

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年11月17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6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】	リスクコントロール・オープン
【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】	(1)当初申込額 1,000億円を上限とします。 (2)継続申込額 1兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

有価証券報告書を提出しましたので2020年2月14日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第二部【ファンド情報】

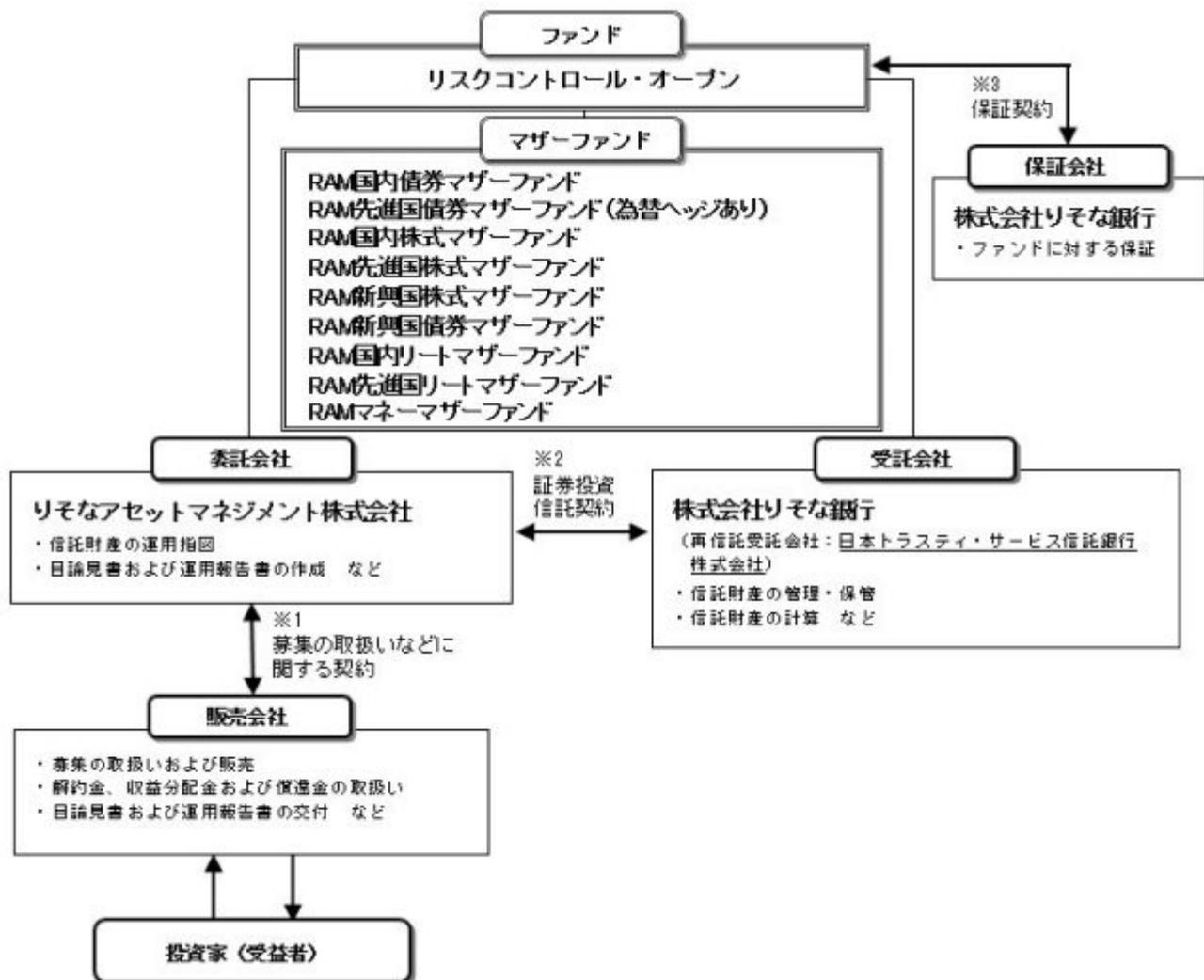
第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(3)【ファンドの仕組み】

