	4,655	10.23	47,620.65
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,329	45.15	105,154.35
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	38.10	23,583.90
CONTINENTAL AG	753	65.00	48,945.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	6,495	28.40	184,458.00
FAURECIA	800	29.00	23,200.00
FERRARI NV	837	138.60	116,008.20
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	7,060	6.64	46,878.40
MICHELIN (CGDE)	1,187	76.34	90,615.58
NOKIAN RENKAAT OYJ	423	17.94	7,588.62
PEUGEOT SA	5,130	11.97	61,406.10
PIRELLI & C SPA	1,734	3.59	6,225.06
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,049	37.80	39,652.20
RENAULT SA	1,817	17.96	32,644.22
VALEO SA	2,418	16.52	39,957.45
VOLKSWAGEN AG	194	116.95	22,688.30
VOLKSWAGEN AG-PREF	1,317	109.00	143,553.00
ADIDAS AG	1,303	195.12	254,241.36
ESSILORLUXOTTICA	2,039	109.05	222,352.95
HERMES INTERNATIONAL	224	641.20	143,628.80
KERING	544	448.35	243,902.40
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,025	339.15	686,778.75
MONCLER SPA	1,414	32.45	45,884.30
PUMA SE	750	49.00	36,750.00
SEB SA	151	111.10	16,776.10
ACCOR SA	1,140	26.01	29,651.40
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	534	75.56	40,349.04
SODEXO	575	62.40	35,880.00
ALTICE EUROPE NV	7,300	3.67	26,842.10
BOLLORE	3,240	2.67	8,676.72
EUTELSAT COMMUNICATIONS	409	8.79	3,596.74
JC DECAUX SA	60	17.67	1,060.20
PUBLICIS GROUPE	1,962	25.13	49,305.06
SES	2,232	5.89	13,155.40
TELENET GROUP HOLDING NV	192	29.62	5,687.04



UBISOFT ENTERTAINMENT	562	64.26	36,114.12
VIVENDI	5,750	18.84	108,330.00
DELIVERY HERO SE	814	68.46	55,726.44
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	7,953	23.57	187,452.21
JUST EAT TAKEAWAY	791	68.50	54,183.50
PROSUS NV	3,498	60.50	211,629.00
ZALANDO SE	800	32.59	26,072.00
CARREFOUR SA	4,448	14.23	63,317.28
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	34.87	21,793.75
COLRUYT SA	290	50.18	14,552.20
JERONIMO MARTINS	2,258	16.18	36,545.73
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	7,998	20.31	162,439.38
METRO AG	1,970	7.14	14,065.80
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	5,555	40.40	224,422.00
DANONE	4,491	54.92	246,645.72
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,500	6.57	23,012.50
HEINEKEN HOLDING NV	785	65.40	51,339.00
HEINEKEN NV	1,844	71.44	131,735.36
KERRY GROUP PLC-A	1,144	96.45	110,338.80
PERNOD RICARD SA	1,538	127.65	196,325.70
REMY COINTREAU	18	91.80	1,652.40
BEIERSDORF AG	744	94.38	70,218.72
HENKEL AG & CO KGAA	966	61.85	59,747.10
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,314	70.78	93,004.92
L'OREAL	1,841	238.30	438,710.30
UNILEVER NV	10,720	42.20	452,384.00
BIOMERIEUX	110	94.55	10,400.50
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	79.80	19,551.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	1,562	55.96	87,409.52
FRESENIUS SE & CO KGAA	3,062	33.09	101,336.89
KONINKLIJKE PHILIPS NV	6,556	33.49	219,560.44
SARTORIUS AG-VORZUG	339	208.80	70,783.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	36.04	56,330.52
BAYER AG-REG	7,204	51.19	368,772.76
EUROFINS SCIENTIFIC	82	456.80	37,457.60

GALAPAGOS NV	333	144.50	48,118.50
GRIFOLS SA	2,182	29.50	64,369.00
IPSEN	158	50.65	8,002.70
MERCK KGAA	944	89.70	84,676.80
ORION OYJ-CLASS B	739	32.51	24,024.89
QIAGEN N.V.	1,652	36.67	60,578.84
RECORDATI SPA	830	35.24	29,249.20
SANOFI	8,261	74.74	617,427.14
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	161.80	48,216.40
UCB SA	1,046	67.98	71,107.08
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.75	33,332.94
AIB GROUP PLC	2,000	0.99	1,994.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	48,276	3.09	149,221.11
BANCO DE SABADELL SA	55,157	0.47	26,287.82
BANCO SANTANDER SA	121,095	2.36	286,874.05
BANK OF IRELAND GROUP PLC	10,400	1.76	18,345.60
BANKIA SA	1,600	0.92	1,474.56
BANKINTER SA	2,829	3.45	9,785.51
BNP PARIBAS	8,149	27.78	226,379.22
CAIXABANK S.A	25,249	1.70	43,024.29
COMMERZBANK AG	5,632	3.47	19,543.04
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	7.05	71,620.11
ERSTE GROUP BANK AG	1,624	20.16	32,739.84
FINECOBANK SPA	4,007	8.22	32,937.54
ING GROEP NV-CVA	27,532	5.82	160,401.43
INTESA SANPAOLO	106,353	1.58	168,420.61
KBC GROEP NV	1,795	47.61	85,459.95
MEDIOBANCA SPA	6,857	4.96	34,024.43
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	14.16	17,218.56
SOCIETE GENERALE SA	5,750	15.52	89,274.50
UNICREDIT SPA	14,172	8.36	118,548.78
AMUNDI SA	618	55.90	34,546.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	14,014	6.07	85,191.10
DEUTSCHE BOERSE AG	1,374	115.00	158,010.00
EURAZEO	403	40.50	16,321.50

EXOR NV	712	43.39	30,893.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	568	66.44	37,737.92
NATIXIS	3,105	2.67	8,312.08
WENDEL	294	73.75	21,682.50
AEGON NV	16,557	2.40	39,736.80
AGEAS	1,697	28.52	48,398.44
ALLIANZ SE-REG	3,047	150.18	457,598.46
ASSICURAZIONI GENERALI	7,691	12.10	93,061.10
AXA SA	13,978	15.81	220,992.18
CNP ASSURANCES	1,015	8.27	8,394.05
HANNOVER RUECK SE	485	130.20	63,147.00
MAPFRE SA	942	1.53	1,449.26
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,047	185.95	194,689.65
NN GROUP NV	2,804	23.59	66,146.36
POSTE ITALIANE SPA	5,374	7.66	41,197.08
SAMPO OYJ-A SHS	3,127	27.02	84,491.54
SCOR SE	1,565	23.12	36,182.80
AROUNDTOWN SA	10,475	4.27	44,738.72
DEUTSCHE WOHNEN SE	2,514	31.39	78,914.46
VONOVIA SE	3,689	44.10	162,684.90
ADYEN NV	71	720.80	51,176.80
AMADEUS IT GROUP SA	3,127	41.84	130,833.68
ATOS SE	1,004	56.76	56,987.04
CAPGEMINI SA	1,122	71.96	80,739.12
DASSAULT SYSTEMES SA	943	133.15	125,560.45
EDENRED	1,709	37.58	64,224.22
SAP SE	7,196	97.80	703,768.80
WIRECARD AG	842	93.62	78,828.04
WORLDLINE SA	1,066	52.40	55,858.40
INGENICO GROUP	414	93.74	38,808.36
NOKIA OYJ	39,856	2.75	109,743.49
CELLNEX TELECOM SA	2,194	41.11	90,195.34
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	24,567	12.07	296,523.69
ELISA OYJ	1,241	51.28	63,638.48
ILIAD SA	98	116.50	11,417.00

	KONINKLIJKE KPN NV	25,539	2.10	53,836.21	
	ORANGE	14,664	11.65	170,835.60	
	PROXIMUS	918	20.42	18,745.56	
	TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.39	28,521.50	
	TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.39	27,869.01	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	620	2.25	1,400.58	
	TELEFONICA SA	34,589	4.51	156,100.15	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	25.61	19,617.26	
	E.ON SE	16,417	8.46	139,002.73	
	EDF	6,102	7.11	43,421.83	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	16,914	3.44	58,319.47	
	ENAGAS SA	1,292	18.04	23,307.68	
	ENDESA SA	3,177	17.58	55,867.54	
	ENEL SPA	59,248	6.31	373,914.12	
	ENGIE	13,267	10.39	137,844.13	
	FORTUM OYJ	3,981	12.76	50,797.56	
	IBERDROLA SA	45,140	8.80	397,593.12	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	16.36	35,102.92	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	3,151	14.84	46,776.59	
	RWE AG	4,262	22.59	96,278.58	
	SNAM SPA	14,268	3.90	55,759.34	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	9.26	20,788.70	
	TERNA SPA	9,835	5.46	53,718.77	
	UNIPER SE	1,464	22.78	33,349.92	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	3,872	18.34	71,012.48	
	VERBUND AG	797	32.56	25,950.32	
	ASML HOLDING NV	3,110	240.00	746,400.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	9,178	12.94	118,800.03	
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	18.32	111,122.80	
	ユーロ 小計	1,457,066		22,342,029.31 (2,679,479,575)	
英ポンド	BP PLC	146,763	3.12	458,414.23	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	30,198	13.57	409,847.25	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	26,893	13.12	352,889.94	
	ANGLO AMERICAN PLC	7,114	13.20	93,904.80	

ANTOFAGASTA PLC	4,320	7.14	30,879.36
BHP GROUP PLC	15,030	12.88	193,646.52
CRODA INTERNATIONAL PLC	858	41.86	35,915.88
EVRAZ PLC	3,072	2.52	7,744.51
GLENCORE PLC	74,422	1.28	95,260.16
JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	19.04	34,329.12
MONDI PLC	3,232	12.63	40,820.16
RIO TINTO PLC	8,109	35.55	288,315.49
ASHTED GROUP PLC	3,084	15.80	48,742.62
BAE SYSTEMS PLC	22,640	4.85	109,826.64
BUNZL PLC	3,344	14.10	47,150.40
DCC PLC	823	48.88	40,228.24
FERGUSON PLC	1,569	46.50	72,958.50
MEGGITT PLC	7,023	2.80	19,664.40
MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	1.03	46,054.82
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	11,766	3.50	41,192.76
SMITHS GROUP PLC	3,824	10.16	38,870.96
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	499	85.55	42,689.45
WEIR GROUP PLC/THE	2,572	7.40	19,032.80
EXPERIAN PLC	6,495	21.14	137,304.30
G4S PLC	17,548	0.84	14,835.07
INTERTEK GROUP PLC	1,108	43.63	48,342.04
RELX PLC	13,998	15.90	222,638.19
RENTOKIL INITIAL PLC	12,702	3.70	47,048.20
EASYJET PLC	130	5.80	754.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	6,642	4.09	27,185.70
BERKELEY GROUP HOLDINGS	780	34.23	26,699.40
BURBERRY GROUP PLC	3,298	12.50	41,225.00
PERSIMMON PLC	2,079	16.91	35,166.28
TAYLOR WIMPEY PLC	21,395	1.16	24,882.38
CARNIVAL PLC	1,722	10.62	18,287.64
COMPASS GROUP PLC	11,037	10.60	116,992.20
GVC HOLDINGS PLC	6,950	4.36	30,350.65
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	30.50	50,935.00
TUI AG-DI	4,120	3.33	13,731.96

WHITBREAD PLC	983	26.90	26,442.70
AUTO TRADER GROUP PLC	5,811	3.93	22,860.47
INFORMA PLC	11,550	4.25	49,110.60
ITV PLC	42,960	0.60	25,776.00
PEARSON PLC	7,332	4.96	36,410.71
WPP PLC	7,944	5.25	41,753.66
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	4.32	21,432.16
KINGFISHER PLC	12,732	1.52	19,352.64
MARKS & SPENCER GROUP PLC	9,143	0.99	9,113.74
NEXT PLC	1,278	40.00	51,120.00
OCADO GROUP PLC	2,823	12.50	35,301.61
SAINSBURY (J) PLC	9,573	2.03	19,433.19
TESCO PLC	71,038	2.16	154,010.38
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.79	41,356.88
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	16.07	52,742.07
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	16,679	25.63	427,482.77
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	18.00	33,048.00
DIAGEO PLC	17,032	23.96	408,086.72
IMPERIAL BRANDS PLC	6,624	13.32	88,231.68
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	5,166	57.59	297,509.94
UNILEVER PLC	8,082	39.97	323,077.95
NMC HEALTH PLC	438	9.38	4,110.19
SMITH & NEPHEW PLC	6,166	14.05	86,632.30
ASTRAZENECA PLC	9,583	69.60	666,976.80
GLAXOSMITHKLINE PLC	36,401	14.15	515,292.55
BARCLAYS PLC	121,223	0.96	116,398.32
HSBC HOLDINGS PLC	148,160	5.15	763,024.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	500,406	0.33	168,361.59
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	42,392	1.20	50,976.38
STANDARD CHARTERED PLC	18,922	4.50	85,262.53
3I GROUP PLC	8,862	7.27	64,462.18
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	12.65	38,810.20
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	2,229	69.02	153,845.58
M&G PLC	21,579	1.39	29,994.81
SCHRODERS PLC	1,161	24.00	27,864.00

	ST JAMES'S PLACE PLC	3,582	7.24	25,933.68	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	2.01	37,734.30	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,104	21.32	23,537.28	
	AVIVA PLC	26,862	2.42	65,167.21	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	2.43	18,155.04	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	41,023	1.61	66,272.65	
	PRUDENTIAL PLC	18,459	9.19	169,675.12	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	3.83	36,033.66	
	AVEVA GROUP PLC	700	33.00	23,100.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL	1,601	3.57	5,720.37	
	SAGE GROUP PLC/THE	9,110	5.60	51,088.88	
	HALMA PLC	2,529	18.43	46,609.47	
	BT GROUP PLC	60,238	1.32	80,008.11	
	VODAFONE GROUP PLC	194,812	1.11	216,708.86	
	CENTRICA PLC	60,998	0.41	25,570.36	
	NATIONAL GRID PLC	25,199	8.41	211,999.18	
	SEVERN TRENT PLC	1,640	20.85	34,194.00	
	SSE PLC	7,312	12.15	88,840.80	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	4,711	7.98	37,612.62	
	英ポンド 小計	2,221,093		9,644,383.91 (1,261,871,190)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	15.65	9,079.90	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	586.50	45,747.00	
	GIVAUDAN-REG	67	2,991.00	200,397.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	3,506	33.96	119,063.76	
	SIKA AG-REG	913	153.80	140,419.40	
	ABB LTD-REG	13,379	16.57	221,690.03	
	GEBERIT AG-REG	266	430.70	114,566.20	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	200.80	43,172.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	288	207.80	59,846.40	
	ADECCO SA-REG	1,516	35.62	53,999.92	
	SGS SA-REG	44	2,274.00	100,056.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	370	132.45	49,006.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	3,747	54.50	204,211.50	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	198	194.20	38,451.60	

	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	37.76	9,477.76	
	DUFREY AG-REG	465	30.21	14,047.65	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	21	1,880.00	39,480.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	7,275.00	58,200.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	74,100.00	74,100.00	
	NESTLE SA-REG	21,820	94.21	2,055,662.20	
	ALCON INC	3,031	43.62	132,212.22	
	SONOVA HOLDING AG-REG	419	160.10	67,081.90	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	75	646.20	48,465.00	
	LONZA GROUP AG-REG	544	356.20	193,772.80	
	NOVARTIS AG-REG	15,755	72.57	1,143,340.35	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	5,154	291.35	1,501,617.90	
	VIFOR PHARMA AG	329	126.55	41,634.95	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	18,341	7.71	141,409.11	
	JULIUS BAER GROUP LTD	1,813	33.10	60,010.30	
	PARGESA HOLDING SA-BR	29	60.85	1,764.65	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	132	657.80	86,829.60	
	UBS GROUP AG-REG	27,968	8.76	245,167.48	
	BALOISE HOLDING AG - REG	344	122.70	42,208.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	238	302.50	71,995.00	
	SWISS RE AG	2,117	65.14	137,901.38	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,089	307.20	334,540.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	620	92.00	57,040.00	
	TEMENOS GROUP AG-REG	462	113.40	52,390.80	
	SWISSCOM AG-REG	191	517.60	98,861.60	
	スイスフラン 小計	126,384		8,108,919.46 (917,848,593)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	1,099	169.65	186,445.35	
	BOLIDEN AB	1,948	176.85	344,503.80	
	ALFA LAVAL AB	2,277	163.00	371,151.00	
	ASSA ABLOY AB-B	7,306	167.45	1,223,389.70	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	4,898	296.20	1,450,787.60	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	2,827	256.00	723,712.00	
	EPIROC AB-A	5,706	88.88	507,149.28	
	EPIROC AB-B	1,290	86.10	111,069.00	