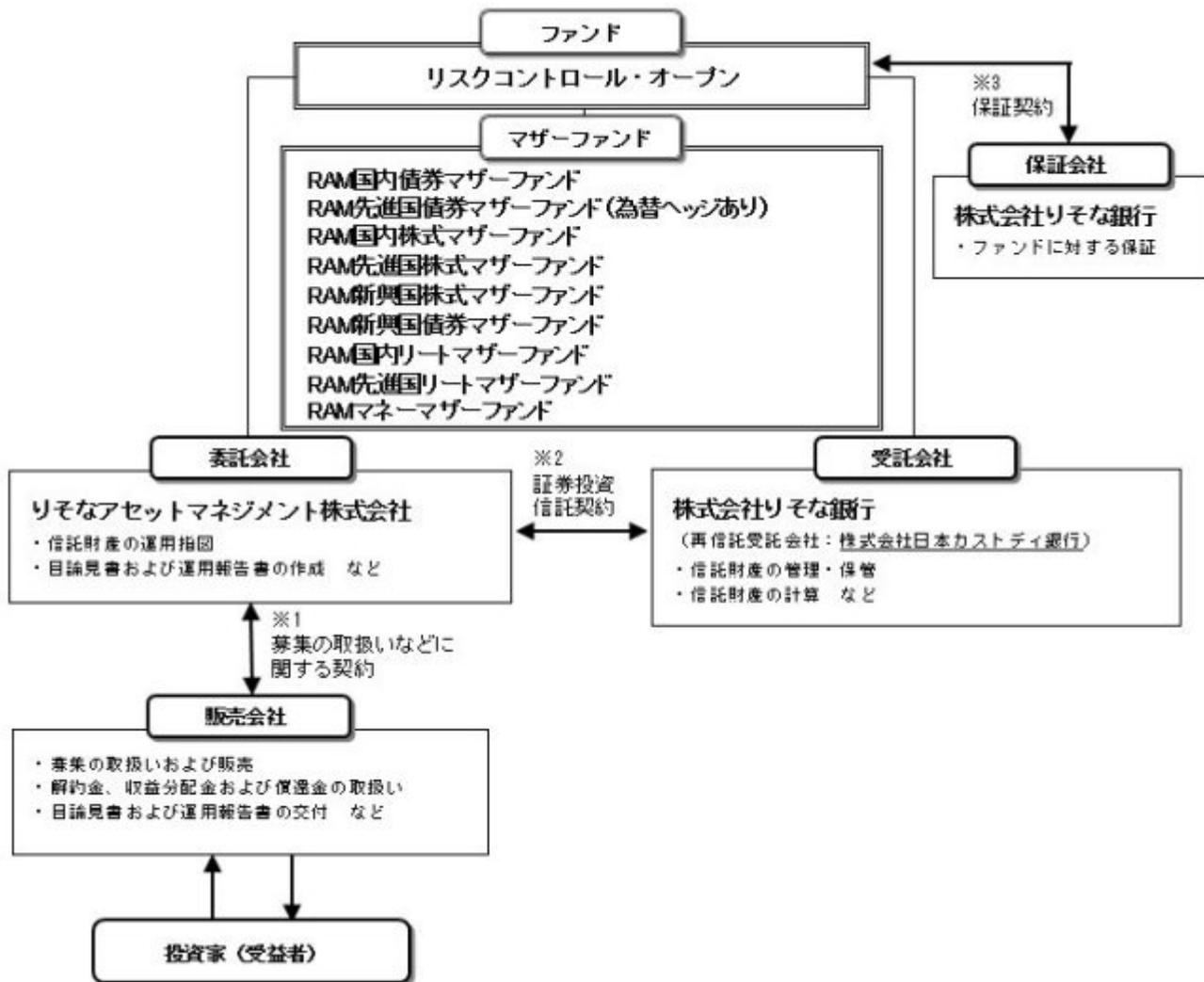
ファンドの仕組み

<訂正前>



(略)

<訂正後>



(略)

<更新後>

委託会社の概況（2020年8月末現在）

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

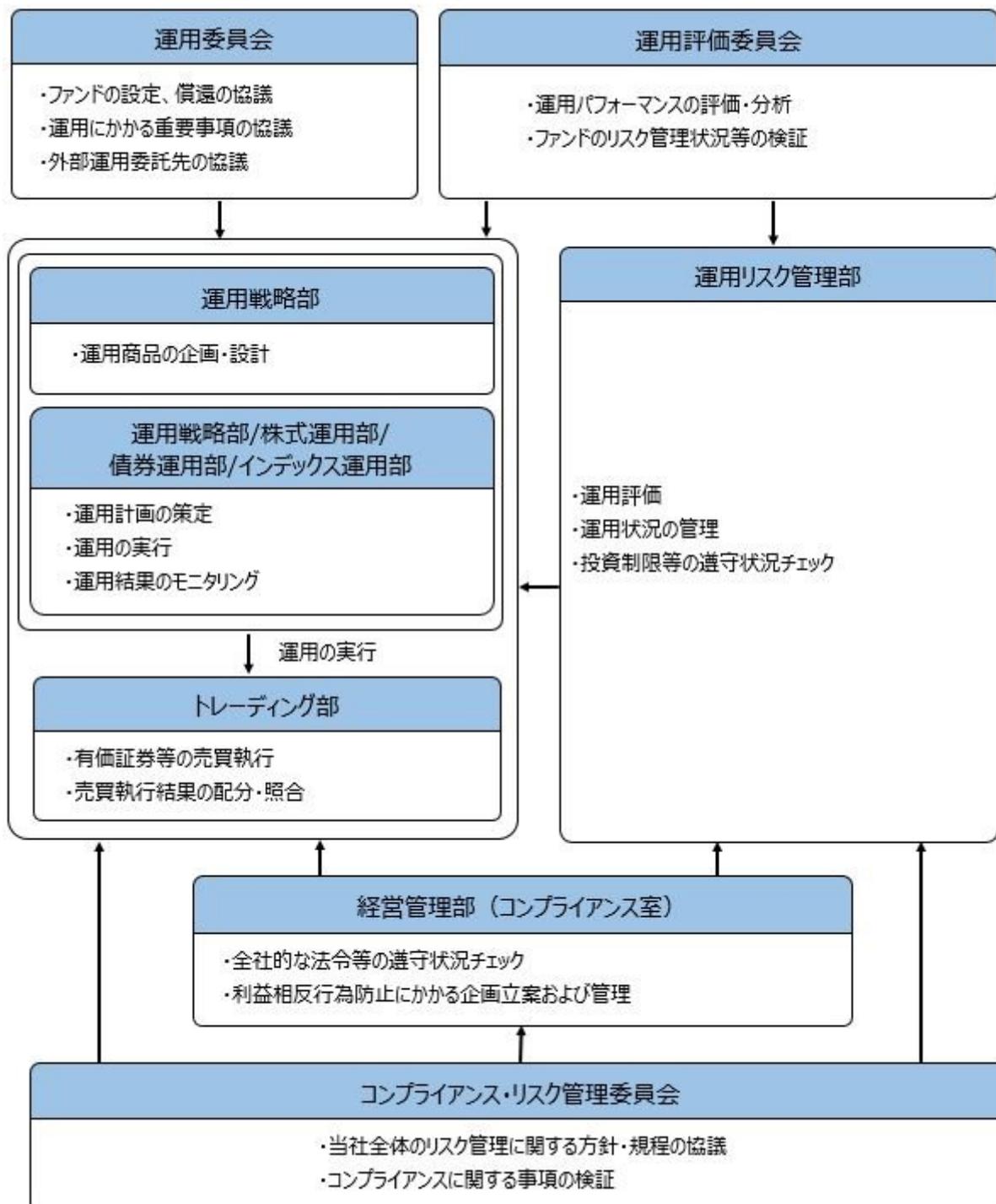
名 称	住 所	所有株数	所有比率
株式会社りそなホールディングス	東京都江東区木場一丁目5番65号	3,960,000株	100%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<更新後>

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8月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

3【投資リスク】

<更新後>

(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り締役会等に報告します。

上記体制は2020年8月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<更新後>

【参考情報】

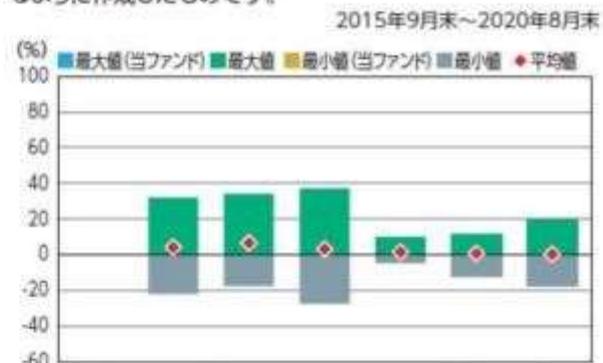
ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



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

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



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 (%)

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

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2015年9月から2020年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
* 決算日に対応した数値とは異なります。

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

各資産クラスの指数	
日本株	・東証株価指数(TOPIX、配当込み)
先進国株	・MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)
新興国株	・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
日本国債	・NOMURA-BPI国債
先進国債	・FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)
新興国債	・JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)
(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。	
○ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について	
騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。	
東証株価指数(TOPIX、配当込み)	
東証株価指数(TOPIX、配当込み)は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、TOPIXに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。	
MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)	
MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。	
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	
MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、MSCI Indexに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、MSCI Inc.に帰属します。	
NOMURA-BPI国債	
NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が発表している日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI国債に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券株式会社に帰属します。	
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)	
FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の待機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】

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(略)

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2019年10月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

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

上記は2020年8月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【リスクコントロール・オープン】

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	337,810,783	99.93
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		240,483	0.07
合計(純資産総額)		338,051,266	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	195,304,406	1.0667	208,333,356	1.0637	207,745,296	61.45
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	49,790,094	1.0497	52,264,756	1.0495	52,254,703	15.46
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	35,462,854	1.3972	49,548,844	1.4301	50,715,427	15.00
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	5,788,361	1.3309	7,703,825	1.3547	7,841,492	2.32
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	7,986,752	0.9616	7,680,307	0.9697	7,744,753	2.29
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	6,674,759	1.1415	7,619,892	1.1479	7,661,955	2.27
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	1,587,956	1.1684	1,855,419	1.2149	1,929,207	0.57

日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	1,853,809	1.0388	1,925,854	1.0346	1,917,950	0.57
----	-----------	-----------------	-----------	--------	-----------	--------	-----------	------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.93
合 計	99.93

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

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

【分配の推移】

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

【収益率の推移】

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

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

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1特定期間	2020年 3月31日～2020年 8月17日	333,507,277	10,494,560

(注)第1特定期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

R A M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	72,680,331,240	83.64
地方債証券	日本	4,456,805,200	5.13
特殊債券	日本	5,405,282,826	6.22
社債券	日本	3,501,790,000	4.03
	フランス	98,564,000	0.11
	オーストラリア	100,198,000	0.12
	小計	3,700,552,000	4.26
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		650,706,641	0.75
合計（純資産総額）		86,893,677,907	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第133回利付国債（5年）	1,280,000,000	100.66	1,288,557,000	100.45	1,285,785,600	0.100	2022/9/20	1.48
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	1,070,000,000	101.00	1,080,752,900	100.78	1,078,367,400	0.100	2024/6/20	1.24
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	1,060,000,000	100.72	1,067,646,500	100.49	1,065,257,600	0.100	2022/12/20	1.23
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	1,000,000,000	100.72	1,007,262,400	100.54	1,005,490,000	0.100	2023/3/20	1.16
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	940,000,000	100.90	948,507,500	100.73	946,862,000	0.100	2024/3/20	1.09

日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	910,000,000	101.30	921,897,300	100.72	916,570,200	0.100	2029/9/20	1.05
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	870,000,000	101.83	885,948,000	101.08	879,439,500	0.100	2027/3/20	1.01
日本	国債証券	第136回利付国債(5年)	850,000,000	100.82	856,970,000	100.60	855,125,500	0.100	2023/6/20	0.98
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	814,000,000	103.09	839,166,700	102.40	833,601,120	0.400	2025/9/20	0.96
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	790,000,000	101.42	801,240,300	100.96	797,639,300	0.100	2028/9/20	0.92
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	760,000,000	101.22	769,287,600	100.64	764,932,400	0.100	2029/12/20	0.88
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	730,000,000	101.77	742,954,900	101.05	737,730,700	0.100	2028/3/20	0.85
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	720,000,000	100.90	726,484,900	100.67	724,888,800	0.100	2023/12/20	0.83
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	720,000,000	100.85	726,151,400	100.61	724,449,600	0.100	2030/3/20	0.83
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	690,000,000	101.51	700,480,300	101.03	697,127,700	0.100	2026/9/20	0.80
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	680,000,000	101.50	690,230,500	101.01	686,929,200	0.100	2026/6/20	0.79
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	680,000,000	101.09	687,446,200	100.84	685,725,600	0.100	2024/12/20	0.79
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	650,000,000	100.83	655,418,000	100.64	654,179,500	0.100	2023/9/20	0.75
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	640,000,000	101.49	649,574,400	101.04	646,681,600	0.100	2026/12/20	0.74
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	640,000,000	101.50	649,627,000	100.85	645,465,600	0.100	2029/3/20	0.74
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	640,000,000	101.40	648,960,000	100.79	645,062,400	0.100	2029/6/20	0.74
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	631,000,000	102.78	648,591,900	102.21	644,970,340	0.400	2025/3/20	0.74
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	630,000,000	100.95	636,034,000	100.84	635,310,900	0.100	2025/6/20	0.73
日本	国債証券	第141回利付国債(5年)	620,000,000	101.03	626,409,800	100.81	625,040,600	0.100	2024/9/20	0.72
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	590,000,000	101.35	597,975,200	100.91	595,386,700	0.100	2028/12/20	0.69
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	570,000,000	100.69	573,950,200	100.53	573,055,200	0.100	2030/6/20	0.66
日本	国債証券	第414回利付国債(2年)	570,000,000	100.46	572,645,000	100.43	572,456,700	0.100	2022/7/1	0.66
日本	国債証券	第413回利付国債(2年)	550,000,000	100.46	552,569,700	100.42	552,359,500	0.100	2022/6/1	0.64
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	532,000,000	102.98	547,859,440	102.33	544,422,200	0.600	2023/12/20	0.63
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	520,000,000	102.49	532,981,900	101.99	530,374,000	0.300	2025/12/20	0.61

ロ.種類別の投資比率

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

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	80,885,597,015	44.14
	カナダ	3,521,425,622	1.92
	メキシコ	1,381,654,171	0.75
	ドイツ	14,083,278,735	7.69
	イタリア	17,581,125,306	9.59
	フランス	19,321,552,849	10.54
	オランダ	3,572,415,178	1.95
	スペイン	11,243,755,554	6.14
	ベルギー	4,800,974,305	2.62
	オーストリア	2,927,000,654	1.60
	フィンランド	1,116,980,776	0.61
	アイルランド	1,510,898,268	0.82
	イギリス	11,985,061,580	6.54
	スウェーデン	547,542,065	0.30
	ノルウェー	406,886,486	0.22
	デンマーク	967,409,515	0.53
	ポーランド	1,108,507,391	0.60
	オーストラリア	4,356,419,042	2.38
	シンガポール	804,014,236	0.44
	マレーシア	910,241,080	0.50
イスラエル	733,266,497	0.40	
	小計	183,766,006,325	100.29
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		526,143,965	0.29
合計（純資産総額）		183,239,862,360	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	----	------	---------	---------