SANDVIK AB	8,212	128.10	1,051,957.20		
SKANSKA AB-B SHS	2,462	154.90	381,363.80		
SKF AB-B SHARES	2,513	123.00	309,099.00		
VOLVO AB-B SHS	10,813	109.45	1,183,482.85		
SECURITAS AB-B SHS	3,833	100.85	386,558.05		
ELECTROLUX AB-SER B	1,532	113.35	173,652.20		
ELECTROLUX PROFESSIONAL AB-B	1,532	20.00	30,640.00		
HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	47.51	134,785.87		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	5,841	123.16	719,377.56		
ICA GRUPPEN AB	510	402.40	205,224.00		
SWEDISH MATCH AB	1,229	522.60	642,275.40		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	4,496	281.40	1,265,174.40		
NORDEA BANK ABP	23,511	53.33	1,253,841.63		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	11,730	64.70	758,931.00		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	11,234	78.32	879,846.88		
SWEDBANK AB - A SHARES	7,947	113.40	901,189.80		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	187.80	118,877.40		
INVESTOR AB-B SHS	3,305	419.90	1,387,769.50		
KINNEVIK AB - B	2,331	153.50	357,808.50		
LUNDBERGS AB-B SHS	90	388.20	34,938.00		
ERICSSON LM-B SHS	22,283	76.02	1,693,953.66		
HEXAGON AB-B SHS	1,886	393.50	742,141.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	842	258.60	217,741.20		
TELE2 AB-B SHS	3,777	125.95	475,713.15		
TELIA CO AB	20,672	35.64	736,750.08		
スウェーデンクローナ 小計	183,402		20,961,299.86 (230,364,685)		
ノルウェーク ローネ	AKER BP ASA	242	118.95	28,785.90	
	EQUINOR ASA	7,303	114.55	836,558.65	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	23.16	187,734.96	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	320.30	546,752.10	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	184.10	101,623.20	
	MOWI ASA	3,230	178.50	576,555.00	
	ORKLA ASA	6,749	83.58	564,081.42	
	DNB ASA	6,924	107.05	741,214.20	

	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	662	172.60	114,261.20	
	TELENOR ASA	6,751	147.00	992,397.00	
	ノルウェークローネ 小計	42,226		4,689,963.63	(46,993,435)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	881	467.60	411,955.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	1,498	286.00	428,428.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,359	532.40	723,531.60	
	ISS A/S	982	90.42	88,792.44	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	5,050.00	196,950.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	45	5,506.00	247,770.00	
	DSV PANALPINA A S	1,493	518.60	774,269.80	
	PANDORA A/S	1,082	216.30	234,036.60	
	CARLSBERG AS-B	763	692.80	528,606.40	
	COLOPLAST-B	868	962.40	835,363.20	
	DEMANT A/S	550	140.70	77,385.00	
	GENMAB A/S	473	1,343.00	635,239.00	
	H LUNDBECK A/S	120	193.60	23,232.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	12,974	355.00	4,605,770.00	
	DANSKE BANK A/S	6,042	70.06	423,302.52	
TRYG A/S	694	154.80	107,431.20		
ORSTED A/S	1,377	627.00	863,379.00		
	デンマーククローネ 小計	31,240		11,205,442.36	(180,071,458)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LTD	3,012	20.51	61,776.12	
	OIL SEARCH LTD	14,702	2.04	29,992.08	
	ORIGIN ENERGY LTD	14,373	4.05	58,210.65	
	SANTOS LTD	14,669	3.52	51,634.88	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	18.65	6,658.05	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	6,396	16.13	103,167.48	
	WORLEY LTD	1,064	5.11	5,437.04	
	ALUMINA LTD	25,748	1.57	40,553.10	
	BHP GROUP LTD	21,267	28.40	603,982.80	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	8.65	54,114.40	
	BORAL LTD	12,991	1.78	23,188.93	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	11,408	9.73	110,999.84		

INCITEC PIVOT LTD	5,342	1.73	9,241.66
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	16.87	65,809.87
NEWCREST MINING LTD	5,247	24.21	127,029.87
ORICA LTD	2,575	14.66	37,749.50
RIO TINTO LTD	2,604	79.55	207,148.20
SOUTH32 LTD	38,772	1.75	67,851.00
CIMIC GROUP LTD	682	21.90	14,935.80
BRAMBLES LTD	10,716	9.91	106,195.56
SEEK LTD	3,309	12.10	40,038.90
AURIZON HOLDINGS LTD	12,197	4.03	49,153.91
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	2.59	22,533.00
SYDNEY AIRPORT	12,027	4.99	60,014.73
TRANSURBAN GROUP	18,973	11.18	212,118.14
ARISTOCRAT LEISURE LTD	3,594	17.09	61,421.46
CROWN RESORTS LTD	773	6.48	5,009.04
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP L	44	9.91	436.04
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	2.34	49,685.22
REA GROUP LTD	563	67.50	38,002.50
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	442	2.61	1,153.62
WESFARMERS LTD	8,105	31.68	256,766.40
COLES GROUP LTD	8,126	16.14	131,153.64
WOOLWORTHS GROUP LTD	9,174	36.18	331,915.32
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	8.05	41,610.45
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	9.46	66,693.00
COCHLEAR LTD	393	168.00	66,024.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	52.68	74,858.28
SONIC HEALTHCARE LTD	3,109	21.98	68,335.82
CSL LTD	3,310	285.35	944,508.50
AUST AND NZ BANKING GROUP	20,280	14.85	301,158.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	3,272	5.47	17,897.84
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	12,857	57.00	732,849.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	20,617	14.40	296,884.80
WESTPAC BANKING CORP	25,647	14.51	372,137.97
AMP LTD	36,656	1.11	40,688.16
ASX LTD	1,467	70.71	103,731.57

	CHALLENGER LTD	1,796	3.48	6,250.08	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,373	79.90	189,602.70	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	800	34.31	27,448.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,356	5.62	108,780.72	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	16,184	2.73	44,182.32	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	8,615	7.84	67,541.60	
	SUNCORP GROUP LTD	11,553	8.11	93,694.83	
	LENLEASE GROUP	3,479	9.79	34,059.41	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	8.60	48,194.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	13.67	21,872.00	
	TELSTRA CORP LTD	32,785	3.16	103,600.60	
	TPG TELECOM LTD	287	6.94	1,991.78	
	AGL ENERGY LTD	4,361	15.51	67,639.11	
	APA GROUP	7,991	9.30	74,316.30	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.71	2,457.27	
	オーストラリアドル 小計	568,811		7,064,087.26 (467,783,858)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	10,115	3.40	34,391.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	4.94	40,073.28	
	A2 MILK CO LTD	4,552	16.09	73,241.68	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	4,554	30.00	136,620.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	1,597	8.22	13,127.34	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	11,467	3.86	44,262.62	
	MERCURY NZ LTD	7,200	4.10	29,520.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	3.90	36,667.80	
	ニュージーランドドル 小計	56,999		407,903.72 (26,354,659)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	20,000	47.25	945,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	7.52	75,200.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	12,500	46.60	582,500.00	
	MTR CORP	11,000	39.35	432,850.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	500	10.28	5,140.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	16,000	43.90	702,400.00	
	SANDS CHINA LTD	17,400	28.55	496,770.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	6.51	13,020.00	

	WYNN MACAU LTD	5,200	11.94	62,088.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	10,000	20.60	206,000.00	
	VITASOY INTL HOLDINGS LTD	6,000	25.45	152,700.00	
	WH GROUP LTD	91,500	6.60	603,900.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	15.86	57,096.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	27,500	21.05	578,875.00	
	HANG SENG BANK LTD	5,700	130.30	742,710.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	8,800	223.80	1,969,440.00	
	AIA GROUP LTD	88,800	63.90	5,674,320.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	19,000	36.95	702,050.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	13,000	14.40	187,200.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	28.60	397,997.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	18.30	9,150.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	60,000	8.04	482,400.00	
	SINO LAND CO	18,000	8.61	154,980.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	11,700	95.90	1,122,030.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	48.15	202,230.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	19.14	95,700.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	30.25	272,250.00	
	WHEELLOCK & CO LTD	5,400	51.00	275,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	9.96	328,680.00	
	PCCW LTD	4,000	4.05	16,200.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	37.10	163,240.00	
	CLP HOLDINGS LTD	12,500	67.55	844,375.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.33	227,230.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	75,880	12.36	937,876.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	10,500	44.10	463,050.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	69.90	111,840.00	
	香港ドル 小計	669,096		20,293,888.40 (291,014,359)	
シンガポール ドル	KEPPEL CORP LTD	10,700	5.24	56,068.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	800	1.55	1,240.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	2.90	34,800.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	0.81	1,222.50	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	19,100	1.47	28,077.00	

	SATS LTD	1,200	2.73	3,276.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,600	5.89	21,204.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.56	45,652.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	13,200	1.69	22,308.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	17.77	1,777.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	14,100	3.02	42,582.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	13,100	18.21	238,551.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	24,200	8.31	201,102.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	9,200	18.80	172,960.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	5,800	8.59	49,822.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	2.72	57,664.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	6.71	20,130.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.60	13,860.00	
	VENTURE CORP LTD	1,300	13.72	17,836.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	61,700	2.47	152,399.00	
	シンガポールドル 小計	298,700		1,182,530.50 (90,676,438)	
イスラエルシュケル	ISRAEL CHEMICALS LTD	4,122	11.86	48,886.92	
	ELBIT SYSTEMS LTD	113	439.30	49,640.90	
	BANK HAPOALIM BM	9,996	19.63	196,221.48	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	8,833	18.44	162,880.52	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	9.91	74,573.44	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	60.04	84,896.56	
	AZRIELI GROUP	234	191.50	44,811.00	
	NICE SYSTEMS LTD	522	526.00	274,572.00	
	イスラエルシュケル 小計	32,753		936,482.82 (28,796,846)	
	合 計	8,200,819		23,975,988,732 (23,975,988,732)	

(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	53,583.53
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	805	104,255.55
		AMERICAN TOWER CORP	3,226	613,811.02
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	10,034	50,671.70
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	990	126,185.40
		BOSTON PROPERTIES INC	1,074	94,071.66
		CAMDEN PROPERTY TRUST	666	46,773.18
		CROWN CASTLE INTL CORP	3,013	372,738.23
		DIGITAL REALTY TRUST INC	1,890	220,600.80
		DUKE REALTY CORP	2,527	73,308.27
		EQUINIX INC	617	336,814.13
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	76,006.80
		EQUITY RESIDENTIAL	2,637	137,519.55
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	459	86,296.59
		EXTRA SPACE STORAGE INC	890	69,704.80
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	46,941.36
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,403	72,007.48
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	72,303.88
		INVITATION HOMES INC	3,696	67,045.44
		IRON MOUNTAIN INC	2,044	49,056.00
		KIMCO REALTY CORP	3,824	40,113.76
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	3,557	50,616.11
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	784	69,917.12
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	44,337.92
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	58,809.20
		PROLOGIS INC	5,332	376,172.60
		PUBLIC STORAGE	1,125	189,731.25
		REALTY INCOME CORP	2,265	114,767.55
		REGENCY CENTERS CORP	1,514	59,727.30
		SBA COMMUNICATIONS CORP	806	195,245.44
		SIMON PROPERTY GROUP INC	2,132	116,684.36
		SL GREEN REALTY CORP	468	22,056.84
SUN COMMUNITIES INC	788	85,466.48		
UDR INC	2,015	62,283.65		
VENTAS INC	2,562	65,843.40		

	VEREIT INC	11,100	49,395.00
	VICI PROPERTIES INC	3,169	41,545.59
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	42,680.10
	WELLTOWER INC	2,815	127,716.55
	WEYERHAEUSER CO	5,136	86,695.68
	WP CAREY INC	1,458	76,749.12
	米ドル 小計	107,380	4,746,250.39 (527,593,193)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	38,000.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	22,678.93
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	114	930.24
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	22,491.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	865.49
	カナダドル 小計	4,548	84,965.66 (6,531,310)
ユーロ	COVIVIO	522	30,249.90
	GECINA SA	298	35,164.00
	ICADE	30	2,067.00
	KLEPIERRE	1,289	28,164.65
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	78,936.00
	ユーロ 小計	3,335	174,581.55 (20,937,565)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	21,169.53
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	40,738.94
	SEGRO PLC	9,145	70,471.37
	英ポンド 小計	21,530	132,379.84 (17,320,578)
オーストラリアドル	DEXUS	6,879	60,535.20
	GOODMAN GROUP	11,045	125,692.10
	GPT GROUP	15,542	55,174.10
	MIRVAC GROUP	32,387	58,296.60
	SCENTRE GROUP	32,385	46,310.55
	STOCKLAND	14,697	29,247.03
	VICINITY CENTRES	42,168	43,011.36
	オーストラリアドル 小計	155,103	418,266.94 (27,697,636)



香港ドル	LINK REIT	15,300	985,320.00	
香港ドル 小計		15,300	985,320.00	(14,129,488)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	24,200	59,532.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	37,230.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	22,000	37,400.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	38,640.00	
	SUNTEC REIT	8,500	9,945.00	
シンガポールドル 小計		103,200	182,747.00	(14,013,039)
合計			628,222,809	(628,222,809)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 608銘柄	97.0%		68.9%
	投資証券 41銘柄		3.0%	2.1%
カナダドル	株式 84銘柄	99.2%		3.3%
	投資証券 5銘柄		0.8%	0.0%
ユーロ	株式 236銘柄	99.2%		10.9%
	投資証券 5銘柄		0.8%	0.1%
英ポンド	株式 93銘柄	98.6%		5.1%
	投資証券 3銘柄		1.4%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.7%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%		0.9%
ノルウェークローネ	株式 10銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	100.0%		0.7%
オーストラリアドル	株式 62銘柄	94.4%		1.9%
	投資証券 7銘柄		5.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 36銘柄	95.4%		1.2%

	投資証券	1銘柄		4.6%	0.1%
シンガポールドル	株式	20銘柄	86.6%		0.4%
	投資証券	5銘柄		13.4%	0.1%
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 3月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	367,134,159
金銭信託	829,402,382
株式	3,934,674,909
投資証券	4,658,328
派生商品評価勘定	52,415,481
未収入金	837,534,621
未収配当金	7,359,747
差入委託証拠金	325,514,608
流動資産合計	6,358,694,235
資産合計	
6,358,694,235	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,395,176
未払解約金	1,194,014,234
その他未払費用	6,162
流動負債合計	1,196,415,572
負債合計	
1,196,415,572	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	5,120,363,642
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	41,915,021

2020年 3月25日現在

元本等合計	5,162,278,663
純資産合計	5,162,278,663
負債純資産合計	6,358,694,235

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <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	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	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2020年 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	4,572,442,524円
期中追加設定元本額	8,628,861,941円
期中一部解約元本額	8,080,940,823円

期末元本額	5,120,363,642円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	570,530,999円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	647,194,092円
りそなラップ型ファンド(成長型)	769,074,540円
DCりそな グローバルバランス	10,419,605円
つみたてバランスファンド	246,172,316円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	215,654,353円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	97,994,252円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	56,073,448円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,013,887円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,750,003円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	880,702円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,014,448円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	29,212,027円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,641,476,467円
Smart-i 新興国株式インデックス	671,419,548円
Smart-i 8資産バランス 安定型	21,286,920円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	61,999,724円
Smart-i 8資産バランス 成長型	72,669,993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)	526,318円
2. 計算日における受益権の総数	5,120,363,642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	1.0082円
(10,000口当たり純資産額)	(10,082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 3月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25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 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		1,252,178,886
投資証券		5,084,401
合計		1,257,263,287

(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 3月25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	1,356,126,433	-	1,408,386,084	52,259,651
	合計	1,356,126,433	-	1,408,386,084	52,259,651

(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 3月25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	171,082,053	-	171,021,933	60,120
	米ドル	617,555	-	598,004	19,551
	メキシコペソ	1,742,091	-	1,735,500	6,591
	トルコリラ	773,572	-	773,550	22
	ハンガリーフォリント	429,615	-	428,879	736
	ポーランドズロチ	1,040,920	-	1,040,400	520
	香港ドル	161,676,240	-	161,642,400	33,840
	南アフリカランド	4,802,060	-	4,803,200	1,140
	売建	286,129,488	-	288,308,714	2,179,226
	米ドル	269,977,510	-	271,959,580	1,982,070
	メキシコペソ	8,323,710	-	8,455,000	131,290
	ユーロ	2,146,302	-	2,158,380	12,078

	トルコリラ	1,682,700	-	1,721,000	38,300
	チェココルナ	299,540	-	301,700	2,160
	ハンガリーフォリント	702,208	-	702,416	208
	ポーランドズロチ	1,443,288	-	1,457,120	13,832
	インドネシアルピア	421,268	-	409,231	12,037
	インドルピー	196,287	-	196,287	-
	南アフリカランド	936,675	-	948,000	11,325
	合計	457,211,541	-	459,330,647	2,239,346

## (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	GAZPROM PAO -SPON ADR	42,102	4.59	193,248.18	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.66	5,453.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	3,326	57.58	191,511.08	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	807	109.70	88,527.90	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	10,217	3.86	39,488.70	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	8,010	3.68	29,476.80	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,078	43.06	89,478.68	

YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	3.93	7,467.00
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	1,390	7.50	10,425.00
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	5.76	18,144.00
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	5,074	24.85	126,088.90
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,951	15.04	29,343.04
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,201	10.20	12,250.20
POLYUS PJSC-REG S-GDR	493	62.50	30,812.50
SEVERSTAL - GDR REG S	1,901	10.84	20,606.84
SOUTHERN COPPER CORP	585	26.57	15,543.45
51JOB INC-ADR	200	58.00	11,600.00
BEST INC - ADR	1,500	5.00	7,500.00
DP WORLD PLC	1,903	15.01	28,564.03
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	2,400	24.52	58,848.00
NIO INC - ADR	5,000	2.60	13,000.00
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,000	28.95	28,950.00
LUCKIN COFFEE INC - ADR	600	27.45	16,470.00
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,050	117.70	123,585.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	2,900	52.96	153,584.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	2,750	42.90	117,975.00
58.COM INC-ADR	760	49.22	37,407.20
AUTOHOME INC-ADR	420	68.56	28,795.20
BAIDU INC - SPON ADR	2,050	96.43	197,681.50
HUYA INC-ADR	500	14.18	7,090.00
IQIYI INC-ADR	1,000	18.71	18,710.00
JOYY INC	420	50.86	21,361.20
MOMO INC-SPON ADR	1,150	22.61	26,001.50
NETEASE INC-ADR	582	323.83	188,469.06
SINA CORP	430	31.86	13,699.80
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	1,000	9.94	9,940.00
WEIBO CORP-SPON ADR	430	35.44	15,239.20
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	13,330	185.75	2,476,047.50
BAOZUN INC-SPN ADR	300	26.00	7,800.00
JD.COM INC-ADR	5,620	41.01	230,476.20
PINDUODUO INC-ADR	1,500	36.05	54,075.00
TRIP.COM GROUP LTD	3,550	23.52	83,496.00