為替予約取引	売建		187,306,269,140	102.22
--------	----	--	-----------------	--------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	13,317.50	839,002,752	14,156.92	891,886,343	3.000	2048/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,750,000	10,888.95	843,894,090	10,893.85	844,273,618	1.625	2022/12/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	11,054.98	840,179,201	11,103.13	843,838,097	1.500	2024/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,537.39	812,423,268	12,663.36	820,586,110	3.125	2028/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,560,000	10,879.47	822,488,204	10,823.27	818,239,239	2.000	2022/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,500.57	768,642,350	10,447.10	764,727,902	0.625	2030/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,770,000	11,042.49	747,577,012	11,061.56	748,867,962	1.375	2025/1/31	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,870,000	12,143.23	712,807,707	12,416.42	728,844,347	2.875	2028/8/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,130,000	22,838.96	714,859,644	23,032.65	720,922,050	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	14,532.97	733,915,078	14,202.61	717,231,814	3.000	2048/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,270.72	710,055,379	11,319.61	713,135,745	1.500	2030/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,337.43	692,717,451	11,434.44	698,644,317	2.375	2024/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,331.95	695,522,222	12,275.05	692,313,178	2.625	2029/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,590,000	11,669.90	652,347,518	12,376.71	691,858,254	2.875	2028/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,330.43	661,697,465	11,434.44	667,771,327	2.500	2024/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,445.02	635,198,752	11,804.02	655,123,298	2.250	2027/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,230,000	15,427.81	652,596,513	15,396.49	651,271,906	2.750	2027/10/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	19,151.86	658,824,063	18,880.88	649,502,572	5.500	2029/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,297.35	629,262,822	11,594.53	645,815,778	2.250	2025/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,299.03	619,187,023	11,405.63	625,028,574	2.750	2023/11/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,940,000	15,814.82	623,104,242	15,834.08	623,862,873	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,664.13	611,200,524	11,830.36	619,911,042	2.250	2027/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,600,000	10,955.03	613,481,779	10,900.43	610,424,536	2.375	2022/3/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,300,000	11,112.91	588,984,504	11,429.50	605,763,567	2.000	2025/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,010,000	11,029.08	552,557,148	12,086.76	605,547,051	2.375	2029/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,350,000	10,732.31	574,178,863	11,265.49	602,703,912	2.125	2024/3/31	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,090,000	14,600.77	597,171,642	14,710.78	601,670,916	1.500	2031/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,850,000	11,714.96	568,175,926	12,243.36	593,803,259	2.750	2028/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,530,000	10,526.26	582,102,294	10,535.58	582,618,018	0.125	2022/4/30	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,770,000	15,493.79	584,116,243	15,413.59	581,092,691	3.500	2026/4/25	0.32

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.29
合計	100.29

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	29,304,098,049	98.31
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		503,396,094	1.69
合計（純資産総額）		29,807,494,143	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	484,800,000	1.63

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	144,200	7,219.94	1,041,115,610	7,006.00	1,010,265,200	3.39
日本	株式	ソニー	電気機器	81,000	7,574.00	613,494,622	8,309.00	673,029,000	2.26
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	100,700	4,983.16	501,804,240	6,598.00	664,418,600	2.23
日本	株式	キーエンス	電気機器	11,700	40,096.28	469,126,556	43,680.00	511,056,000	1.71
日本	株式	任天堂	その他製品	7,900	43,840.72	346,341,736	56,740.00	448,246,000	1.50
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	107,600	4,028.91	433,510,956	3,959.00	425,988,400	1.43
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	169,600	2,653.74	450,074,513	2,411.50	408,990,400	1.37
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	872,200	496.06	432,665,357	442.50	385,948,500	1.29
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	88,500	3,933.50	348,115,045	4,026.00	356,301,000	1.20
日本	株式	第一三共	医薬品	37,000	7,827.29	289,610,001	9,447.00	349,539,000	1.17
日本	株式	ダイキン工業	機械	16,500	16,073.21	265,207,998	19,965.00	329,422,500	1.11
日本	株式	KDDI	情報・通信業	92,500	3,245.05	300,167,475	3,078.00	284,715,000	0.96
日本	株式	信越化学工業	化学	21,700	12,279.48	266,464,820	12,885.00	279,604,500	0.94
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	101,800	2,780.43	283,048,294	2,729.00	277,812,200	0.93
日本	株式	日本電産	電気機器	31,100	7,070.73	219,899,822	8,911.00	277,132,100	0.93
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	88,200	3,419.48	301,598,701	3,118.00	275,007,600	0.92
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	90,700	3,067.56	278,227,706	2,959.00	268,381,300	0.90
日本	株式	HOYA	精密機器	25,600	10,563.79	270,433,147	10,415.00	266,624,000	0.89
日本	株式	花王	化学	31,000	8,765.46	271,729,294	8,069.00	250,139,000	0.84
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1,732,600	146.08	253,106,477	143.80	249,147,880	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	89,100	2,456.25	218,851,953	2,723.50	242,663,850	0.81
日本	株式	S M C	機械	4,100	50,764.52	208,134,547	58,250.00	238,825,000	0.80
日本	株式	村田製作所	電気機器	38,000	6,353.60	241,436,803	6,280.00	238,640,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	12,200	19,128.72	233,370,431	18,605.00	226,981,000	0.76
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	8,200	24,997.64	204,980,692	27,150.00	222,630,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	45,100	5,391.37	243,150,862	4,890.00	220,539,000	0.74
日本	株式	日立製作所	電気機器	62,100	3,884.68	241,238,675	3,530.00	219,213,000	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	110,200	1,782.68	196,451,837	1,914.00	210,922,800	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	83,500	2,587.37	216,045,620	2,512.50	209,793,750	0.70
日本	株式	中外製薬	医薬品	40,400	4,217.72	170,395,999	4,721.00	190,728,400	0.64

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09

鉱業	0.17
建設業	2.49
食料品	3.71
繊維製品	0.48
パルプ・紙	0.21
化学	7.05
医薬品	6.46
石油・石炭製品	0.42
ゴム製品	0.55
ガラス・土石製品	0.75
鉄鋼	0.57
非鉄金属	0.67
金属製品	0.55
機械	5.37
電気機器	14.80
輸送用機器	7.16
精密機器	2.56
その他製品	2.65
電気・ガス業	1.41
陸運業	3.78
海運業	0.14
空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	10.00
卸売業	4.69
小売業	4.90
銀行業	4.89
証券、商品先物取引業	0.82
保険業	1.96
その他金融業	1.10
不動産業	1.96
サービス業	5.42
合 計	98.31

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	30	日本円	483,576,500	484,800,000	1.63

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

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 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	32,747,100,161	46.65
	カナダ	1,667,694,220	2.38
	パナマ	6,716,262	0.01
	ドイツ	1,499,363,499	2.14
	イタリア	293,295,277	0.42
	フランス	1,607,249,151	2.29
	オランダ	899,939,776	1.28
	スペイン	366,652,568	0.52
	ベルギー	147,014,027	0.21
	オーストリア	28,657,282	0.04
	ルクセンブルク	34,926,737	0.05
	フィンランド	199,089,813	0.28
	アイルランド	871,723,957	1.24
	ポルトガル	25,176,312	0.04
	イギリス	2,454,625,266	3.50
	スイス	1,734,587,530	2.47
	スウェーデン	487,567,769	0.69
	ノルウェー	86,068,696	0.12
	デンマーク	388,534,813	0.55
	ケイマン	95,492,873	0.14
	リベリア	11,584,138	0.02
	オーストラリア	1,001,489,412	1.43
	バミューダ	141,174,608	0.20
	ニュージーランド	51,852,961	0.07
	パプアニューギニア	3,577,732	0.01
	香港	398,294,583	0.57
	シンガポール	139,819,485	0.20
	イスラエル	98,941,974	0.14
	キュラソー	30,848,917	0.04
	ジャージー	173,819,447	0.25
マン島	7,860,078	0.01	
小計		47,700,739,324	67.95
投資証券	アメリカ	966,570,908	1.38
	カナダ	7,731,615	0.01

	フランス	21,127,870	0.03
	イギリス	26,925,136	0.04
	オーストラリア	68,051,618	0.10
	香港	20,558,712	0.03
	シンガポール	27,605,912	0.04
	小計	1,138,571,771	1.62
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		21,364,027,265	30.43
合計(純資産総額)		70,203,338,360	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	16,965,823,669	24.17
	買建	ドイツ	4,361,261,904	6.21

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	46,585	34,864.91	1,624,182,256	52,598.87	2,450,318,489	3.49
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	76,921	18,605.96	1,431,189,221	24,117.95	1,855,177,417	2.64
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	4,506	228,839.99	1,031,153,022	358,413.64	1,615,011,898	2.30
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	25,641	23,589.87	604,868,046	30,940.01	793,332,991	1.13
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	3,272	154,729.47	506,274,851	173,255.03	566,890,483	0.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,198	154,882.63	495,314,677	172,730.34	552,391,643	0.79
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	28,077	15,526.33	435,932,868	16,187.51	454,496,730	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	18,183	21,277.34	386,885,899	22,727.20	413,248,779	0.59
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	31,738	12,563.76	398,748,773	12,693.07	402,852,846	0.57
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	26,285	13,036.45	342,663,294	14,620.80	384,307,917	0.55
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	9,541	33,341.30	318,109,400	38,574.40	368,038,381	0.52
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	1,574	81,523.47	128,317,944	233,203.82	367,062,819	0.52

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,520	31,334.79	204,302,842	55,409.87	361,272,402	0.51
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	32,764	12,816.63	419,924,376	10,827.84	354,763,586	0.51
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	11,640	25,003.84	291,044,713	30,163.51	351,103,308	0.50
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	14,800	22,289.44	329,883,739	23,026.42	340,791,134	0.49
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	10,112	31,112.41	314,608,727	33,122.02	334,929,899	0.48
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	5,143	39,672.93	204,037,920	54,412.11	279,841,525	0.40
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	44,223	6,213.14	274,763,989	6,243.63	276,112,209	0.39
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	19,296	13,980.99	269,777,340	14,280.49	275,556,420	0.39
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7,497	37,987.75	284,794,175	36,554.10	274,046,088	0.39
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	4,689	41,204.87	193,209,660	55,197.05	258,818,969	0.37
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	8,995	19,457.19	175,017,441	28,563.09	256,925,049	0.37
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	11,889	14,143.76	168,155,246	21,544.01	256,136,768	0.36
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	27,061	8,828.34	238,903,970	9,024.08	244,200,737	0.35
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	76,714	3,805.57	291,940,567	3,165.01	242,800,915	0.35
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	45,561	6,948.35	316,574,220	5,313.30	242,079,480	0.34
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	59,057	4,048.44	239,089,249	3,994.19	235,885,328	0.34
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	83,806	3,260.56	273,254,881	2,770.96	232,223,744	0.33
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	43,505	5,678.49	247,042,734	5,250.08	228,405,113	0.33

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	2.14
		素材	3.05
		資本財	4.27
		商業・専門サービス	0.85
		運輸	1.39
		自動車・自動車部品	1.06
		耐久消費財・アパレル	1.22
		消費者サービス	1.08
		メディア・娯楽	4.77

	小売	4.44
	食品・生活必需品小売り	1.06
	食品・飲料・タバコ	3.10
	家庭用品・パーソナル用品	1.54
	ヘルスケア機器・サービス	3.61
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	5.79
	銀行	3.63
	各種金融	2.95
	保険	2.16
	不動産	0.29
	ソフトウェア・サービス	8.68
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.49
	電気通信サービス	1.42
	公益事業	2.26
	半導体・半導体製造装置	2.71
投資証券		1.62
合計		69.57

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2009	買建	919	米ドル	144,264,160	15,199,671,897	161,027,180	16,965,823,669	24.17
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002009	買建	1,885	ユーロ	33,931,223	4,257,350,550	34,759,400	4,361,261,904	6.21

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

RAM新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	25,715,199	0.26
	アルゼンチン	1,784,693	0.02
	メキシコ	110,729,616	1.10
	ブラジル	345,323,570	3.43

	チリ	37,259,303	0.37
	コロンビア	12,974,667	0.13
	ペルー	3,045,399	0.03
	オランダ	5,614,592	0.06
	ルクセンブルク	9,681,007	0.10
	ギリシャ	8,992,389	0.09
	トルコ	24,126,193	0.24
	チェコ	6,364,299	0.06
	ハンガリー	13,995,154	0.14
	ポーランド	49,199,674	0.49
	ロシア	223,543,789	2.22
	ケイマン	1,890,098,690	18.75
	バミューダ	55,529,327	0.55
	香港	167,628,704	1.66
	シンガポール	1,742,840	0.02
	マレーシア	141,605,845	1.41
	タイ	133,099,285	1.32
	フィリピン	59,330,519	0.59
	インドネシア	98,572,723	0.98
	韓国	801,544,309	7.95
	台湾	839,312,082	8.33
	中国	817,343,123	8.11
	インド	587,492,770	5.83
	カタール	53,744,776	0.53
	エジプト	8,537,060	0.08
	南アフリカ	245,504,065	2.44
	ジャージー	8,698,528	0.09
	アラブ首長国連邦	34,513,197	0.34
	マン島	2,135,355	0.02
	サウジアラビア	176,193,696	1.75
	小計	7,000,976,438	69.47
投資証券	メキシコ	2,868,464	0.03
	南アフリカ	2,596,116	0.03
	小計	5,464,580	0.05
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		3,071,793,142	30.48
合計(純資産総額)		10,078,234,160	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,052,690,088	30.29