	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	3,300	15.25	50,325.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	3,188	8.40	26,779.20	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,056	25.54	26,970.24	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	18.19	10,914.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	300	51.03	15,309.00	
	BANCO MACRO SA-ADR	450	16.82	7,569.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	12,261	3.96	48,614.86	
	CREDICORP LTD	544	128.25	69,768.00	
	GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	1,210	7.27	8,796.70	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	21,206	9.90	209,939.40	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.84	18,576.73	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	200	22.68	4,536.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.74	7,539.84	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	500	53.51	26,755.00	
	GLOBANT SA	240	84.78	20,347.20	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	4,200	6.92	29,064.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	8.38	7,290.60	
	米ドル 小計	227,037		5,473,325.43 (608,414,854)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	115,100	4.47	514,497.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	25,800	39.65	1,022,970.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	170.72	234,740.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	7,800	25.68	200,304.00	
	ALFA S.A.B. -A	22,600	7.51	169,726.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	54.81	186,354.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	2,700	127.01	342,927.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	1,570	234.40	368,008.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	1,750	151.73	265,527.50	
	ALSEA SAB DE CV	6,000	15.16	90,960.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	18,200	29.48	536,536.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	62.63	137,786.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	2,100	66.06	138,726.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	40,100	53.47	2,144,147.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	3,200	99.22	317,504.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	3,900	96.63	376,857.00	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	14,800	149.36	2,210,528.00	
	GRUMA S.A.B. -B	1,505	186.69	280,968.45	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	11,900	31.99	380,681.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	11,400	31.74	361,836.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	19,900	69.40	1,381,060.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	17,800	15.36	273,408.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	257,100	14.80	3,805,080.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	4,100	66.47	272,527.00	
	メキシコペソ 小計	596,300		16,013,657.95 (71,420,914)	
ブラジルリアル	COSAN SA	1,200	52.90	63,480.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	28,400	13.47	382,548.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	32,100	13.25	425,325.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	5,600	11.97	67,032.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	11.40	26,220.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	5.80	42,340.00	
	GERDAU SA-PREF	8,300	9.52	79,016.00	
	KLABIN SA - UNIT	5,300	13.39	70,967.00	
	SUZANO SA	4,107	28.90	118,692.30	
	VALE SA	24,000	37.64	903,360.00	
	EMBRAER SA	5,300	9.05	47,965.00	
	WEG SA	6,450	36.06	232,587.00	
	CCR SA	9,200	11.88	109,296.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	4,610	27.18	125,299.80	
	RUMO SA	8,300	19.01	157,783.00	
	COGNA EDUCACAO	13,300	4.48	59,584.00	
	B2W CIA DIGITAL	1,600	54.80	87,680.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	5,700	19.29	109,953.00	
	LOJAS RENNER S.A.	6,100	32.99	201,239.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	5,600	36.68	205,408.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	5,300	14.90	78,970.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	21.80	65,400.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,200	72.00	86,400.00	
	RAIA DROGASIL SA	1,800	108.22	194,796.00	
	AMBEV SA	35,900	11.29	405,311.00	

	BRF SA	4,100	15.04	61,664.00	
	JBS SA	8,200	21.22	174,004.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	4,900	24.90	122,010.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	1,700	42.30	71,910.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	3,700	44.30	163,910.00	
	HYPERA SA	2,800	28.97	81,116.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	9,200	17.89	164,588.00	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	30,900	20.33	628,197.00	
	BANCO DO BRASIL S.A.	6,600	25.92	171,072.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	3,000	27.57	82,710.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	37,100	22.50	834,750.00	
	ITAUSA- INVESTIMENTOS ITAU-PR	33,900	8.07	273,573.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	15,800	36.31	573,698.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	1,800	32.59	58,662.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	5,300	24.71	130,963.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,200	8.18	42,536.00	
	PORTO SEGURO SA	700	46.58	32,606.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	2,200	32.61	71,742.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,000	8.94	53,640.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	20.54	45,188.00	
	CIELO SA	11,700	4.05	47,385.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	3,400	47.92	162,928.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	6,400	12.20	78,080.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,000	20.49	40,980.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	2,000	17.35	34,700.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	7,100	8.40	59,640.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	2,600	32.10	83,460.00	
	ENERGISA SA-UNITS	1,300	35.35	45,955.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	1,575	37.77	59,487.75	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	6,600	16.84	111,144.00	
	ブラジルリアル 小計	461,942		8,908,950.85 (194,126,039)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	2,843	4,100.00	11,656,300.00	
	EMPRESAS CMPC SA	7,941	1,328.50	10,549,618.50	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	817	15,750.00	12,867,750.00	

	LATAM AIRLINES GROUP SA	2,961	1,950.00	5,773,950.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	5,224	1,530.00	7,992,720.00	
	CENCOSUD SA	13,424	613.04	8,229,448.96	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	893	5,010.00	4,473,930.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,580.00	4,503,000.00	
	BANCO DE CHILE	565,470	57.01	32,237,444.70	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	353	23,349.00	8,242,197.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	481,249	26.75	12,873,410.75	
	ITAU CORPBANCA	1,880,000	1.80	3,393,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,001	3,200.00	3,203,200.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	206.10	3,711,036.60	
	COLBUN SA	83,944	81.10	6,807,858.40	
	ENEL AMERICAS SA	284,519	94.50	26,887,045.50	
	ENEL CHILE SA	200,172	53.38	10,685,181.36	
	チリペソ 小計	3,551,667		174,087,491.77	(22,875,096)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	37,116	1,615.00	59,942,340.00	
	GRUPO ARGOS SA	2,900	8,000.00	23,200,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	1,642	17,700.00	29,063,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	3,341	21,300.00	71,163,300.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA -PF	43,000	700.00	30,100,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	16,000.00	41,408,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	3,390	13,320.00	45,154,800.00	
	コロンビアペソ 小計	93,977		300,031,840.00	(8,160,866)
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	11.56	9,063.04	
	TITAN CEMENT INTERNATIONAL T	370	11.00	4,070.00	
	OPAP SA	1,335	6.57	8,777.62	
	JUMBO SA	765	11.43	8,743.95	
	ALPHA BANK AE	9,838	0.60	5,922.47	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	18,422	0.34	6,300.32	
	NATIONAL BANK OF GREECE	6,654	0.92	6,154.95	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	1,834	11.87	21,769.58	
	ユーロ 小計	40,002		70,801.93	(8,491,275)

トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	917	73.85	67,720.45	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	10,581	8.01	84,753.81	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	2,580	22.84	58,927.20	
	KOC HOLDING AS	5,754	13.47	77,506.38	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	15.64	23,460.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	8.29	45,595.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	48.50	25,753.50	
	ARCELIK AS	1,000	13.05	13,050.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	3,240	53.25	172,530.00	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	18.20	34,944.00	
	AKBANK T.A.S.	21,653	5.73	124,071.69	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	16,862	7.58	127,813.96	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	4.82	58,322.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	7,059	7.59	53,577.81	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	8,232	13.30	109,485.60	
トルコリラ 小計		99,429		1,077,511.40	(18,565,521)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	510.00	381,990.00	
	MONETA MONEY BANK AS	3,886	53.75	208,872.50	
	CEZ AS	1,247	420.00	523,740.00	
チェココルナ 小計		5,882		1,114,602.50	(4,815,082)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,029	2,000.00	6,058,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,047	5,795.00	6,067,365.00	
	OTP BANK PLC	1,639	9,380.00	15,373,820.00	
ハンガリーフォリント 小計		5,715		27,499,185.00	(9,289,224)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	682	43.86	29,912.52	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,260	50.10	113,226.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	12,790	3.07	39,342.04	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,025	58.44	59,901.00	
	CCC SA	371	29.06	10,781.26	
	LPP SA	9	5,400.00	48,600.00	
	AMREST HOLDINGS SE	830	18.98	15,753.40	
	CD PROJEKT SA	505	276.60	139,683.00	

	CYFROWY POLSAT SA	1,849	24.42	45,152.58	
	DINO POLSKA SA	360	149.30	53,748.00	
	BANK MILLENNIUM SA	8,345	3.35	27,955.75	
	BANK PEKAO SA	1,272	54.50	69,324.00	
	MBANK SA	165	225.00	37,125.00	
	PKO BANK POLSKI SA	6,626	22.31	147,826.06	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	175.20	46,428.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	4,529	28.90	130,888.10	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	5.99	28,147.01	
	PGE SA	9,929	3.79	37,690.48	
	ポーランドズロチ 小計	56,511		1,081,484.20	(28,151,033)
香港ドル	CHINA COAL ENERGY CO-H	16,000	2.03	32,480.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	5.32	63,840.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	196,000	3.42	670,320.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	26,000	13.14	341,640.00	
	CNOOC LTD	137,000	7.12	975,440.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.04	30,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	162,000	2.45	396,900.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	5.48	76,720.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	1.51	45,300.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	9,500	51.90	493,050.00	
	BBMG CORP-H	25,000	1.87	46,750.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	3.07	39,910.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	27,000	2.11	56,970.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	28,000	8.10	226,800.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	18,000	8.52	153,360.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDINGS LTD	17,200	2.51	43,172.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	9,000	6.71	60,390.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	4.51	45,100.00	
	MAANSHAN IRON & STEEL-H	6,000	2.51	15,060.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	12,000	6.51	78,120.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	1.75	59,500.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	8,000	7.69	61,520.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	44,000	2.75	121,000.00	

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	2.80	72,800.00	
BOC AVIATION LTD	2,200	41.05	90,310.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	34,000	5.05	171,700.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	18,000	4.95	89,100.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	12,500	33.40	417,500.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	8,000	9.21	73,680.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	15,000	7.61	114,150.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	29,000	3.55	102,950.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	16,000	4.38	70,080.00	
CITIC LTD	44,000	8.28	364,320.00	
CRRC CORP LTD - H	33,000	3.73	123,090.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	19,500	8.20	159,900.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	5,000	13.32	66,600.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	32,000	1.32	42,240.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	1.92	38,400.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	11.36	45,440.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	2.82	49,350.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	5,000	12.28	61,400.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	15,000	12.42	186,300.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	6.31	37,860.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	4,100	21.70	88,970.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	10,400	5.36	55,744.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	3,250	35.10	114,075.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	27,000	4.01	108,270.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	9,000	29.35	264,150.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	8.47	84,700.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	4.97	89,460.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	12,000	4.93	59,160.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	2.59	36,260.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	10,000	8.58	85,800.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	12,000	3.06	36,720.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	18,500	2.08	38,480.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	3.42	61,560.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	8.10	97,200.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	7.66	30,640.00	

SHENZHEN INTL HOLDINGS	7,500	13.88	104,100.00
SINOTRANS LIMITED-H	15,000	1.69	25,350.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	10,000	4.95	49,500.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	2.74	34,250.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	24,000	5.64	135,360.00
BYD CO LTD-H	5,000	35.35	176,750.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	20,000	4.91	98,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	16.30	84,760.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	38,000	11.16	424,080.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	23,500	4.31	101,285.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	22,000	7.56	166,320.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	11,000	3.60	39,600.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	8,000	53.65	429,200.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	1.68	40,320.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	10,000	19.12	191,200.00
LI NING CO LTD	15,000	18.54	278,100.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	5,800	73.50	426,300.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	12.02	72,120.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	4,000	9.14	36,560.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	3,000	30.55	91,650.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.00	140,000.00
CHINA LITERATURE LTD	1,800	30.70	55,260.00
TENCENT HOLDINGS LTD	43,900	365.20	16,032,280.00
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	72,000	0.69	49,680.00
MEITUAN DIANPING-CLASS B	7,700	85.50	658,350.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	9,000	7.77	69,930.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	4,500	26.85	120,825.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	18,000	11.16	200,880.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	21,000	26.20	550,200.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	12,000	33.80	405,600.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	14,500	4.84	70,180.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	14,000	13.52	189,280.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	37.75	75,500.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	9,000	6.75	60,750.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	37,000	5.15	190,550.00



YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	4,000	49.80	199,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	5,500	56.60	311,300.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	28,000	11.76	329,280.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	2,500	64.15	160,375.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	16,000	9.11	145,760.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,400	11.96	76,544.00
SINOPHARM GROUP CO-H	10,400	17.26	179,504.00
3SBIO INC	13,000	6.85	89,050.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	10,000	8.04	80,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.38	48,180.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.34	80,160.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	36,000	15.12	544,320.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	6,000	11.06	66,360.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	4,000	25.40	101,600.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	7,000	28.75	201,250.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	8,000	4.09	32,720.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	4,000	22.00	88,000.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	52,500	10.44	548,100.00
SSY GROUP LTD	10,000	5.23	52,300.00
WUXI APPTec CO LTD-H	1,160	93.00	107,880.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	6,000	96.55	579,300.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	224,000	2.94	658,560.00
BANK OF CHINA LTD-H	608,000	2.88	1,751,040.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	67,000	4.57	306,190.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	69,000	3.71	255,990.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	737,000	6.27	4,620,990.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	24,000	2.77	66,480.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	30,000	33.45	1,003,500.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	54,100	5.37	290,517.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.04	54,720.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	499,000	5.16	2,574,840.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	61,000	5.01	305,610.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	68,000	1.41	95,880.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	10.32	82,560.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	27,000	3.60	97,200.00

CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.97	99,910.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	10,400	12.18	126,672.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	15,500	13.96	216,380.00
FAR EAST HORIZON LTD	17,000	5.41	91,970.00
GF SECURITIES CO LTD-H	10,400	7.94	82,576.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	10.62	80,712.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	22,400	7.07	158,368.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	12,600	10.80	136,080.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	57,000	14.16	807,120.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	20,000	20.75	415,000.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.88	48,400.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	12,200	12.18	148,596.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	6,200	22.45	139,190.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	63,000	2.23	140,490.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	52,000	6.79	353,080.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	42,500	73.50	3,123,750.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	2,300	24.40	56,120.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	10,000	7.65	76,500.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	9,000	8.25	74,250.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	14,000	10.28	143,920.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	40,000	4.90	196,000.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	30,000	23.00	690,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	24,000	30.20	724,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	11,500	24.25	278,875.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	20,000	4.69	93,800.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	58,000	8.41	487,780.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	9,600	9.07	87,072.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	18,000	2.38	42,840.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	9,500	8.95	85,025.00
LOGAN PROPERTY HOLDINGS CO L	10,000	10.24	102,400.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	13,500	33.15	447,525.00
SEAZEN GROUP LTD	16,000	6.20	99,200.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.15	51,600.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	9,000	22.85	205,650.00
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.19	33,320.00

SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	2.09	48,070.00
SOHO CHINA LTD	12,000	3.43	41,160.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	19,000	34.85	662,150.00
WHARF HOLDINGS LTD	8,000	13.16	105,280.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	52,000	1.35	70,200.00
YUZHOU PROPERTIES CO	14,000	2.87	40,180.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.57	54,840.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	18,000	10.32	185,760.00
KINGSOFT CORP LTD	6,000	22.00	132,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	13.34	120,060.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	5,500	38.55	212,025.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,000	11.62	58,100.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	3.39	50,850.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	5,000	17.82	89,100.00
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	8,000	6.70	53,600.00
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	9.60	32,640.00
LENOVO GROUP LTD	54,000	3.72	200,880.00
SUNNY OPTICAL TECH	5,400	103.40	558,360.00
XIAOMI CORP-CLASS B	79,800	10.00	798,000.00
ZTE CORP-H	5,800	22.80	132,240.00
CHINA MOBILE LTD	47,000	56.60	2,660,200.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	106,000	2.28	241,680.00
CHINA TOWER CORP LTD-H	320,000	1.66	531,200.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	46,000	4.50	207,000.00
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	4,000	26.60	106,400.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	38,000	2.87	109,060.00
CGN POWER CO LTD-H	82,000	1.60	131,200.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	14,000	25.60	358,400.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	24,000	3.76	90,240.00
CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.28	75,520.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	8,000	40.10	320,800.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	14,000	7.76	108,640.00
DATANG INTL POWER GEN CO-H	32,000	1.00	32,000.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	6,100	69.10	421,510.00
GUANGDONG INVESTMENT LTD	22,000	13.40	294,800.00

	HUADIAN POWER INTL CORP-H	20,000	2.03	40,600.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	30,000	2.57	77,100.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	26,000	3.42	88,920.00	
	TOWNGAS CHINA CO LTD	11,000	3.60	39,600.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	3,000	13.18	39,540.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	22,500	12.12	272,700.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	30,000	4.15	124,500.00	
	香港ドル 小計	7,030,810		65,984,107.00 (946,212,094)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	27,500	2.93	80,575.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	19.40	56,260.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	18,100	4.30	77,830.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	10,500	2.95	30,975.00	
	GAMUDA BHD	12,900	2.60	33,540.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	4,600	7.50	34,500.00	
	IJM CORP BHD	20,200	1.38	27,876.00	
	SIME DARBY BERHAD	20,300	1.71	34,713.00	
	AIRASIA GROUP BHD	22,600	0.63	14,238.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	7,400	4.29	31,746.00	
	MISC BHD	10,100	7.60	76,760.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.12	21,216.00	
	GENTING BHD	15,800	3.26	51,508.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	21,900	1.85	40,515.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	21.50	21,500.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,000	30.00	30,000.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.15	27,450.00	
	IOI CORP BHD	13,600	3.66	49,776.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	3,100	18.70	57,970.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	500	134.50	67,250.00	
	PPB GROUP BERHAD	4,220	15.92	67,182.40	
	QL RESOURCES BHD	4,600	6.96	32,016.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	15,100	4.65	70,215.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	13,600	6.60	89,760.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	16,800	4.92	82,656.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	11,800	6.11	72,098.00	