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		16,102	0.00
	売建		16,872,171	0.17

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	18,930	22,800.89	431,620,936	30,449.03	576,400,327	5.72
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	57,700	5,549.59	320,211,714	7,350.80	424,141,160	4.21
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	248,000	1,178.87	292,359,776	1,557.30	386,210,400	3.83
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	48,081	5,270.78	253,424,664	4,947.22	237,867,285	2.36
ケイマン	株式	MEITUAN DIANPING-CLASS B	小売	35,900	1,957.02	70,257,120	3,606.72	129,481,248	1.28
南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	4,489	16,538.89	74,243,078	19,968.61	89,639,132	0.89
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	28,830	2,239.40	64,562,006	3,068.41	88,462,477	0.88
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	971,000	87.12	84,599,158	76.84	74,611,640	0.74
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	8,620	4,918.96	42,401,461	8,424.58	72,619,928	0.72
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	60,000	1,232.17	73,930,478	1,132.88	67,972,800	0.67
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信 サービス	62,000	899.75	55,784,796	758.88	47,050,560	0.47
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェ ア・サービ ス	34,508	1,115.74	38,502,274	1,356.11	46,796,730	0.46
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	16,605	3,303.77	54,859,234	2,730.71	45,343,481	0.45
ブラジル	株式	VALE SA	素材	37,400	1,050.11	39,274,361	1,194.50	44,674,487	0.44
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	32,945	1,590.45	52,397,456	1,272.22	41,913,353	0.42
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・ 娯楽	782	37,130.12	29,035,760	53,119.35	41,539,333	0.41
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	5,510	8,458.76	46,607,800	6,947.53	38,280,945	0.38
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	615,000	75.01	46,136,832	61.20	37,638,000	0.37
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・ 娯楽	2,750	13,426.09	36,921,770	13,591.44	37,376,460	0.37
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	72,632	691.89	50,253,802	512.68	37,237,101	0.37
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・ 娯楽	1,247	17,556.44	21,892,892	29,736.89	37,081,914	0.37
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	5,076	9,789.81	49,693,105	7,206.62	36,580,823	0.36
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロ ジー・ハー ドウェアお よび機器	8,329	4,247.33	35,376,066	4,304.26	35,850,182	0.36

台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	125,800	319.55	40,200,035	277.45	34,903,210	0.35
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	107,200	180.31	19,330,282	306.00	32,803,200	0.33
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	469	33,823.88	15,863,403	67,778.69	31,788,210	0.32
ケイマン	株式	TAL EDUCATION GROUP- ADR	消費者サービス	3,900	5,508.51	21,483,213	8,105.34	31,610,845	0.31
台湾	株式	MEDIA TEK INC	半導体・半導体製造装置	15,000	1,565.71	23,485,713	2,054.92	30,823,800	0.31
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	51,487	691.76	35,616,864	594.06	30,586,625	0.30
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	9,183	3,141.55	28,848,926	3,245.89	29,807,077	0.30

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.01
		素材	5.04
		資本財	1.92
		商業・専門サービス	0.22
		運輸	0.96
		自動車・自動車部品	1.61
		耐久消費財・アパレル	0.88
		消費者サービス	1.19
		メディア・娯楽	6.53
		小売	9.89
		食品・生活必需品小売り	0.95
		食品・飲料・タバコ	2.60
		家庭用品・パーソナル用品	0.80
		ヘルスケア機器・サービス	0.96
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.04
		銀行	8.76
		各種金融	1.41
		保険	2.22
		不動産	1.60
		ソフトウェア・サービス	1.39
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.34		
電気通信サービス	2.43		
公益事業	1.42		
半導体・半導体製造装置	5.30		
投資証券			0.05
合計			69.52

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 2009	買建	515	米ドル	25,974,250	2,736,646,975	28,973,900	3,052,690,088	30.29

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	152.85	15,922	16,102	0.00
	米ドル	売建	160,000.00	17,064,000	16,856,000	0.17
	ブラジルリアル	売建	689.44	13,202	13,478	0.00
	オフショア人民元	売建	175.50	2,720	2,693	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,508,385,654	29.78
	アイルランド	3,514,180,592	69.38
	小計	5,022,566,246	99.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		42,595,298	0.84
合計(純資産総額)		5,065,161,544	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	594,705	6,095.11	3,624,794,260	5,909.11	3,514,180,592	69.38

アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	452,767	3,486.86	1,578,735,406	3,331.48	1,508,385,654	29.78
------	----------	------------------------------	---------	----------	---------------	----------	---------------	-------

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.16
合計	99.16

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	18,906,550,660	97.65
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		454,589,137	2.35
合計(純資産総額)		19,361,139,797	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
不動産投信指数先物取引	買建	日本	449,107,500	2.32

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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	2,006	801,632.18	1,608,074,163	639,000	1,281,834,000	6.62
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,072	729,318.22	1,511,147,364	594,000	1,230,768,000	6.36
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,135	301,372.59	944,803,097	347,000	1,087,845,000	5.62

日本	投資証券	GLP投資法人	5,958	142,572.04	849,444,244	163,600	974,728,800	5.03
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,700	171,140.63	1,146,642,273	135,900	910,530,000	4.70
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,956	277,535.55	820,395,089	277,000	818,812,000	4.23
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,128	208,033.66	858,762,981	157,700	650,985,600	3.36
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,916	203,436.49	796,657,309	159,900	626,168,400	3.23
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,968	337,584.56	664,366,420	314,000	617,952,000	3.19
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,929	169,408.06	496,196,217	185,200	542,450,800	2.80
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,431	172,425.09	764,015,606	118,000	522,858,000	2.70
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	6,094	85,058.95	518,349,280	74,900	456,440,600	2.36
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	689	681,074.83	469,260,560	653,000	449,917,000	2.32
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,038	508,898.14	528,236,270	399,500	414,681,000	2.14
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,290	439,678.74	567,185,585	320,500	413,445,000	2.14
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	641	782,048.93	501,293,369	629,000	403,189,000	2.08
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,354	285,713.12	386,855,566	285,000	385,890,000	1.99
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	1,937	165,545.33	320,661,308	178,000	344,786,000	1.78
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,675	63,557.78	424,248,248	49,200	328,410,000	1.70
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,434	170,853.97	415,858,564	132,100	321,531,400	1.66
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	594	516,174.07	306,607,398	530,000	314,820,000	1.63
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	904	346,606.44	313,332,226	327,000	295,608,000	1.53
日本	投資証券	大和証券りびング投資法人	2,614	102,975.83	269,178,836	105,800	276,561,200	1.43
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,664	46,716.03	404,747,732	31,700	274,648,800	1.42
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	441	787,453.83	347,267,142	614,000	270,774,000	1.40
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,352	204,683.03	276,731,468	189,000	255,528,000	1.32
日本	投資証券	日本リート投資法人	673	454,376.51	305,795,392	372,000	250,356,000	1.29
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	688	413,944.02	284,793,490	354,000	243,552,000	1.26
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,102	138,804.17	291,766,384	115,700	243,201,400	1.26
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,923	174,216.7	335,018,726	125,700	241,721,100	1.25

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	97.65
合計	97.65

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
不動産投信指数先物取引	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	257	日本円	436,455,970	449,107,500	2.32

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

R A M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	アメリカ	15,954,795,922	74.29
	カナダ	404,478,447	1.88
	ドイツ	59,828,064	0.28
	イタリア	1,894,666	0.01
	フランス	444,210,756	2.07
	オランダ	38,716,495	0.18
	スペイン	110,315,616	0.51
	ベルギー	280,035,903	1.30
	アイルランド	31,813,025	0.15
	イギリス	1,134,542,603	5.28
	オーストラリア	1,473,006,191	6.86
	ニュージーランド	101,429,741	0.47
	香港	355,165,428	1.65
	シンガポール	912,862,357	4.25
	韓国	9,458,834	0.04
	イスラエル	12,573,180	0.06
	ガーナ	50,608,243	0.24
マン島	5,793,140	0.03	
	小計	21,381,528,611	99.56
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		94,478,150	0.44
合計(純資産総額)		21,476,006,761	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	130,609	9,929.57	1,296,891,626	10,798.34	1,410,361,225	6.57
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,654	68,268.49	1,068,675,021	82,920.42	1,298,036,367	6.04
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,502	14,404.78	684,256,026	16,255.99	772,192,246	3.60
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,558	22,071.27	586,168,954	22,488.03	597,237,324	2.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	73,759	7,241.74	534,143,969	6,263.65	462,000,708	2.15

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

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	99.56
合 計	99.56

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

< 更新後 >

運用実績

2020年8月31日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額は1万円当たり、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

(1万円当たり、税引前)	
2020年5月15日	0円
2020年8月17日	20円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	20円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	15.5
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	61.5
RAM国内株式マザーファンド	2.3
RAM先進国株式マザーファンド	15.0
RAM新興国株式マザーファンド	2.3
RAM新興国債券マザーファンド	0.6
RAM国内リートマザーファンド	0.6
RAM先進国リートマザーファンド	2.3
現金等	0.1
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	79.8
米ドル	13.8
ユーロ	2.1
英ポンド	0.7
香港ドル	0.5
その他	3.0
合計	100.0

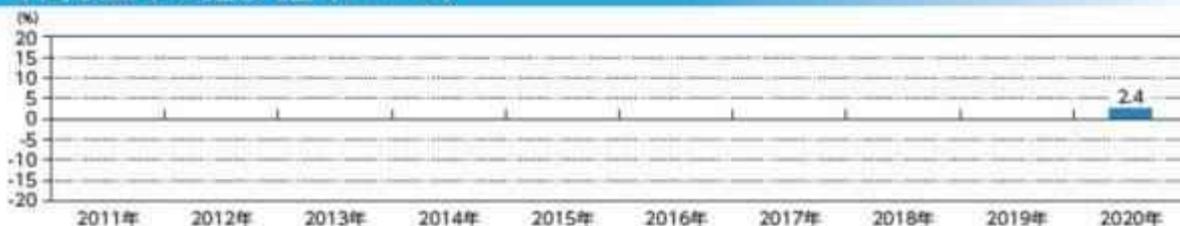
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.5
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.2
	日本	第134回利付国債(5年)	2022/12/20	1.2
	先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2048/2/15
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/12/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2024/11/30	0.5
国内株式	日本	トヨタ自動車	—	3.4
	日本	ソニー	—	2.3
	日本	ソフトバンクグループ	—	2.2
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	—	3.5
	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	2.6
	アメリカ	AMAZON.COM INC	—	2.3
	中国	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	5.7
新興国株式	中国	TENCENT HOLDINGS LTD	—	4.2
	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	3.8
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	69.4
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	—	29.8
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.6
	日本	ジャパリアルエステイト投資法人	—	6.4
	日本	日本プロロジスリート投資法人	—	5.6
	アメリカ	PROLOGIS INC	—	6.6
先進国リート	アメリカ	EQUINIX INC	—	6.0
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	—	3.6

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



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

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの計算期間は6カ月未満であるため、財務諸表は6カ月毎に作成しております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1特定期間(2020年 3月31日から2020年 8月17日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【リスクコントロール・オープン】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

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

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日
営業収益	
有価証券売買等損益	8,336,646

	第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日
営業収益合計	8,336,646
営業費用	
支払利息	8,988
受託者報酬	36,037
委託者報酬	1,199,529
その他費用	289,244
営業費用合計	1,533,798
営業利益又は営業損失（ ）	6,802,848
経常利益又は経常損失（ ）	6,802,848
当期純利益又は当期純損失（ ）	6,802,848
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	246,533
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	636,238
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	636,238
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,160
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,160
分配金	646,025
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,526,368

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの第1特定期間は、信託約款の規定により、設定日（2020年 3月31日）から2020年 8月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

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

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日	
分配金の計算過程	
第1期	
2020年 3月31日	
2020年 5月15日	
A 費用控除後の配当等収益額	10,119円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	10,382円
C 収益調整金額	16,993円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	37,494円
F 当ファンドの期末残存口数	263,870,386口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1円
H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円
第2期	
2020年 5月16日	
2020年 8月17日	
A 費用控除後の配当等収益額	1,078,414円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	5,457,400円
C 収益調整金額	616,725円
D 分配準備積立金額	19,854円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	7,172,393円
F 当ファンドの期末残存口数	323,012,717口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	222円
H 10,000口当たり分配金額	20円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	646,025円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	
運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。	
また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	

金融商品の時価等に関する事項

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

(関連当事者との取引に関する注記)

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

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1特定期間 自 2020年 3月31日 至 2020年 8月17日	
	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券	6,974,654	
合計	6,974,654	