	AMMB HOLDINGS BHD	12,700	2.91	36,957.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	38,000	3.44	130,720.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	5,000	14.20	71,000.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	13.00	23,400.00	
	MALAYAN BANKING BHD	30,100	7.30	219,730.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	23,800	15.24	362,712.00	
	RHB BANK BHD	12,300	5.00	61,500.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	20,500	3.27	67,035.00	
	DIGI.COM BHD	23,300	4.00	93,200.00	
	MAXIS BHD	17,600	5.17	90,992.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	3.50	28,350.00	
	PETRONAS GAS BHD	6,100	14.90	90,890.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	23,900	11.82	282,498.00	
	YTL CORP BHD	19,380	0.66	12,790.80	
	マレーシアリングット 小計	532,500		2,851,900.20	(71,497,138)
タイパーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	53,000	4.92	260,760.00	
	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.00	275,400.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	10,300	59.25	610,275.00	
	PTT PCL-NVDR	84,600	29.00	2,453,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	8,200	28.25	231,650.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	17.20	283,800.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	16,300	25.50	415,650.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	6,000	289.00	1,734,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	32,300	48.00	1,550,400.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	55,500	6.70	371,850.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	52,200	8.25	430,650.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	20,100	13.70	275,370.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	13,225	21.00	277,725.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	44,000	9.35	411,400.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	8,800	37.75	332,200.00	
	CP ALL PCL-NVDR	44,700	59.00	2,637,300.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	28,900	22.50	650,250.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	33.00	214,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	14.20	343,640.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	71,900	17.80	1,279,820.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	3,300	126.00	415,800.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	90.75	372,075.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,300	79.00	1,050,700.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.20	255,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	6,300	59.00	371,700.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	0.70	150,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	4,400	31.00	136,400.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	5,400	36.00	194,400.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	16,800	34.25	575,400.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	66,300	6.00	397,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	9,000	194.00	1,746,000.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	45.75	841,800.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	3,100	34.25	106,175.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	2.90	246,790.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	5,800	37.50	217,500.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	2,200	199.00	437,800.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	12,500	32.50	406,250.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	5,200	53.25	276,900.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	4,100	142.00	582,200.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	3,200	52.25	167,200.00	
	タイパーツ 小計	1,243,425		23,988,430.00	(81,080,893)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	14,160	29.50	417,720.00	
	AYALA CORPORATION	2,100	439.60	923,160.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	389.00	272,300.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	21,320	45.70	974,324.00	
	SM INVESTMENTS CORP	1,805	747.50	1,349,237.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	7,270	66.05	480,183.50	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	95.00	427,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	6,300	95.05	598,815.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	52.00	344,760.00	
	BDO UNIBANK INC	14,910	94.00	1,401,540.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	35.30	469,913.60	
	SECURITY BANK CORP	1,400	103.60	145,040.00	

	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	2.33	337,850.00	
	AYALA LAND INC	55,400	29.10	1,612,140.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	1.99	195,020.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	12.20	298,900.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	76,400	25.50	1,948,200.00	
	GLOBE TELECOM INC	250	1,816.00	454,000.00	
	PLDT INC	640	921.00	589,440.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	23.45	375,200.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,660	208.00	345,280.00	
	フィリピンベソ 小計	512,257		13,960,523.60 (30,433,941)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	850.00	128,265,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	40,000	1,790.00	71,600,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	12,700	13,975.00	177,482,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	190,000	456.00	86,640,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	3,100.00	83,390,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	10,350.00	137,655,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA PT	15,000	3,750.00	56,250,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	21,500	6,125.00	131,687,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	18,500	2,340.00	43,290,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	153,300	3,280.00	502,824,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,100.00	55,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	53,300	3,830.00	204,139,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	3,300	36,400.00	120,120,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,290.00	117,519,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	27,300	8,300.00	226,590,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	31,200	5,050.00	157,560,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	56,600	5,675.00	321,205,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	147,500	865.00	127,587,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	75,300	22,500.00	1,694,250,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	142,100	3,860.00	548,506,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	86,900	3,160.00	274,604,000.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	423,700	2,440.00	1,033,828,000.00		
BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	26,000	820.00	21,320,000.00		
BUMI SERPONG DAMAI PT	66,000	595.00	39,270,000.00		

	PAKUWON JATI TBK PT	112,200	268.00	30,069,600.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	376,200	2,620.00	985,644,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	1,410.00	39,480,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	605.00	79,557,500.00	
	インドネシアルピア 小計	2,570,300		7,495,333,600.00 (50,968,268)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	34,900.00	17,101,000.00	
	S-OIL CORP	338	51,400.00	17,373,200.00	
	SK INNOVATION CO LTD	403	72,000.00	29,016,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	771	10,350.00	7,979,850.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	15,100.00	11,883,700.00	
	KCC CORP	54	114,000.00	6,156,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	60	337,000.00	20,220,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	54,600.00	11,902,800.00	
	LG CHEM LTD	344	288,000.00	99,072,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	53	127,500.00	6,757,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	126	149,000.00	18,774,000.00	
	OCI CO LTD	198	30,150.00	5,969,700.00	
	POSCO	583	145,500.00	84,826,500.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	161	39,850.00	6,415,850.00	
	CJ CORP	106	59,900.00	6,349,400.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	207	56,000.00	11,592,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	1,310	2,485.00	3,255,350.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	11,550.00	5,936,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	15,450.00	8,961,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	439	17,350.00	7,616,650.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	279	14,250.00	3,975,750.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	581	21,950.00	12,752,950.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	73	175,500.00	12,811,500.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	540	17,800.00	9,612,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	293	73,900.00	21,652,700.00		
LG CORP	720	51,700.00	37,224,000.00		
LOTTE CORP	242	22,200.00	5,372,400.00		
POSCO INTERNATIONAL CORP	500	9,360.00	4,680,000.00		
SAMSUNG C&T CORP	649	83,700.00	54,321,300.00		



SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	7,790.00	12,495,160.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	3,282	3,380.00	11,093,160.00	
SK HOLDINGS CO LTD	266	134,000.00	35,644,000.00	
S-1 CORPORATION	120	76,100.00	9,132,000.00	
CJ LOGISTICS	65	132,000.00	8,580,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	139	80,300.00	11,161,700.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	341	15,000.00	5,115,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	2,600.00	8,520,200.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	552	17,050.00	9,411,600.00	
HANON SYSTEMS	1,394	8,970.00	12,504,180.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	509	144,500.00	73,550,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,141	74,800.00	85,346,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	273	49,150.00	13,417,950.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	44,200.00	7,514,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,005	23,100.00	46,315,500.00	
COWAY CO LTD	391	50,000.00	19,550,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	364	20,850.00	7,589,400.00	
HLB INC	254	85,800.00	21,793,200.00	
LG ELECTRONICS INC	810	44,400.00	35,964,000.00	
KANGWON LAND INC	869	18,250.00	15,859,250.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	499	12,450.00	6,212,550.00	
KAKAO CORP	393	154,500.00	60,718,500.00	
NAVER CORP	1,070	156,000.00	166,920,000.00	
NCSOFT CORP	125	649,000.00	81,125,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	193	94,400.00	18,219,200.00	
PEARL ABYSS CORP	70	165,700.00	11,599,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	91,100.00	10,294,300.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	233	64,800.00	15,098,400.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	100	55,400.00	5,540,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	62,000.00	4,960,000.00	
SHINSEGAE INC	54	220,500.00	11,907,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	122,000.00	6,954,000.00	
E-MART INC	157	103,500.00	16,249,500.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	27,150.00	5,294,250.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	59	191,000.00	11,269,000.00	

KT&G CORP	881	67,700.00	59,643,700.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	173	97,300.00	16,832,900.00	
OTTOGI CORPORATION	13	459,500.00	5,973,500.00	
AMOREPACIFIC CORP	242	171,000.00	41,382,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	209	46,950.00	9,812,550.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	71	1,144,000.00	81,224,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	636,000.00	9,540,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	403	68,100.00	27,444,300.00	
CELLTRION INC	716	184,000.00	131,744,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	46	229,500.00	10,557,000.00	
HELIXMITH CO LTD	132	61,000.00	8,052,000.00	
MEDY-TOX INC	47	160,000.00	7,520,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	124	476,000.00	59,024,000.00	
YUHAN CORP	67	200,500.00	13,433,500.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	3,830.00	9,747,350.00	
HANA FINANCIAL GROUP	2,294	19,200.00	44,044,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	6,680.00	17,307,880.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	2,970	29,150.00	86,575,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	3,504	23,950.00	83,920,800.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	4,092	6,950.00	28,439,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	317	38,450.00	12,188,650.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	2,330.00	5,398,610.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	4,170.00	12,497,490.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	6,950.00	10,703,000.00	
SAMSUNG CARD CO	217	25,950.00	5,631,150.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	474	23,350.00	11,067,900.00	
DB INSURANCE CO LTD	482	28,800.00	13,881,600.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	4,123	982.00	4,048,786.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	18,550.00	8,366,050.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	232	145,000.00	33,640,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	521	38,550.00	20,084,550.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	266	146,000.00	38,836,000.00	
KMW CO LTD	187	50,500.00	9,443,500.00	
LG DISPLAY CO LTD	1,734	10,250.00	17,773,500.00	
LG INNOTEK CO LTD	103	107,500.00	11,072,500.00	

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	424	99,000.00	41,976,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	36,561	46,950.00	1,716,538,950.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	6,289	39,150.00	246,214,350.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	419	246,500.00	103,283,500.00	
	LG UPLUS CORP	1,577	9,850.00	15,533,450.00	
	SK TELECOM	151	171,000.00	25,821,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	1,961	18,650.00	36,572,650.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	19,350.00	4,353,750.00	
	SK HYNIX INC	4,168	78,700.00	328,021,600.00	
	韓国ウォン 小計	121,714		4,917,647,816.00 (442,588,303)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	10,000	77.40	774,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	17,000	39.00	663,000.00	
	CHINA STEEL CORP	90,000	19.05	1,714,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	27,000	65.20	1,760,400.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	34,000	70.50	2,397,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	39,000	51.70	2,016,300.00	
	TAIWAN CEMENT	38,121	38.25	1,458,128.25	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	382.00	382,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	25,000	21.35	533,750.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,111	192.50	406,367.50	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	6.38	108,460.00	
	EVA AIRWAYS CORP	26,023	8.63	224,578.49	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	9.44	297,832.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	15,000	28.90	433,500.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	15,000	30.70	460,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	1,020	221.00	225,420.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	120.50	409,700.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	29.85	298,500.00	
	GIANT MANUFACTURING	3,000	127.50	382,500.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	176.50	176,500.00	
	POU CHEN	17,000	24.05	408,850.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	2,400	65.80	157,920.00	
	TATUNG CO LTD	15,000	18.15	272,250.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	2,000	396.00	792,000.00	

PRESIDENT CHAIN STORE CORP	4,000	267.00	1,068,000.00	
STANDARD FOODS CORP	3,120	56.60	176,592.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	37,000	66.60	2,464,200.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	40,554	19.25	780,664.50	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	141,000	16.60	2,340,600.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	78,425	22.55	1,768,483.75	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	75,551	18.60	1,405,248.60	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	59,778	17.50	1,046,115.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	83,000	27.35	2,270,050.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	81,995	10.35	848,648.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	73,785	11.05	815,324.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	42,545	9.30	395,668.50	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	67,626	17.40	1,176,692.40	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	25,000	38.70	967,500.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	9,536	87.10	830,585.60	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	77,000	15.20	1,170,400.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	60,000	34.65	2,079,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	97,000	7.26	704,220.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	15.75	414,540.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	51,000	36.25	1,848,750.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	81,835	7.33	599,850.55	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	36.85	221,100.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	31.45	198,764.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	4,000	144.00	576,000.00	
ACER INC	22,000	13.55	298,100.00	
ADVANTECH CO LTD	3,000	242.00	726,000.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	5,000	178.00	890,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	6.19	532,340.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	5,000	191.50	957,500.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	71.10	356,566.50	
COMPAL ELECTRONICS	32,000	16.40	524,800.00	
DELTA ELECTRONICS INC	15,000	115.00	1,725,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	48.75	341,250.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	95,800	69.40	6,648,520.00	
INNOLUX CORP	63,000	5.00	315,000.00	

	INVENTEC CORP	19,000	21.00	399,000.00	
	LARGAN PRECISION CO LTD	500	3,665.00	1,832,500.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	16,000	39.35	629,600.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	5,000	76.80	384,000.00	
	PEGATRON CORP	15,000	51.90	778,500.00	
	QUANTA COMPUTER INC	21,000	57.30	1,203,300.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	34.35	343,500.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	159.00	477,000.00	
	WISTRON CORP	21,951	21.10	463,166.10	
	WIWYNN CORP	1,000	668.00	668,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	11,960	33.50	400,660.00	
	YAGEO CORPORATION	2,198	274.00	602,252.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	4,000	81.10	324,400.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	29,000	107.00	3,103,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	12,000	61.40	736,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	13,000	98.70	1,283,100.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	26,000	54.30	1,411,800.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	334.50	669,000.00	
	MEDIATEK INC	12,000	330.00	3,960,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	9,000	48.30	434,700.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	4,000	161.50	646,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	229.00	229,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	75.20	451,200.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	4,000	178.00	712,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	188,000	267.50	50,290,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	85,000	13.85	1,177,250.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	7,000	56.70	396,900.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	242.50	727,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	10.60	233,200.00	
	新台湾ドル 小計	2,567,439		131,203,358.24 (481,516,324)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	4,846	262.85	1,273,771.10	
	COAL INDIA LTD	9,401	127.85	1,201,917.85	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,566	184.55	842,655.30	
	INDIAN OIL CORP LTD	14,264	79.70	1,136,840.80	

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	19,149	62.50	1,196,812.50	
PETRONET LNG LTD	4,527	176.95	801,052.65	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	21,730	943.40	20,500,082.00	
AMBUJA CEMENTS LTD	4,499	142.15	639,532.85	
ASIAN PAINTS LTD	2,148	1,524.85	3,275,377.80	
BERGER PAINTS INDIA LTD	1,709	424.90	726,154.10	
GRASIM INDUSTRIES LTD	2,182	400.10	873,018.20	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	8,818	88.75	782,597.50	
JSW STEEL LTD	6,406	147.10	942,322.60	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	882	1,275.10	1,124,638.20	
SHREE CEMENT LTD	62	16,980.00	1,052,760.00	
TATA STEEL LTD	2,553	271.90	694,160.70	
ULTRATECH CEMENT LTD	745	3,018.10	2,248,484.50	
UPL LTD	3,989	262.05	1,045,317.45	
VEDANTA LTD	14,097	62.80	885,291.60	
ASHOK LEYLAND LTD	8,912	35.55	316,821.60	
HAVELLS INDIA LTD	1,908	489.95	934,824.60	
LARSEN & TOUBRO LTD	3,649	707.90	2,583,127.10	
SIEMENS LTD	766	1,018.80	780,400.80	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,572	231.75	1,059,561.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	279.35	436,344.70	
INTERGLOBE AVIATION LTD	699	916.35	640,528.65	
BAJAJ AUTO LTD	641	1,937.15	1,241,713.15	
BHARAT FORGE LTD	1,595	245.15	391,014.25	
BOSCH LTD	73	8,357.45	610,093.85	
EICHER MOTORS LTD	102	14,208.50	1,449,267.00	
HERO MOTOCORP LTD	747	1,627.05	1,215,406.35	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	5,702	269.00	1,533,838.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	809	4,486.45	3,629,538.05	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,207	55.85	402,510.95	
TATA MOTORS LTD	12,966	68.55	888,819.30	
PAGE INDUSTRIES LTD	54	16,891.90	912,162.60	
TITAN CO LTD	2,382	816.10	1,943,950.20	
INFO EDGE INDIA LTD	465	1,772.85	824,375.25	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	6,575	119.15	783,411.25	

AVENUE SUPERMARTS LTD	959	1,808.70	1,734,543.30
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	426	2,364.70	1,007,362.20
ITC LTD	26,091	149.70	3,905,822.70
NESTLE INDIA LTD	174	13,478.35	2,345,232.90
UNITED SPIRITS LTD	2,148	451.70	970,251.60
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,124.00	786,800.00
DABUR INDIA LTD	4,007	401.20	1,607,608.40
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	2,699	444.45	1,199,570.55
HINDUSTAN UNILEVER LTD	4,962	2,027.85	10,062,191.70
MARICO LTD	3,373	249.30	840,888.90
AUROBINDO PHARMA LTD	1,910	326.15	622,946.50
CIPLA LTD	2,552	377.45	963,252.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	588	1,919.95	1,128,930.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	861	2,857.95	2,460,694.95
LUPIN LTD	1,634	592.20	967,654.80
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	728	623.35	453,798.80
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	6,321	335.15	2,118,483.15
AXIS BANK LTD	15,990	303.15	4,847,368.50
BANDHAN BANK LTD	3,094	161.05	498,288.70
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	12,523	1,505.10	18,848,367.30
ICICI BANK LTD	36,030	296.50	10,682,895.00
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	192.30	447,482.10
STATE BANK OF INDIA	13,486	183.20	2,470,635.20
BAJAJ FINANCE LTD	1,385	2,474.20	3,426,767.00
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	330	2,026.15	668,629.50
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	2,357	161.00	379,477.00
REC LTD	7,000	81.45	570,150.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	484.90	317,124.60
BAJAJ FINSERV LTD	290	4,497.75	1,304,347.50
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	3,828	391.30	1,497,896.40
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,377	850.95	1,171,758.15
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	2,589	254.45	658,771.05
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	2,655	546.25	1,450,293.75
DLF LTD	4,542	120.80	548,673.60
HCL TECHNOLOGIES LTD	8,336	442.05	3,684,928.80

	INFOSYS LTD	26,108	589.80	15,398,498.40	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	6,903	1,703.15	11,756,844.45	
	TECH MAHINDRA LTD	3,566	503.50	1,795,481.00	
	WIPRO LTD	8,812	176.35	1,553,996.20	
	BHARTI AIRTEL LTD	19,132	404.05	7,730,284.60	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	141.95	340,680.00	
	GAIL INDIA LTD	12,271	76.45	938,117.95	
	NTPC LTD	18,398	77.55	1,426,764.90	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	14,117	147.30	2,079,434.10	
	TATA POWER CO LTD	14,068	34.40	483,939.20	
	インドルピー 小計	492,660		193,974,424.75	(283,202,660)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	5,400	16.80	90,720.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	1.47	71,442.00	
	INDUSTRIES QATAR	21,013	6.85	143,939.05	
	COMMERCIAL BANK PQSC	22,400	3.80	85,232.00	
	MASRAF AL RAYAN	43,202	3.52	152,157.44	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	8,438	6.95	58,644.10	
	QATAR ISLAMIC BANK	14,316	15.00	214,740.00	
	QATAR NATIONAL BANK	54,067	17.40	940,765.80	
	QATAR INSURANCE CO	22,520	2.05	46,188.52	
	BARWA REAL ESTATE CO	21,430	3.08	66,047.26	
	OORED00 QPSC	9,487	5.60	53,127.20	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,415	13.60	87,244.00	
	カタールリアル 小計	277,288		2,010,247.37	(60,729,573)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	1,800	87.44	157,392.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	400	612.06	244,824.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	3,079	316.48	974,441.92	
	GOLD FIELDS LTD	6,232	91.19	568,296.08	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	5,910	66.86	395,142.60	
	KUMBA IRON ORE LTD	471	274.72	129,393.12	
	NORTHAM PLATINUM LTD	2,585	63.25	163,501.25	
	SASOL LTD	4,129	24.26	100,169.54	
	SIBANYE STILLWATER LTD	17,009	22.54	383,382.86	



BIDVEST GROUP LTD	2,176	146.00	317,696.00
MULTICHOICE GROUP LTD	3,305	83.13	274,744.65
MR PRICE GROUP LTD	1,902	118.15	224,721.30
NASPERS LTD-N SHS	3,401	2,330.00	7,924,330.00
PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	10.25	101,997.75
THE FOSCHINI GROUP LTD	2,352	69.29	162,970.08
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	7,365	26.87	197,897.55
BID CORP LTD	2,540	195.00	495,300.00
CLICKS GROUP LTD	1,983	245.00	485,835.00
PICK N PAY STORES LTD	2,743	61.95	169,928.85
SHOPRITE HOLDINGS LTD	3,572	113.25	404,529.00
SPAR GROUP LIMITED/THE	1,441	172.83	249,048.03
TIGER BRANDS LTD	1,150	174.63	200,824.50
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	17.10	218,247.30
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	2,814	91.90	258,606.60
ABSA GROUP LTD	5,491	79.00	433,789.00
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	351	958.00	336,258.00
NEDBANK GROUP LTD	2,832	78.93	223,529.76
STANDARD BANK GROUP LTD	9,828	97.69	960,097.32
FIRSTRAND LTD	25,693	38.57	990,979.01
INVESTEC LTD	3,650	28.00	102,200.00
NINETY ONE LTD	1,825	26.65	48,636.25
PSG GROUP LTD	1,136	122.30	138,932.80
REINET INVESTMENTS SCA	1,113	247.75	275,745.75
REMGRO LTD	4,030	115.53	465,585.90
RMB HOLDINGS LTD	5,881	46.07	270,937.67
DISCOVERY LTD	2,908	61.80	179,714.40
LIBERTY HOLDINGS LTD	800	62.00	49,600.00
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	15.50	156,271.00
OLD MUTUAL LTD	35,316	10.19	359,870.04
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,580	19.40	108,252.00
SANLAM LTD	14,192	48.57	689,305.44
NEPI ROCKCASTLE PLC	2,895	66.86	193,559.70
MTN GROUP LTD	12,732	33.00	420,156.00
TELKOM SA SOC LTD	2,500	17.06	42,650.00

	VODACOM GROUP LTD	4,831	114.16	551,506.96	
	南アフリカランド 小計	254,739		21,800,796.98 (137,999,044)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	34,061	4.92	167,580.12	
	DUBAI ISLAMIC BANK	19,940	3.80	75,772.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	32,907	9.53	313,603.71	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	45,017	1.58	71,126.86	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	0.98	30,060.52	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	40,305	2.08	83,834.40	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,070	13.24	278,966.80	
	アラブディルハム 小計	223,974		1,020,944.41 (30,944,825)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	5.36	10,720.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.48	52,864.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	15.58	23,370.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.63	2,893.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	5.04	2,520.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.84	24,684.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	7.21	18,025.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	5.75	1,725.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.84	25,308.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	400	4.87	1,948.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	23.15	20,835.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	8.42	8,344.22	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	2.94	6,174.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.72	2,121.60	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	1,800	54.65	98,370.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	4.69	37,520.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.38	3,042.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	33.70	40,440.00	
	BEIJING SANJU ENVIRONMENTA-A	2,000	4.90	9,800.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	7.70	22,330.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	3.53	24,004.00		
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	8.64	4,320.00		
GEM CO LTD-A	3,500	4.75	16,625.00		

GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	7.08	9,912.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	12.73	46,082.60	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,500	11.61	17,415.00	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.15	3,225.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	23.65	26,015.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	3.95	13,825.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.15	20,585.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	2.50	8,750.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	62.22	18,666.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	12.60	3,780.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	39.11	7,822.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.08	2,432.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	13.80	23,460.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,200	7.90	9,480.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.60	1,820.00	
NANJING IRON & STEEL CO-A	3,700	3.11	11,507.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.26	16,272.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	400	10.57	4,228.00	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	7.87	16,527.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,120	33.00	36,960.00	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	15.14	21,196.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.08	20,800.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	20.79	16,632.00	
SHANDONG SUN PAPERIndustr-A	2,200	9.11	20,042.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.28	15,744.00	
SHANYING INTL HLDG CO LTD-A	3,800	3.08	11,704.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,500	6.36	9,540.00	
SHENZHEN ZHONGJIN LINGNAN-A	500	3.58	1,790.00	
SICHUAN HEBANG BIOTECHNOL- A	7,400	1.47	10,878.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.94	2,364.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	20.11	22,121.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	21.18	4,236.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	12.36	18,540.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.01	3,015.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	6.12	7,956.00	

WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	1,400	39.20	54,880.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	49.35	19,740.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	11.18	13,416.00
XINJIANG ZHONGTAI CHEMICAL-A	1,800	4.99	8,982.00
XINXING DUCTILE IRON PIPES-A	3,300	3.47	11,451.00
XINYU IRON & STEEL CO LTD-A	2,700	4.06	10,962.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	13.37	22,729.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	43.12	25,872.00
YUNNAN TIN CO LTD-A	1,400	8.20	11,480.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	30.12	7,831.20
ZHEJIANG JIAHUA ENERGY CHE-A	1,200	8.99	10,788.00
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	7.24	16,652.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	12.37	4,948.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.16	3,264.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	8,800	3.74	32,912.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	12.98	12,980.00
AECC AVIATION POWER CO-A	200	22.47	4,494.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	17.25	6,900.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	7.24	21,720.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	27.46	2,746.00
AVICOPTER PLC-A	500	41.09	20,545.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	25.37	35,518.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	6.54	15,042.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	12.78	1,278.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	8.19	2,457.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.65	3,325.00
CHINA INTL MARINE CONTAIN-A	240	7.55	1,812.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	15.30	13,770.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.90	2,950.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	3,800	9.55	36,290.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.27	48,484.00
CHINA RAILWAY HI-TECH INDU-A	1,900	9.43	17,917.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	10,300	4.17	42,951.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	29.16	2,916.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	19,100	5.17	98,747.00

CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,000	111.57	111,570.00
CRRC CORP LTD-A	11,000	6.23	68,530.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	8.82	5,292.00
EVE ENERGY CO LTD-A	800	52.90	42,320.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	298	9.13	2,720.74
GUOXUAN HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	17.47	17,470.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	35.65	21,390.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	26.85	8,055.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	9.60	13,440.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	700	58.40	40,880.00
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	10.97	28,522.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.61	4,698.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	1,439	20.82	29,959.98
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.95	15,800.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	3,800	16.72	63,536.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.16	17,696.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	4.66	3,728.00
SHANGHAI MECHANICAL AND EL-A	700	14.26	9,982.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.61	1,683.00
SHANGHAI WAIGAOQIAO FTZ-A	700	14.43	10,101.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	24.03	16,821.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	14.09	18,317.00
SINOCHEM INTL CORP-A	2,300	5.33	12,259.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	14.87	19,331.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.00	3,200.00
TBEA CO LTD-A	400	7.32	2,928.00
TIAN DI SCIENCE & TECHNOLO-A	3,500	3.00	10,500.00
WEICHAI POWER CO LTD-A	2,700	12.41	33,507.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	5.15	5,665.00
XIAMEN C & D INC-A	300	7.19	2,157.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	9.24	3,696.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	22.93	4,586.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	300	57.25	17,175.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,300	15.90	36,570.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	10.99	14,287.00

ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	12.65	2,530.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	54.70	27,350.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	5.68	5,112.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	9.85	25,610.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	14.24	19,936.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	44.62	35,696.00
TUS ENVIRONMENTAL SCIENCE-A	200	8.42	1,684.00
AIR CHINA LTD-A	800	6.51	5,208.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.09	5,317.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	1,100	5.20	5,720.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	1.98	2,970.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.00	4,800.00
DALIAN PORT PDA CO LTD-A	3,400	1.73	5,882.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	5,100	6.83	34,833.00
GUANGSHEN RAILWAY CO LTD-A	1,000	2.38	2,380.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	13.32	10,656.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	9.89	6,923.00
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.28	18,040.00
S F HOLDING CO LTD-A	700	44.86	31,402.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	62.17	18,651.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.30	4,300.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	7.75	14,725.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.40	6,800.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	31.89	3,189.00
TANGSHAN PORT GROUP CO LTD-A	2,700	2.27	6,129.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	900	28.12	25,308.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	5.31	16,992.00
BYD CO LTD -A	800	49.73	39,784.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	81.36	16,272.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	10.40	5,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	18.75	3,750.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-A	200	10.63	2,126.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	19.77	27,678.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	19.99	23,988.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	3,510	19.00	66,690.00

SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	19.49	1,949.00
WANXIANG QIANCHAO CO LTD-A	400	5.03	2,012.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	18.86	1,886.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	6.73	13,460.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	51.14	71,596.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,800	14.62	40,936.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	25.10	2,510.00
NAVINFO CO LTD-A	900	15.80	14,220.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	100	90.49	9,049.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	16.97	6,788.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	4.61	28,582.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	6.48	2,592.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	65.72	19,716.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	14.13	11,304.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	25.19	15,114.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.28	6,908.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	600	27.51	16,506.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	9.83	12,779.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	12.42	2,484.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.65	2,130.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.27	1,227.00
CITIC GUOAN INFORMATION-A	500	3.18	1,590.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	4.25	51,425.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	16.83	3,366.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	510	43.90	22,389.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	10.81	11,891.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.14	2,742.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	100	46.72	4,672.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	16.52	14,868.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	33.04	29,736.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	20.99	8,396.00
CHINA GRAND AUTOMOTIVE SER-A	500	4.17	2,085.00
CHINA INTERNATIONAL TRAVEL-A	900	73.27	65,943.00
HLA CORP LTD -A	200	6.12	1,224.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	17.94	3,588.00

SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	7.24	36,200.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	8.89	29,337.00
VISUAL CHINA GROUP CO LTD-A	300	15.91	4,773.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.69	28,140.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	73.06	14,612.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	300	84.38	25,314.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	9.31	28,861.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	31.62	22,134.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	102.00	30,600.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	37.90	18,950.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	7.15	3,575.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	56.95	34,170.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	5.93	14,232.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	43.30	17,320.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	30.11	21,077.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,000	104.02	104,020.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	20.01	18,009.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	36.49	47,437.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.59	36,475.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	36.69	44,028.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	2,600	28.35	73,710.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	26.43	26,430.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	600	82.87	49,722.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	17.17	34,340.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	42.79	12,837.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	48.79	14,637.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	600	1,056.00	633,600.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	600	70.17	42,102.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	900	114.77	103,293.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	27.73	72,098.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	400	84.13	33,652.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	40.00	16,000.00
TECH-BANK FOOD CO LTD-A	1,000	10.45	10,450.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	45.24	22,620.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	11.77	38,841.00



TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	43.27	4,327.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	2,300	31.70	72,910.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	1,700	109.05	185,385.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	14.77	16,247.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	17.30	22,490.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	25.29	15,174.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	1,170	37.26	43,594.20
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	102.65	10,265.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	39.50	7,900.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	26.40	10,560.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	53.30	10,660.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	16.38	3,931.20
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	200	88.60	17,720.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	31.06	15,530.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	17.17	3,434.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	36.69	25,683.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	11.17	5,361.60
OVCTEK CHINA INC-A	200	52.63	10,526.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	18.51	3,702.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	500	243.20	121,600.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	97.37	9,737.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	800	23.13	18,504.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	168.57	33,714.00
BEIJING SL PHARMACEUTICAL -A	900	12.02	10,818.00
BEIJING Tiantan Biological-A	900	34.41	30,969.00
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	24.34	4,868.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	64.63	19,389.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	70.00	21,000.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	100	479.00	47,900.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	37.70	22,620.00
CHINA RESOURCES DOUBLE CRA-A	900	12.45	11,205.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	28.19	2,819.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	500	63.55	31,775.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	25.59	2,559.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	30.19	6,038.00

GUIZHOU BAILING GROUP PHAR-A	1,200	8.75	10,500.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	67.80	20,340.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	600	43.89	26,334.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	20.88	14,616.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	1,900	85.66	162,754.00
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.59	15,590.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	20.62	18,558.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.15	17,840.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	35.38	17,690.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	500	46.07	23,035.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	20.00	5,200.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	200	30.33	6,066.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	21.41	19,269.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	104.34	31,302.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	17.39	1,739.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	19.47	19,470.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	20.94	4,188.00
TASLY PHARMACEUTICAL GROUP-A	200	13.81	2,762.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	10.32	2,064.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	29.55	17,730.00
WUXI APPTec CO LTD-A	600	91.85	55,110.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	15.78	15,780.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	77.93	38,965.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	300	119.65	35,895.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.35	11,770.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,100	19.87	21,857.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	25.55	45,479.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	39.68	15,872.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	34,400	3.35	115,240.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	4.77	35,775.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	7.51	11,265.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.48	56,724.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	18,100	5.09	92,129.00
BANK OF GUIYANG CO LTD-A	280	7.67	2,147.60
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	7.64	3,820.00

BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	6.03	19,296.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	7.17	17,208.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	23.30	79,220.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.36	73,651.60
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.22	3,132.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.37	19,110.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	18,400	3.57	65,688.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	9,000	31.51	283,590.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	16,400	5.63	92,332.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.45	28,380.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	24,900	5.12	127,488.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	9,600	15.43	148,128.00
PING AN BANK CO LTD-A	9,000	12.61	113,490.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	13,500	10.06	135,810.00
ANXIN TRUST CO LTD-A	500	2.50	1,250.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.01	3,609.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	2.93	29,300.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.27	15,405.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	6.52	5,216.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,600	16.53	42,978.00
CITIC SECURITIES CO-A	4,500	22.31	100,395.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	1,300	30.12	39,156.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	11.11	2,222.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	3,100	16.68	51,708.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	400	11.29	4,516.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.97	3,485.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	7.11	51,192.00
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	13.70	36,990.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	11.24	6,744.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,500	16.32	57,120.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.48	4,240.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	3,700	12.87	47,619.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	113.95	22,790.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	8.13	3,252.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	3,400	17.26	58,684.00

HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	10.99	3,297.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	6.36	4,452.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	14.67	23,472.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.50	25,500.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	9.27	48,204.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.41	10,912.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	12.50	7,500.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.42	11,050.00
SHANGHAI AJ GROUP CO LTD-A	800	8.00	6,400.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.27	2,908.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.47	67,944.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	9.34	2,802.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	8.03	2,409.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.66	17,708.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.86	4,430.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	10.19	13,247.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,200	25.52	30,624.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	2,800	27.79	77,812.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	6.05	3,630.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	39.28	35,352.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	4,900	68.95	337,855.00
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	6.42	14,124.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.23	14,382.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,100	20.53	22,583.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	16.47	59,292.00
CHINA VANKE CO LTD -A	4,400	24.90	109,560.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.58	2,632.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	27.80	22,240.00
GEMDALE CORP-A	600	12.78	7,668.00
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	5.28	14,256.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	5.31	6,372.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	7.19	22,289.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.59	5,313.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	3.97	4,764.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	5,400	14.52	78,408.00

RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	7.37	4,422.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	12.32	11,088.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	5.94	14,850.00
TAHOE GROUP CO LTD-A	2,100	5.01	10,521.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.05	3,660.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.45	21,930.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	19.56	5,868.00
AISINO CORP-A	200	20.39	4,078.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	30.32	3,032.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	26.49	18,543.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	75.79	15,158.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	22.27	15,589.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	13.66	5,464.00
GLODON CO LTD-A	500	40.71	20,355.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	130	87.26	11,343.80
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	35.48	35,480.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	17.25	8,625.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	166.80	16,680.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	2.94	2,293.20
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	44.54	17,816.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	17.70	7,080.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	37.10	14,840.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	8.07	7,263.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	1,160	40.25	46,690.00
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	36.01	21,606.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	33.22	29,898.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	3.95	80,975.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	19.23	13,461.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	12.58	32,708.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	800	43.30	34,640.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	39.20	43,120.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	1,200	13.02	15,624.00
GOERTEK INC -A	500	15.53	7,765.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.66	21,252.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	8.34	20,850.00

GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	11.38	3,414.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	4,100	27.84	114,144.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	18.43	3,686.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	6.11	17,108.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	14.85	13,365.00
HYTERA COMMUNICATIONS CORP-A	1,700	6.77	11,509.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	39.25	23,550.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	14.25	18,525.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.60	15,180.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	2,380	35.41	84,275.80
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	125.30	25,060.00
NINESTAR CORP-A	100	28.96	2,896.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	14.57	5,828.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	27.50	27,500.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	200	193.50	38,700.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	35.87	32,283.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	21.20	14,840.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	13.86	4,158.00
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	3.19	2,552.00
UNISPLENDOR CORP LTD-A	1,340	36.03	48,280.20
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	17.05	22,165.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	24.34	19,472.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	120.30	84,210.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	800	35.50	28,400.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	25.65	41,040.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	39.07	15,628.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	200	88.06	17,612.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	400	16.56	6,624.00
ZTE CORP-A	1,600	42.55	68,080.00
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	5.31	73,278.00
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	4.79	11,975.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.40	18,920.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	10,100	16.91	170,791.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.02	5,656.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.15	4,095.00

	HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.61	3,688.00	
	HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.56	2,136.00	
	INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.58	12,642.00	
	SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	7.80	8,580.00	
	SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.36	16,192.00	
	SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.22	3,654.00	
	SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	500	5.40	2,700.00	
	SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	8.85	6,195.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.40	18,920.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	100	244.11	24,411.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	15.48	30,960.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	1,200	22.49	26,988.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	21.92	35,072.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	258.30	64,575.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	15.30	35,190.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	52.28	26,140.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	11.02	12,122.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	200	137.34	27,468.00	
	オフショア人民元 小計	949,428		12,003,893.54 (188,341,089)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,027	10.20	30,875.40	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	14,649	29.50	432,145.50	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,224	42.05	51,469.20	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	8.74	33,054.68	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	11.78	41,230.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	1,897	60.50	114,768.50	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	4,879	30.60	149,297.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	9,069	66.80	605,809.20	
	SAUDI CEMENT	865	42.15	36,459.75	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,544	14.62	37,193.28	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,000	7.07	56,560.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,976	41.00	122,016.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	71.30	30,088.60	
	JARIR MARKETING CO	629	120.80	75,983.20	
	ALMARAI CO	2,821	43.90	123,841.90	

SAVOLA	2,962	31.50	93,303.00	
AL RAJHI BANK	14,710	53.20	782,572.00	
ALINMA BANK	8,420	19.26	162,169.20	
ARAB NATIONAL BANK	6,732	16.56	111,481.92	
BANK AL-JAZIRA	5,569	10.78	60,033.82	
BANK ALBILAD	4,268	19.12	81,604.16	
BANQUE SAUDI FRANSI	6,201	23.20	143,863.20	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	14,498	33.00	478,434.00	
RIYAD BANK	13,644	14.80	201,931.20	
SAMBA FINANCIAL GROUP	11,127	19.60	218,089.20	
SAUDI BRITISH BANK	8,998	19.22	172,941.56	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	298	86.80	25,866.40	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	59.50	39,329.50	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	5,942	8.17	48,546.14	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	6.68	28,690.60	
ETIHAD ETISALAT CO	4,227	20.90	88,344.30	
SAUDI TELECOM CO	4,886	82.70	404,072.20	
SAUDI ELECTRICITY CO	9,459	14.86	140,560.74	
サウジアラビアリアル 小計	187,181		5,222,625.75 (154,850,853)	
合 計	22,102,177		3,934,674,909 (3,934,674,909)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	23,900	415,860.00	
	メキシコペソ 小計		23,900	415,860.00 (1,854,735)	
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	12,100	133,947.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	22,674	243,972.24	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	40,872	64,986.48	
			75,646	442,905.72	



	南アフリカランド 小計	(2,803,593)
合計		4,658,328 (4,658,328)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 59銘柄	100.0%		15.5%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.5%		1.8%
	投資証券 1銘柄		2.5%	0.0%
ブラジルレアル	株式 55銘柄	100.0%		4.9%
チリペソ	株式 17銘柄	100.0%		0.6%
コロンビアペソ	株式 7銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 8銘柄	100.0%		0.2%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%		0.5%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 18銘柄	100.0%		0.7%
香港ドル	株式 205銘柄	100.0%		24.1%
マレーシアリングgit	株式 40銘柄	100.0%		1.8%
タイバーツ	株式 40銘柄	100.0%		2.1%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%		0.8%
インドネシアルピア	株式 28銘柄	100.0%		1.3%
韓国ウォン	株式 108銘柄	100.0%		11.2%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%		12.2%
インドルピー	株式 84銘柄	100.0%		7.2%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%		1.5%
南アフリカランド	株式 45銘柄	98.0%		3.5%
	投資証券 3銘柄		2.0%	0.1%
アラブディルハム	株式 7銘柄	100.0%		0.8%
オフショア人民元	株式 461銘柄	100.0%		4.8%
サウジアラビアリアル	株式 33銘柄	100.0%		3.9%

（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国内リートマザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）	
2020年 3月25日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
金銭信託	1,451,209,126
投資証券	14,477,516,670
未収入金	931,320,440
未収配当金	196,390,089
前払金	115,962,300
差入委託証拠金	55,462,500
流動資産合計	17,227,861,125
資産合計	17,227,861,125
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	71,621,010
未払金	101,692,690
未払解約金	2,201,975,000
その他未払費用	19,266
流動負債合計	2,375,307,966
負債合計	2,375,307,966
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	13,315,659,788
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,536,893,371
元本等合計	14,852,553,159
純資産合計	14,852,553,159
負債純資産合計	17,227,861,125

#### 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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	11,074,952,278円
期中追加設定元本額	19,331,725,550円
期中一部解約元本額	17,091,018,040円
期末元本額	13,315,659,788円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	671,720,517円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	443,821,050円
りそなラップ型ファンド(成長型)	236,314,252円
DCりそな グローバルバランス	12,463,927円
つみたてバランスファンド	593,548,464円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	138,543,763円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	62,554,673円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	32,469,144円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,042,628円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	1,819,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	619,614円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	736,050円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,473,943,583円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,410,665,608円
Smart-i Jリートインデックス	1,793,597,020円
Smart-i 8資産バランス 安定型	13,923,354円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	46,641,026円
Smart-i 8資産バランス 成長型	46,447,454円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,333,080,205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)	708,039円

2. 計算日における受益権の総数	13,315,659,788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	1.1154円
(10,000口当たり純資産額)	(11,154円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

2020年 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		4,579,907,313
合計		4,579,907,313

(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 3月25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	495,876,510	-	424,255,500	71,621,010
合計		495,876,510	-	424,255,500	71,621,010

## (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	208	19,760,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	248	23,485,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	381	39,395,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	568	343,072,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,180	164,372,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,966	284,087,000	
	産業ファンド投資法人	2,200	333,080,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,620	490,860,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,115	182,079,500	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	856	285,904,000	
	G L P 投資法人	4,255	544,640,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	744	229,152,000	
	日本プロロジスリート投資法人	2,571	708,053,400	
	星野リゾート・リート投資法人	260	96,850,000	
	O n e リート投資法人	266	63,919,800	
	イオンリート投資法人	1,844	199,889,600	
	ヒューリックリート投資法人	1,453	183,804,500	
	日本リート投資法人	554	175,064,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	10,976	162,883,840	
	日本ヘルスケア投資法人	83	15,678,700	
	積水ハウス・リート投資法人	4,977	339,431,400	
	トーセイ・リート投資法人	372	37,683,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	660	114,312,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	364	39,384,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	342	30,609,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	5,516	736,386,000	
	いちごホテルリート投資法人	281	16,017,000	
ラサールロジポート投資法人	1,588	227,560,400		
スターアジア不動産投資法人	567	47,344,500		
マリモ地方創生リート投資法人	168	15,271,200		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	486	213,597,000		

大江戸温泉リート投資法人	290	17,139,000	
さくら総合リート投資法人	370	26,418,000	
投資法人みらい	1,943	76,262,750	
森トラスト・ホテルリート投資法人	401	36,410,800	
三菱地所物流リート投資法人	336	115,248,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	321	38,552,100	
ザイマックス・リート投資法人	248	22,096,800	
タカラレーベン不動産投資法人	485	41,516,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	356	37,024,000	
日本ビルファンド投資法人	1,654	1,237,192,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,709	1,119,395,000	
日本リテールファンド投資法人	3,229	469,819,500	
オリックス不動産投資法人	3,404	544,299,600	
日本プライムリアルティ投資法人	1,119	386,614,500	
プレミア投資法人	1,540	167,706,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,145	163,964,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,186	114,449,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	3,836	435,386,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,221	168,009,600	
インヴィンシブル投資法人	7,494	210,731,280	
フロンティア不動産投資法人	607	196,971,500	
平和不動産リート投資法人	1,064	107,357,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,116	274,201,200	
福岡リート投資法人	884	92,024,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	529	324,277,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,323	94,726,800	
大和証券オフィス投資法人	394	240,734,000	
阪急阪神リート投資法人	772	91,018,800	
スターツプロシード投資法人	266	48,252,400	
大和ハウスリート投資法人	2,438	640,218,800	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	5,504	199,520,000	
日本賃貸住宅投資法人	1,922	174,902,000	
ジャパンエクセレント投資法人	1,580	201,450,000	
合計	100,355	14,477,516,670	

(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 3月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	33,750,317
金銭信託	3,356,613,288
投資証券	9,940,131,352
派生商品評価勘定	78
未収入金	731,071,088
未収配当金	53,630,360
流動資産合計	14,115,196,483
資産合計	14,115,196,483
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,963,570
未払解約金	3,989,248,815
その他未払費用	6,619
流動負債合計	3,993,219,004
負債合計	3,993,219,004
純資産の部	
元本等	
元本	13,028,495,525
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,906,518,046
元本等合計	10,121,977,479
純資産合計	10,121,977,479
負債純資産合計	14,115,196,483

### 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



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>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <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 3月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 3月26日
期首元本額	11,637,116,981円
期中追加設定元本額	15,180,038,826円
期中一部解約元本額	13,788,660,282円
期末元本額	13,028,495,525円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	739,280,629円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	481,728,153円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,361,658,835円
DCりそな グローバルバランス	13,457,292円
つみたてバランスファンド	323,323,484円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	173,944,304円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	77,454,403円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	48,222,062円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,943,199円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,576,274円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	765,231円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	905,259円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,858,733,856円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	2,967,658,933円
Smart-i 先進国リートインデックス	842,664,580円
Smart-i 8資産バランス 安定型	15,567,068円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	53,906,204円
Smart-i 8資産バランス 成長型	62,640,569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)	1,065,190円
2. 計算日における受益権の総数	13,028,495,525口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	2,906,518,046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	0.7769円
(10,000口当たり純資産額)	(7,769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 3月25日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 3月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

2020年 3月25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 3月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		5,596,309,425
合計		5,596,309,425

(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 3月25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	794,442	-	794,520	78
	オーストラリアドル	794,442	-	794,520	78
	売建	549,089,080	-	553,052,650	3,963,570
	米ドル	417,602,800	-	420,361,830	2,759,030
	カナダドル	8,808,350	-	8,838,800	30,450
	ユーロ	30,760,440	-	30,939,000	178,560
	英ポンド	29,144,980	-	29,567,080	422,100
	オーストラリアドル	26,871,400	-	27,146,100	274,700
	ニュージーランドドル	1,471,540	-	1,485,800	14,260
	香港ドル	14,374,950	-	14,473,300	98,350
	シンガポールドル	20,054,620	-	20,240,740	186,120

合計	549,883,522	-	553,847,170	3,963,492
----	-------------	---	-------------	-----------

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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	8,537	121,225.40	
		AGREE REALTY CORP	4,676	268,121.84	
		ALEXANDER'S INC	228	62,246.28	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,598	1,631,566.98	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,182	123,694.34	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	14,309	349,998.14	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	11,624	87,063.76	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	26,646	541,446.72	
		AMERICOLD REALTY TRUST	19,624	605,596.64	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	15,566	409,852.78	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	22,628	176,272.12	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	66,200	23,501.00	

ASHFORD HOSPITALITY TRUST	11,694	8,071.19	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	14,372	1,831,855.12	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	19,494.00	
BOSTON PROPERTIES INC	14,764	1,293,178.76	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	7,463.41	
BRANDYWINE REALTY TRUST	17,342	151,222.24	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,729	310,362.90	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,942	55,744.26	
BRT APARTMENTS CORP	877	7,805.30	
CAMDEN PROPERTY TRUST	9,930	697,383.90	
CARETRUST REIT INC	9,424	140,511.84	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	5,819.10	
CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	13,574.98	
CHATHAM LODGING TRUST	4,881	23,868.09	
CITY OFFICE REIT INC	5,944	42,856.24	
CLIPPER REALTY INC	1,350	7,735.50	
COLONY CAPITAL INC	52,342	91,598.50	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	12,763	117,802.49	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	2,216	66,901.04	
CORECIVIC INC	12,935	131,031.55	
COREPOINT LODGING INC	3,700	13,024.00	
CORESITE REALTY CORP	3,912	373,322.16	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	11,539	218,779.44	
COUSINS PROPERTIES INC	14,834	372,333.40	
CUBESMART	20,056	459,482.96	
CYRUSONE INC	11,526	577,567.86	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	21,047	103,130.30	
DIGITAL REALTY TRUST INC	27,092	3,162,178.24	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	25,929	82,713.51	
DOUGLAS EMMETT INC	17,109	460,745.37	
DUKE REALTY CORP	37,678	1,093,038.78	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	7,599	168,773.79	
EASTGROUP PROPERTIES INC	3,897	383,075.10	

EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	16,142	133,494.34	
EPR PROPERTIES	8,521	182,178.98	
EQUINIX INC	8,799	4,803,286.11	
EQUITY COMMONWEALTH	12,670	383,014.10	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,664	916,402.40	
EQUITY RESIDENTIAL	35,946	1,874,583.90	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	9,514	133,100.86	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,791	1,276,775.91	
EXTRA SPACE STORAGE INC	13,305	1,042,047.60	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	18,739.25	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,273	553,329.84	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	12,922	370,861.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	7,483	127,061.34	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	11,690	59,619.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	5,341	57,575.98	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	21,240	471,315.60	
GEO GROUP INC/THE	11,992	128,674.16	
GETTY REALTY CORP	3,725	83,179.25	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,578	38,391.94	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	26,116.97	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	4,153	40,242.57	
GLOBAL NET LEASE INC	9,633	124,265.70	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	13,860	360,914.40	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	21,506	477,003.08	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	50,835	1,075,668.60	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,293	16,567.09	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	10,733	323,599.95	
HOST HOTELS & RESORTS INC	73,447	815,996.17	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	16,028	288,183.44	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	9,916	81,212.04	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	7,034	104,032.86	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	1,860	123,355.20	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,268	67,888.72	
INVITATION HOMES INC	55,226	1,001,799.64	
IRON MOUNTAIN INC	29,884	717,216.00	

JBG SMITH PROPERTIES	12,245	324,002.70	
KILROY REALTY CORP	10,156	545,275.64	
KIMCO REALTY CORP	43,823	459,703.27	
KITE REALTY GROUP TRUST	9,153	93,360.60	
LEXINGTON REALTY TRUST	25,042	216,613.30	
LIFE STORAGE INC	4,829	375,599.62	
LTC PROPERTIES INC	4,338	123,763.14	
MACERICH CO/THE	12,011	89,602.06	
MACK-CALI REALTY CORP	8,888	134,475.44	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	160,400	112,280.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	53,038	754,730.74	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,714	1,044,654.52	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	10,590	116,278.20	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	17,850	536,928.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,487	156,985.40	
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,410	188,748.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	8,195	17,537.30	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,457	64,127.70	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	5,262	126,866.82	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	22,769	574,689.56	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,470	18,139.80	
PARAMOUNT GROUP INC	19,784	147,390.80	
PARK HOTELS & RESORTS INC	23,998	181,664.86	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	12,688	126,118.72	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	8,971.95	
PHYSICIANS REALTY TRUST	19,040	257,611.20	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	12,637	196,378.98	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	17,745.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	4,984	33,990.88	
PRIME US REIT	47,000	27,260.00	
PROLOGIS INC	76,139	5,371,606.45	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,088	247,615.92	
PUBLIC STORAGE	15,478	2,610,364.70	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	6,035	292,878.55	
REALTY INCOME CORP	33,494	1,697,140.98	

REGENCY CENTERS CORP	17,087	674,082.15	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	12,646	102,811.98	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	23,281	116,172.19	
RETAIL VALUE INC	1,615	19,686.85	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	11,370	413,413.20	
RLJ LODGING TRUST	18,216	110,571.12	
RPT REALTY	8,748	53,275.32	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	5,323	174,062.10	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	20,608	210,613.76	
SAFEHOLD INC	1,342	75,916.94	
SAUL CENTERS INC	1,280	39,014.40	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	3,642	30,774.90	
SERVICE PROPERTIES TRUST	17,556	91,115.64	
SIMON PROPERTY GROUP INC	31,551	1,726,786.23	
SITE CENTERS CORP	16,265	87,831.00	
SL GREEN REALTY CORP	8,456	398,531.28	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	10,239	262,220.79	
STAG INDUSTRIAL INC	15,614	313,060.70	
STORE CAPITAL CORP	22,316	415,077.60	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	10,940	43,978.80	
SUN COMMUNITIES INC	9,517	1,032,213.82	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	22,618	185,241.42	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	10,120	64,869.20	
TAUBMAN CENTERS INC	6,285	274,780.20	
TERRENO REALTY CORP	7,072	333,020.48	
UDR INC	30,382	939,107.62	
UMH PROPERTIES INC	3,956	36,830.36	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,381	97,015.25	
URBAN EDGE PROPERTIES	12,561	106,517.28	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,249	41,749.65	
VENTAS INC	38,276	983,693.20	
VEREIT INC	108,472	482,700.40	
VICI PROPERTIES INC	47,016	616,379.76	
VORNADO REALTY TRUST	16,457	557,892.30	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	24,334.80	



	WASHINGTON REIT	8,080	169,760.80
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	12,153	175,246.26
	WELLTOWER INC	41,789	1,895,966.93
	WHITESTONE REIT	4,416	28,836.48
	WP CAREY INC	17,623	927,674.72
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	12,048	120,720.96
	米ドル 小計	2,688,621	66,946,609.35 (7,441,785,095)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	6,005	214,078.25
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	6,997	42,331.85
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	2,426	45,172.12
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	8,451	338,040.00
	CHOICE PROPERTIES REIT	14,937	166,398.18
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	9,480	75,745.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	4,706	49,836.54
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	5,459	56,664.42
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	8,023	64,023.54
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	2,961	50,366.61
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	10,466	124,859.38
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	2,878	136,330.86
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	15,054	122,840.64
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	6,427	79,244.91
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	5,177	75,584.20
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,894	36,137.52
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,047	23,622.38
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	3,558	111,721.20
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,951	58,042.30
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	15,523	228,188.10
	SLATE OFFICE REIT	4,169	12,381.93
	SLATE RETAIL REIT - U	1,920	11,635.20
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	7,623	124,483.59
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	7,226	60,698.40
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	20,400.00
	カナダドル 小計	166,158	2,328,827.32 (179,016,956)

ユーロ	AEDIFICA	2,539	220,893.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	16,280	200,895.20	
	ALTAREA	379	41,235.20	
	BEFIMMO	2,194	85,895.10	
	COFINIMMO	2,546	295,845.20	
	COVIVIO	4,586	265,758.70	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	4,371	45,808.08	
	GECINA SA	5,597	660,446.00	
	HAMBORNER REIT AG	7,579	58,858.51	
	HIBERNIA REIT PLC	74,814	65,836.32	
	ICADE	2,896	199,534.40	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	19,209.88	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	24,440	169,491.40	
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	2,408	46,811.52	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	46,661	55,713.23	
	KLEPIERRE	21,233	463,941.05	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	6,811	31,330.60	
	MERCIALYS	3,481	26,177.12	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	37,985	276,720.72	
	MONTEA	1,191	97,662.00	
	NSI NV	1,790	61,934.00	
	RETAIL ESTATES	1,189	59,687.80	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	14,112	931,392.00	
VASTNED RETAIL NV	2,010	32,923.80		
WAREHOUSES DE PAUW SCA	13,350	273,942.00		
WERELDHAVE NV	4,269	33,276.85		
	ユーロ 小計	309,662	4,721,219.68	(566,215,876)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	11,320.00	
	ASSURA PLC	245,097	189,459.98	
	BIG YELLOW GROUP PLC	15,421	143,569.51	
	BRITISH LAND CO PLC	96,804	357,206.76	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	3,501.96	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	67,652	61,022.10	
	DERWENT LONDON PLC	10,846	333,622.96	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	65,239	45,602.06	

	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	25,598	162,444.90	
	HAMMERSON PLC	83,861	75,022.05	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	4,413.96	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	77,900	477,371.20	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	83,442	134,758.83	
	LXI REIT PLC	55,678	63,472.92	
	NEWRIVER REIT PLC	33,051	19,698.39	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	57,400	34,038.20	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	123,484	181,274.51	
	RDI REIT PLC	27,350	16,710.85	
	REGIONAL REIT LTD	43,881	28,391.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	20,857	111,376.38	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	58,503	22,494.40	
	SEGRO PLC	112,616	867,818.89	
	SHAFTESBURY PLC	22,222	135,331.98	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	37,939	33,158.68	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	175,777	190,893.82	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	89,710	55,171.65	
	UNITE GROUP PLC	37,681	295,230.63	
	WORKSPACE GROUP PLC	13,927	96,514.11	
	英bond 小計	1,824,105	4,150,892.68 (543,102,798)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	38,307	81,593.91	
	APN INDUSTRIA REIT	13,219	23,265.44	
	ARENA REIT	32,557	50,463.35	
	BWP TRUST	52,781	171,538.25	
	CENTURIA OFFICE REIT	40,642	60,963.00	
	CHARTER HALL GROUP	46,994	263,636.34	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	45,828	172,313.28	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	38,891	115,117.36	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	27,061	43,297.60	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	205,502	158,236.54	
	DEXUS	112,412	989,225.60	
	GDI PROPERTY GROUP	55,291	50,314.81	
	GOODMAN GROUP	167,153	1,902,201.14	

	GPT GROUP	199,040	706,592.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	29,877	69,314.64
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	15,020	23,055.70
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	26,599	77,403.09
	MIRVAC GROUP	409,519	737,134.20
	NATIONAL STORAGE REIT	86,338	125,190.10
	RURAL FUNDS GROUP	34,950	63,259.50
	SCENTRE GROUP	550,760	787,586.80
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	101,742	220,780.14
	STOCKLAND	250,305	498,106.95
	VICINITY CENTRES	325,028	331,528.56
	VIVA ENERGY REIT	75,435	156,150.45
	オーストラリアドル 小計	2,981,251	7,878,268.75 (521,698,956)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	88,533	74,367.72
	GOODMAN PROPERTY TRUST	109,160	223,778.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	171,370	143,950.80
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	117,741	173,079.27
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	37,526	76,928.30
	ニュージーランドドル 小計	524,330	692,104.09 (44,716,845)
香港ドル	CHAMPION REIT	219,000	932,940.00
	FORTUNE REIT	138,000	888,720.00
	LINK REIT	218,100	14,045,640.00
	PROSPERITY REIT	136,000	320,960.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	109,000	374,960.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	159,000	539,010.00
	香港ドル 小計	979,100	17,102,230.00 (245,245,978)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	48,100	47,138.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	311,300	765,798.00
	ASCOTT TRUST	201,196	147,879.06
	CACHE LOGISTICS TRUST	105,200	41,028.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	292,500	427,050.00
	CAPITALAND MALL TRUST	291,000	494,700.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	82,500	89,100.00

	CDL HOSPITALITY TRUSTS	85,100	63,399.50	
	ESR REIT	222,700	62,356.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	80,200	30,877.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	60,600	38,784.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	79,000	158,000.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	73,300	78,431.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	81,000	28,350.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	169,400	127,050.00	
	KEPPEL DC REIT	123,800	256,266.00	
	KEPPEL REIT	188,600	167,854.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	22,896.50	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	219,400	368,592.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	155,700	333,198.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	309,300	426,834.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	230,900	168,557.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	269,000	82,045.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	42,700	123,830.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	89,900	23,823.50	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	59,300	36,173.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	29,261.00	
	SPH REIT	92,200	69,611.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	146,100	57,709.50	
	SUNTEC REIT	235,200	275,184.00	
	シンガポールドル 小計	4,645,196	5,041,775.06 (386,603,311)	
韓国ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	24,928,000.00	
	韓国ウォン 小計	4,100	24,928,000.00 (2,243,520)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	18,865	309,008.70	
	イスラエルシュケル 小計	18,865	309,008.70 (9,502,017)	
	合計		9,940,131,352 (9,940,131,352)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 157銘柄	100.0%	74.9%
カナダドル	投資証券 25銘柄	100.0%	1.8%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	5.7%
英ポンド	投資証券 28銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	5.2%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券 6銘柄	100.0%	2.5%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	100.0%	3.9%
韓国ウォン	投資証券 1銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄	100.0%	0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

### 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 【中間財務諸表】

Smart - i 8資産バランス 安定型  
Smart - i 8資産バランス 安定成長型  
Smart - i 8資産バランス 成長型

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第3期中間計算期間(2020年 3月26日から2020年 9月25日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【Smart-i 8資産バランス 安定型】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	4,522,153	-
コール・ローン	-	16,762,441
親投資信託受益証券	828,144,628	1,796,718,242
流動資産合計	832,666,781	1,813,480,683
資産合計	832,666,781	1,813,480,683
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,797,361	2,955,983
未払受託者報酬	67,395	129,790
未払委託者報酬	471,684	908,490
未払利息	-	45
その他未払費用	28,845	50,518
流動負債合計	3,365,285	4,044,826
負債合計	3,365,285	4,044,826
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	816,986,993	1,682,945,118
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	12,314,503	126,490,739
（分配準備積立金）	9,560,603	8,905,598
元本等合計	829,301,496	1,809,435,857
純資産合計	829,301,496	1,809,435,857
負債純資産合計	832,666,781	1,813,480,683



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 3月26日 至 2019年 9月25日	第3期中間計算期間 自 2020年 3月26日 至 2020年 9月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	8,867,492	55,793,614
営業収益合計	8,867,492	55,793,614
営業費用		
支払利息	654	3,209
受託者報酬	26,223	129,790
委託者報酬	183,507	908,490
その他費用	11,071	50,939
営業費用合計	221,455	1,092,428
営業利益又は営業損失（ ）	8,646,037	54,701,186
経常利益又は経常損失（ ）	8,646,037	54,701,186
中間純利益又は中間純損失（ ）	8,646,037	54,701,186
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	399,504	2,601,727
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,785,844	12,314,503
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,478,151	63,889,434
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,478,151	63,889,434
剰余金減少額又は欠損金増加額	778,484	1,812,657
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	778,484	1,812,657
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	19,732,044	126,490,739

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 121,076,869円	期首元本額 816,986,993円
期中追加設定元本額 825,653,926円	期中追加設定元本額 941,670,985円
期中一部解約元本額 129,743,802円	期中一部解約元本額 75,712,860円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 816,986,993口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,682,945,118口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0151円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0752円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,151円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,752円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

<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>	同左
<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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。</p>	<p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	6,657,466	-
コール・ローン	-	8,630,253
親投資信託受益証券	957,835,613	1,793,479,764
流動資産合計	964,493,079	1,802,110,017
資産合計	964,493,079	1,802,110,017
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	490,000	1,130,189
未払受託者報酬	88,819	159,041
未払委託者報酬	710,491	1,272,283
未払利息	-	23
その他未払費用	38,109	61,942
流動負債合計	1,327,419	2,623,478
負債合計	1,327,419	2,623,478
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,004,651,597	1,673,101,698
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	41,485,937	126,384,841
(分配準備積立金)	15,633,443	14,641,721
元本等合計	963,165,660	1,799,486,539
純資産合計	963,165,660	1,799,486,539
負債純資産合計	964,493,079	1,802,110,017

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 3月26日 至 2019年 9月25日	第3期中間計算期間 自 2020年 3月26日 至 2020年 9月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	14,648,704	141,904,151
営業収益合計	14,648,704	141,904,151
営業費用		
支払利息	1,011	3,483
受託者報酬	43,146	159,041
委託者報酬	345,118	1,272,283
その他費用	18,282	62,439
営業費用合計	407,557	1,497,246
営業利益又は営業損失（ ）	14,241,147	140,406,905
経常利益又は経常損失（ ）	14,241,147	140,406,905
中間純利益又は中間純損失（ ）	14,241,147	140,406,905
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	596,407	6,147,066
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,789,496	41,485,937
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,049,970	33,610,939
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,198,205
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,049,970	31,412,734
剰余金減少額又は欠損金増加額	975,934	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	975,934	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	30,508,272	126,384,841

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 253,849,322円	期首元本額 1,004,651,597円
期中追加設定元本額 877,655,176円	期中追加設定元本額 755,884,234円
期中一部解約元本額 126,852,901円	期中一部解約元本額 87,434,133円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 1,004,651,597口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,673,101,698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 41,485,937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 0.9587円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,587円)	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0755円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,755円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

<p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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。</p>	<p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>
--	---

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## 【Smart-i 8資産バランス 成長型】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	7,239,008	-
コール・ローン	-	10,541,305
親投資信託受益証券	774,225,614	1,417,321,194
流動資産合計	781,464,622	1,427,862,499
資産合計	781,464,622	1,427,862,499
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,705,052	719,108
未払受託者報酬	79,045	129,328
未払委託者報酬	711,392	1,163,889
未払利息	-	28
その他未払費用	33,888	50,341
流動負債合計	2,529,377	2,062,694
負債合計	2,529,377	2,062,694
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	845,058,456	1,328,100,712
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	66,123,211	97,699,093
（分配準備積立金）	17,459,931	16,091,970
元本等合計	778,935,245	1,425,799,805
純資産合計	778,935,245	1,425,799,805
負債純資産合計	781,464,622	1,427,862,499



## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2019年 3月26日 至 2019年 9月25日	第3期中間計算期間 自 2020年 3月26日 至 2020年 9月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	14,711,044	153,025,580
営業収益合計	14,711,044	153,025,580
営業費用		
支払利息	1,250	3,089
受託者報酬	45,715	129,328
委託者報酬	411,352	1,163,889
その他費用	19,392	50,753
営業費用合計	477,709	1,347,059
営業利益又は営業損失（ ）	14,233,335	151,678,521
経常利益又は経常損失（ ）	14,233,335	151,678,521
中間純利益又は中間純損失（ ）	14,233,335	151,678,521
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	447,752	8,773,756
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,717,078	66,123,211
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,788,466	20,917,539
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	5,126,056
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	9,788,466	15,791,483
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,459,632	-
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,459,632	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	29,831,495	97,699,093

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 290,279,634円	期首元本額 845,058,456円
期中追加設定元本額 673,047,247円	期中追加設定元本額 573,588,280円
期中一部解約元本額 118,268,425円	期中一部解約元本額 90,546,024円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 845,058,456口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 1,328,100,712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 66,123,211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 0.9218円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (9,218円)	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0736円 1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,736円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第2期 2020年 3月25日現在	第3期中間計算期間末 2020年 9月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左

<p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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。</p>	<p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>
--	---

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

「Smart-i 8資産バランス」の各ファンドは「RAM国内債券マザーファンド」、「RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）」、「RAM先進国債券マザーファンド」、「RAM新興国債券マザーファンド」、「RAM国内株式マザーファンド」、「RAM先進国株式マザーファンド」、「RAM新興国株式マザーファンド」、「RAM国内リートマザーファンド」および「RAM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RAM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2020年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	365,979
コール・ローン	962,603,102
国債証券	74,154,039,180
地方債証券	4,464,640,500
特殊債券	5,676,196,746
社債券	3,808,746,000
未収利息	82,841,416
前払費用	4,974,428

2020年 9月25日現在

流動資産合計	89,154,407,351
資産合計	89,154,407,351
負債の部	
流動負債	
未払金	160,755,200
未払解約金	301,158,000
未払利息	2,610
流動負債合計	461,915,810
負債合計	461,915,810
純資産の部	
元本等	
元本	84,245,510,674
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,446,980,867
元本等合計	88,692,491,541
純資産合計	88,692,491,541
負債純資産合計	89,154,407,351

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	57,341,519,752円
期中追加設定元本額	41,527,924,297円
期中一部解約元本額	14,623,933,375円
期末元本額	84,245,510,674円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,608,767,042円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,180,729,675円
りそなラップ型ファンド(成長型)	387,230,738円
DCりそな グローバルバランス	416,428,495円
つみたてバランスファンド	1,656,091,123円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,253,044,947円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	258,733,680円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	60,603,553円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,456,901円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,482,863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	275,456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	1,129,306,807円
FWりそな国内債券インデックスファンド	48,147,576,890円
Smart-i 国内債券インデックス	874,357,631円
Smart-i 8資産バランス 安定型	490,880,495円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	269,087,079円
Smart-i 8資産バランス 成長型	95,563,194円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,089,010,208円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,480,334,470円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,413,977,226円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	915,857,396円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,773,622,447円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	461,911,185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	84,245,510,674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	1.0528円
(10,000口当たり純資産額)	(10,528円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## R A M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25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	113,648,335
コール・ローン	2,287,988,357
国債証券	180,964,865,065
派生商品評価勘定	2,463,826,753
未収入金	10,977,949
未収利息	936,999,372
前払費用	138,759,100
流動資産合計	186,917,064,931
資産合計	
186,917,064,931	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	74,950,411
未払金	36,654,442
未払解約金	1,275,943,000
未払利息	6,205
流動負債合計	1,387,554,058
負債合計	
1,387,554,058	
純資産の部	
元本等	
元本	172,897,237,438
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,632,273,435
元本等合計	185,529,510,873
純資産合計	
185,529,510,873	
負債純資産合計	
186,917,064,931	

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

法	個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	96,308,797,975円
期中追加設定元本額	104,421,972,325円
期中一部解約元本額	27,833,532,862円
期末元本額	172,897,237,438円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	15,152,164,146円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	7,303,021,373円
りそなラップ型ファンド(成長型)	896,042,594円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,232,116,531円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	254,407,615円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	59,588,724円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,143,730円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,389,804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	270,220円
リスクコントロール・オープン	196,546,077円
FWりそな円建債券アクティブファンド	2,247,812,450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)	87,846,991,010円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	697,047,916円
Smart-i 8資産バランス 安定型	482,665,085円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	264,489,723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	12,129,196,678円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	9,739,104,283円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	5,551,890,861円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	3,596,196,293円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	10,901,287,235円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,813,721,333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)	7,282,117,719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FTRC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	172,897,237,438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	1.0731円
(10,000口当たり純資産額)	(10,731円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2020年 9月25日現在)

(単位:円)

--	--	--	--



区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益	
市場取引以外の取引	為替予約取引					
	買建	430,749,143	-	432,173,423	1,424,280	
	米ドル	195,198,584	-	195,974,685	776,101	
	カナダドル	8,282,872	-	8,293,394	10,522	
	ユーロ	186,534,497	-	187,061,148	526,651	
	英ポンド	29,732,113	-	29,928,249	196,136	
	オーストラリアドル	11,001,077	-	10,915,947	85,130	
	売建	183,292,374,912	-	180,904,922,850	2,387,452,062	
	米ドル	80,022,182,660	-	80,093,767,650	71,584,990	
	カナダドル	3,556,517,871	-	3,490,340,880	66,176,991	
	メキシコペソ	1,402,586,050	-	1,386,610,380	15,975,670	
	ユーロ	76,010,631,417	-	74,535,725,280	1,474,906,137	
	英ポンド	12,154,208,834	-	11,630,012,550	524,196,284	
	スウェーデンクローナ	584,426,294	-	553,900,000	30,526,294	
	ノルウェークローネ	409,774,381	-	379,339,840	30,434,541	
	デンマーククローネ	979,014,628	-	959,784,150	19,230,478	
	ポーランドズロチ	1,224,043,203	-	1,155,170,250	68,872,953	
	オーストラリアドル	4,548,850,255	-	4,358,268,110	190,582,145	
	シンガポールドル	810,592,620	-	801,110,240	9,482,380	
	マレーシアリンギット	836,408,016	-	832,192,800	4,215,216	
	イスラエルシェケル	753,138,683	-	728,700,720	24,437,963	
	合計		183,723,124,055	-	181,337,096,273	2,388,876,342

## (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。

## R A M先進国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2020年 9月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	132,155,393
コール・ローン	261,681,123
国債証券	27,342,657,733
派生商品評価勘定	462,741
未収利息	152,165,101
前払費用	12,570,763
<b>流動資産合計</b>	<b>27,901,692,854</b>
<b>資産合計</b>	<b>27,901,692,854</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	47,779
未払金	296,327,993
未払解約金	2,510,000
未払利息	709
<b>流動負債合計</b>	<b>298,886,481</b>
<b>負債合計</b>	<b>298,886,481</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	26,153,116,109
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,449,690,264
<b>元本等合計</b>	<b>27,602,806,373</b>
<b>純資産合計</b>	<b>27,602,806,373</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>27,901,692,854</b>

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。

4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	28,120,336,490円
期中追加設定元本額	7,615,465,611円
期中一部解約元本額	9,582,685,992円
期末元本額	26,153,116,109円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,344,695,772円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	452,167,073円
りそなラップ型ファンド(成長型)	241,236,764円
DCりそな グローバルバランス	61,813,036円
つみたてバランスファンド	410,469,847円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	673,288,878円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	138,556,424円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	32,455,614円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	9,933,661円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,963,906円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	312,184円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	103,970円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	225,672,930円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	92,098,406円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	18,803,429,186円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	513,445,865円
Smart-i 8資産バランス 安定型	271,474,041円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	137,476,947円
Smart-i 8資産バランス 成長型	53,474,513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)	693,341円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	687,353,751円
2. 計算日における受益権の総数	26,153,116,109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	1.0554円
(10,000口当たり純資産額)	(10,554円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## デリバティブ取引に関する注記

## （通貨関連）

（2020年 9月25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	176,945,330	-	177,360,292	414,962
	米ドル	74,423,609	-	74,623,850	200,241
	カナダドル	6,335,253	-	6,364,330	29,077
	ユーロ	71,479,878	-	71,678,442	198,564
	英ポンド	7,936,313	-	7,970,096	33,783
	オーストラリアド ル	5,872,787	-	5,833,744	39,043

	マレーシアリン ギット	6,808,370	-	6,809,446	1,076
	イスラエルシュケ ル	4,089,120	-	4,080,384	8,736
	合計	176,945,330	-	177,360,292	414,962

## (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ではありません。

## 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25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	27,517,434
コール・ローン	65,223,610
投資信託受益証券	5,009,852,984
派生商品評価勘定	35,892
未収入金	11,452,000
流動資産合計	5,114,081,920
資産合計	5,114,081,920
負債の部	
流動負債	
未払金	52,565,465
未払解約金	10,991,000
未払利息	176
流動負債合計	63,556,641
負債合計	63,556,641
純資産の部	
元本等	
元本	5,004,037,417
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	46,487,862
元本等合計	5,050,525,279
純資産合計	5,050,525,279

2020年 9月25日現在

負債純資産合計

5,114,081,920

## 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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	3,602,844,227円
期中追加設定元本額	2,133,562,523円
期中一部解約元本額	732,369,333円
期末元本額	5,004,037,417円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	661,494,360円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	461,357,645円
りそなラップ型ファンド(成長型)	245,762,186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	423,799,654円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	179,909,769円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	89,461,435円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	54,582,577円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,175,450円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,963,059円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,079,890円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,753,047円
リスクコントロール・オープン	1,842,535円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	85,947,895円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,765,456,382円
Smart-i 8資産バランス 安定型	34,034,880円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	69,428,040円
Smart-i 8資産バランス 成長型	68,661,797円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	234,188,391円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	188,034,641円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	107,073,057円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	69,437,458円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	204,608,303円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	35,018,773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	5,004,037,417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	1.0093円
(10,000口当たり純資産額)	(10,093円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25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。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2020年 9月25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	35,703,338	-	35,739,230	35,892
	米ドル	35,703,338	-	35,739,230	35,892
	合計	35,703,338	-	35,739,230	35,892

（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。

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25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	508,256,599
株式	30,186,199,934
派生商品評価勘定	5,824,050
未収入金	4,223,596
未収配当金	12,316,152
差入委託証拠金	22,185,000
流動資産合計	30,739,005,331
資産合計	30,739,005,331



2020年 9月25日現在

負債の部	
流動負債	
前受金	4,100,000
未払金	126,859,123
未払解約金	36,778,000
未払利息	1,378
流動負債合計	167,738,501
負債合計	167,738,501
純資産の部	
元本等	
元本	26,368,982,978
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,202,283,852
元本等合計	30,571,266,830
純資産合計	30,571,266,830
負債純資産合計	30,739,005,331

## 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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	17,556,595,424円
期中追加設定元本額	12,026,714,391円
期中一部解約元本額	3,214,326,837円
期末元本額	26,368,982,978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	33,763,483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	764,438,602円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	387,322,341円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	232,304,229円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,231,922円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,797,031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	11,616,353円
リスクコントロール・オープン	6,543,628円
FWりそな国内株式アクティブファンド	364,747,916円
FWりそな国内株式インデックスファンド	11,651,041,723円
Smart-i TOPIXインデックス	1,027,027,918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	297,779,663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	409,321,477円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	328,690,637円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	187,096,698円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	121,379,300円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	364,840,860円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	61,205,223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	26,368,982,978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	1.1594円
(10,000口当たり純資産額)	(11,594円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

### (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

### (その他の注記)

#### デリバティブ取引に関する注記

#### (株式関連)

(2020年 9月25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	-	469,510,000	5,824,050
	合計	463,685,950	-	469,510,000	5,824,050

### (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。

### R A M先進国株式マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位: 円)

2020年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,325,615,385
コール・ローン	676,052,572
株式	53,594,067,075
投資証券	1,277,286,257
派生商品評価勘定	3,375,244

2020年 9月25日現在

未収入金	229,782,133
未収配当金	58,265,303
差入委託証拠金	2,449,255,641
流動資産合計	67,613,699,610
資産合計	67,613,699,610
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	347,952,378
未払解約金	68,955,000
未払利息	1,833
流動負債合計	416,909,211
負債合計	416,909,211
純資産の部	
元本等	
元本	50,368,146,041
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	16,828,644,358
元本等合計	67,196,790,399
純資産合計	67,196,790,399
負債純資産合計	67,613,699,610

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 9月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	28,882,414,604円
期中追加設定元本額	29,284,045,624円
期中一部解約元本額	7,798,314,187円
期末元本額	50,368,146,041円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,948,847,745円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,898,193,586円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,472,327,881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	1,290,630,373円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	738,181,488円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	371,992,332円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	224,191,412円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	17,374,881円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,153,659円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,456,536円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	11,196,912円
リスクコントロール・オープン	36,101,824円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	203,645,021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	21,415,214,509円
Smart-i 先進国株式インデックス	3,430,005,263円
Smart-i 8資産バランス 安定型	130,638,590円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	274,819,239円
Smart-i 8資産バランス 成長型	292,861,810円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,120,019,754円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,701,653,181円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	969,069,572円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	628,368,312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	317,056,324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	50,368,146,041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	1,3341円
(10,000口当たり純資産額)	(13,341円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2020年 9月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	13,150,762,156	-	12,804,645,039	346,117,117
合計		13,150,762,156	-	12,804,645,039	346,117,117

(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25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,338,400,547	-	1,339,940,530	1,539,983
	米ドル	953,059,323	-	954,488,650	1,429,327
	カナダドル	33,117,690	-	33,126,140	8,450
	ユーロ	199,745,205	-	199,921,140	175,935
	英ポンド	43,477,586	-	43,620,120	142,534
	スイスフラン	38,519,443	-	38,488,060	31,383
	スウェーデンクローナ	15,225,630	-	15,114,800	110,830
	デンマーククローネ	12,977,181	-	12,991,750	14,569
	オーストラリアドル	28,505,364	-	28,424,620	80,744
	香港ドル	8,785,545	-	8,778,450	7,095
シンガポールドル	4,987,580	-	4,986,800	780	
合計		1,338,400,547	-	1,339,940,530	1,539,983

## (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。

## 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25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,480,970,530
コール・ローン	88,612,557
株式	7,856,442,284
投資証券	4,990,385
派生商品評価勘定	172,800
未収入金	22,153,423
未収配当金	12,004,505
差入委託証拠金	422,659,390
流動資産合計	9,888,005,874
資産合計	
9,888,005,874	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	52,438,848
未払金	1,355,161
未払解約金	19,855,000
未払利息	240
流動負債合計	73,649,249
負債合計	
73,649,249	
純資産の部	
元本等	
元本	7,673,306,077
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,141,050,548
元本等合計	9,814,356,625
純資産合計	
9,814,356,625	
負債純資産合計	
9,888,005,874	

### 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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	5,120,363,642円
期中追加設定元本額	3,582,372,913円
期中一部解約元本額	1,029,430,478円
期末元本額	7,673,306,077円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	518,390,983円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,038,147,208円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,037,405,859円
DCりそな グローバルバランス	9,587,428円
つみたてバランスファンド	332,101,368円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	270,480,395円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	138,033,171円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	83,015,108円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	6,400,379円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,467,203円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,653,172円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,081,231円
リスクコントロール・オープン	5,804,101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	1,562,220,426円
Smart-i 新興国株式インデックス	973,423,349円
Smart-i 8資産バランス 安定型	40,530,510円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	95,350,225円
Smart-i 8資産バランス 成長型	108,856,370円

りそな・リスクコントロールファンド2019-06	367,029,589円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	294,693,158円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	167,918,821円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	108,823,097円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	318,928,798円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	54,883,166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	7,673,306,077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	1.2790円
(10,000口当たり純資産額)	(12,790円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2020年 9月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,103,907,915	-	2,051,504,236	52,403,679
合計		2,103,907,915	-	2,051,504,236	52,403,679

## (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25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	203,905,908	-	204,043,543	137,635
	米ドル	159,473,578	-	159,598,543	124,965
	香港ドル	39,450,410	-	39,469,000	18,590
	南アフリカランド	4,981,920	-	4,976,000	5,920
	売建	6,957	-	6,961	4
	オフショア人民元	6,957	-	6,961	4
合計		203,912,865	-	204,050,504	137,631

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R A M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 9月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	288,485,666
投資証券	18,946,578,260
派生商品評価勘定	4,654,360
未収入金	6,834,204
未収配当金	194,263,640
前払金	3,672,400
差入委託証拠金	115,177,000
流動資産合計	19,559,665,530
資産合計	
19,559,665,530	
負債の部	
流動負債	
未払金	78,935,680
未払解約金	11,047,000
未払利息	782
流動負債合計	89,983,462
負債合計	
89,983,462	
純資産の部	
元本等	
元本	16,138,262,217
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,331,419,851
元本等合計	19,469,682,068
純資産合計	
19,469,682,068	
負債純資産合計	
19,559,665,530	

### 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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	13,315,659,788円
期中追加設定元本額	5,213,910,080円
期中一部解約元本額	2,391,307,651円
期末元本額	16,138,262,217円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	573,177,113円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	409,137,288円
りそなラップ型ファンド(成長型)	384,620,484円
DCりそな グローバルバランス	10,716,251円
つみたてバランスファンド	738,980,040円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	190,879,433円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	95,579,168円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	58,054,974円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,451,567円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,123,149円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,099,098円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,765,998円
リスクコントロール・オープン	1,621,865円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,345,816,850円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,382,553,537円
Smart-i Jリートインデックス	2,353,538,591円
Smart-i 8資産バランス 安定型	30,060,493円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	76,174,390円
Smart-i 8資産バランス 成長型	72,920,035円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	202,917,450円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	162,949,286円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	92,989,635円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	60,170,806円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	177,083,802円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	30,343,156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	16,138,262,217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	1.2064円
(10,000口当たり純資産額)	(12,064円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額

が異なることもあります。

また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額

自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## デリバティブ取引に関する注記

## （投資証券関連）

（2020年 9月25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	570,660,640	-	575,315,000	4,654,360
合計		570,660,640	-	575,315,000	4,654,360

## （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。

## 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25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	48,193,358
コール・ローン	190,963,730
株式	14,190,405
投資証券	20,183,250,636
派生商品評価勘定	377,623
未収入金	63,813,893
未収配当金	45,947,252
流動資産合計	20,546,736,897
資産合計	20,546,736,897
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	106,490
未払金	251,451,463
未払解約金	12,866,000
未払利息	517
流動負債合計	264,424,470
負債合計	264,424,470
純資産の部	
元本等	
元本	22,515,274,452
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,232,962,025
元本等合計	20,282,312,427
純資産合計	20,282,312,427
負債純資産合計	20,546,736,897

### 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	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	<p>受取配当金</p> <p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>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25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月26日
期首元本額	13,028,495,525円
期中追加設定元本額	12,017,579,862円
期中一部解約元本額	2,530,800,935円
期末元本額	22,515,274,452円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	736,445,119円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	803,045,453円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,942,255,592円
DCりそな グローバルバランス	13,266,264円
つみたてバランスファンド	471,586,983円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	271,049,434円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	135,101,838円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	81,251,465円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	6,167,883円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,331,224円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,618,393円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,038,839円
リスクコントロール・オープン	8,086,060円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,501,047,965円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,371,156,952円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,336,073,542円
Smart-i 8資産バランス 安定型	37,437,938円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	94,873,746円
Smart-i 8資産バランス 成長型	106,137,379円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	521,201,067円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	418,320,635円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	238,036,766円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	154,479,740円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	440,509,637円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	77,938,444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D A A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	22,515,274,452口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	2,232,962,025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	0.9008円
(10,000口当たり純資産額)	(9,008円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2020年 9月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2020年 9月25日現在)

(単位:円)

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	340,668,932	-	340,940,065	271,133
	米ドル	257,976,898	-	258,280,850	303,952
	カナダドル	3,240,035	-	3,241,460	1,425
	ユーロ	16,740,520	-	16,752,480	11,960
	英ポンド	18,330,274	-	18,376,995	46,721
	オーストラリアドル	25,532,913	-	25,448,220	84,693
	香港ドル	7,482,701	-	7,485,500	2,799
	シンガポールドル	11,365,591	-	11,354,560	11,031
	合計	340,668,932	-	340,940,065	271,133

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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。

## 【Smart-i 8資産バランス 安定型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,845,488,840円
負債総額	1,745,612円
純資産総額（ - ）	1,843,743,228円
発行済口数	1,705,112,491口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0813円

## 【Smart-i 8資産バランス 安定成長型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,852,959,604円
負債総額	14,422,514円
純資産総額（ - ）	1,838,537,090円
発行済口数	1,693,130,739口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0859円

## 【Smart-i 8資産バランス 成長型】

## 【純資産額計算書】

資産総額	1,473,260,868円
負債総額	657,937円
純資産総額（ - ）	1,472,602,931円
発行済口数	1,354,598,270口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0871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

## R A M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

## R A M先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	28,541,156,968円
負債総額	286,926,933円
純資産総額（ - ）	28,254,230,035円
発行済口数	26,572,585,234口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0633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

#### 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ます。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたと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ます。

##### （5）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

##### （6）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

2020年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
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社りそな銀行	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【資本関係】

### (1) 受託会社

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

- (1) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- (2) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。
- (3) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- (4) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
 

ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。

本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。

ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。

ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- (5) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- (6) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所

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

### 監査意見

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

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

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業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5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

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Smart-i 8資産バランス 安定型の2019年3月26日から2020年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Smart-i 8資産バランス 安定型の2020年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

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Smart-i 8資産バランス 安定成長型の2019年3月26日から2020年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Smart-i 8資産バランス 安定成長型の2020年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の監査報告書

2020年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

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Smart-i 8資産バランス 成長型の2019年3月26日から2020年3月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、Smart-i 8資産バランス 成長型の2020年3月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年11月19日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

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Smart-i 8資産バランス 安定型の2020年3月26日から2020年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要なに応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Smart-i 8資産バランス 安定型の2020年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年3月26日から2020年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年11月19日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中有限責任監査法人 トーマツ指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

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Smart-i 8資産バランス 安定成長型の2020年3月26日から2020年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Smart-i 8資産バランス 安定成長型の2020年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年3月26日から2020年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の中間監査報告書

2020年11月19日

りそなアセットマネジメント株式会社

取締役会御中

### 有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印  
業務執行社員

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Smart-i 8資産バランス 成長型の2020年3月26日から2020年9月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要なに応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、Smart-i 8資産バランス 成長型の2020年9月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年3月26日から2020年9月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

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

2. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。