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	49,023,617	51,460,090	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	192,424,240	205,258,936	
	R A M国内株式マザーファンド	6,080,312	6,941,892	
	R A M先進国株式マザーファンド	32,523,146	45,447,844	
	R A M新興国株式マザーファンド	5,218,762	6,949,825	
	R A M新興国債券マザーファンド	1,669,251	1,735,854	
	R A M国内リートマザーファンド	1,493,805	1,743,419	
	R A M先進国リートマザーファンド	7,151,488	6,883,307	
合計		295,584,621	326,421,167	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RAM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2020年 8月17日現在	
資産の部	
流動資産	
金銭信託	523,076
コール・ローン	717,274,722
国債証券	72,372,779,130
地方債証券	4,460,560,200
特殊債券	5,408,809,677
社債券	3,601,749,000
未収利息	174,043,537
前払費用	15,918,008
流動資産合計	86,751,657,350
資産合計	86,751,657,350
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	16,978,000
未払利息	1,945
流動負債合計	116,979,945
負債合計	116,979,945
純資産の部	
元本等	
元本	82,535,308,236
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,099,369,169
元本等合計	86,634,677,405
純資産合計	86,634,677,405
負債純資産合計	86,751,657,350

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券
-----------------	---------------------

個別法に基づき、原則として時価で評価しております。

時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	61,425,296,985円
期中追加設定元本額	34,172,673,197円
期中一部解約元本額	13,062,661,946円
期末元本額	82,535,308,236円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,048,448,464円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,036,152,700円
りそなラップ型ファンド(成長型)	367,230,544円
DCりそな グローバルバランス	405,839,164円
つみたてバランスファンド	1,531,273,361円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,121,663,701円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	225,313,289円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	53,138,676円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,672,351円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,744,020円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	503,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	155,547円
リスクコントロール・オープン	49,023,617円
FWりそな円建債券アクティブファンド	958,395,484円
FWりそな国内債券インデックスファンド	46,600,991,852円
Smart-i 国内債券インデックス	801,476,648円
Smart-i 8資産バランス 安定型	354,419,400円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	245,974,402円
Smart-i 8資産バランス 成長型	89,125,229円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,235,607,713円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,882,677,336円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,807,607,985円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,065,693,534円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,989,628,776円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	488,952,580円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,536,252円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,010,693,098円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	137,368,584円
2. 計算日における受益権の総数	82,535,308,236口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0497円

(10,000口当たり純資産額)

(10,497円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 8月17日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020年 8月17日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 8月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,121,896,790
地方債証券		27,464,800
特殊債券		38,246,847
社債券		32,768,000
合計		1,220,376,437

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第404回利付国債（2年）	420,000,000	421,003,800	
	第405回利付国債（2年）	150,000,000	150,394,500	
	第406回利付国債（2年）	250,000,000	250,707,500	
	第407回利付国債（2年）	330,000,000	330,999,900	
	第408回利付国債（2年）	610,000,000	611,970,300	
	第409回利付国債（2年）	180,000,000	180,617,400	
	第410回利付国債（2年）	410,000,000	411,480,100	
	第411回利付国債（2年）	440,000,000	441,856,800	

第4 1 2 回利付国債(2年)	330,000,000	331,432,200	
第4 1 3 回利付国債(2年)	550,000,000	552,359,500	
第4 1 4 回利付国債(2年)	570,000,000	572,451,000	
第1 2 9 回利付国債(5年)	450,000,000	451,129,500	
第1 3 0 回利付国債(5年)	240,000,000	240,739,200	
第1 3 1 回利付国債(5年)	360,000,000	361,314,000	
第1 3 2 回利付国債(5年)	40,000,000	40,169,200	
第1 3 3 回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,286,028,800	
第1 3 4 回利付国債(5年)	1,060,000,000	1,065,586,200	
第1 3 5 回利付国債(5年)	860,000,000	865,013,800	
第1 3 6 回利付国債(5年)	850,000,000	855,440,000	
第1 3 7 回利付国債(5年)	650,000,000	654,433,000	
第1 3 8 回利付国債(5年)	720,000,000	725,306,400	
第1 3 9 回利付国債(5年)	890,000,000	896,888,600	
第1 4 0 回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,078,859,600	
第1 4 1 回利付国債(5年)	620,000,000	625,344,400	
第1 4 2 回利付国債(5年)	680,000,000	685,922,800	
第1 4 3 回利付国債(5年)	450,000,000	453,937,500	
第1 4 4 回利付国債(5年)	310,000,000	312,709,400	
第1 回利付国債(40年)	40,000,000	58,637,200	
第2 回利付国債(40年)	100,000,000	142,341,000	
第3 回利付国債(40年)	110,000,000	157,587,100	
第4 回利付国債(40年)	150,000,000	216,214,500	
第5 回利付国債(40年)	150,000,000	209,376,000	
第6 回利付国債(40年)	170,000,000	234,064,500	
第7 回利付国債(40年)	170,000,000	225,421,700	
第8 回利付国債(40年)	200,000,000	248,316,000	
第9 回利付国債(40年)	310,000,000	288,014,800	
第1 0 回利付国債(40年)	300,000,000	327,000,000	
第1 1 回利付国債(40年)	240,000,000	253,941,600	
第1 2 回利付国債(40年)	250,000,000	239,167,500	
第1 3 回利付国債(40年)	50,000,000	47,789,000	
第3 1 7 回利付国債(10年)	40,000,000	40,537,200	
第3 1 8 回利付国債(10年)	366,000,000	370,512,780	
第3 1 9 回利付国債(10年)	240,000,000	243,960,000	
第3 2 0 回利付国債(10年)	202,000,000	205,062,320	
第3 2 1 回利付国債(10年)	241,000,000	245,328,360	
第3 2 2 回利付国債(10年)	220,000,000	223,601,400	
第3 2 3 回利付国債(10年)	340,000,000	346,453,200	
第3 2 4 回利付国債(10年)	183,000,000	186,134,790	
第3 2 5 回利付国債(10年)	330,000,000	336,395,400	
第3 2 6 回利付国債(10年)	280,000,000	285,418,000	
第3 2 7 回利付国債(10年)	387,000,000	395,397,900	
第3 2 8 回利付国債(10年)	411,000,000	418,730,910	

第329回利付国債（10年）	297,000,000	304,781,400	
第330回利付国債（10年）	257,000,000	264,332,210	
第331回利付国債（10年）	90,000,000	92,009,700	
第332回利付国債（10年）	532,000,000	544,842,480	
第333回利付国債（10年）	225,000,000	230,791,500	
第334回利付国債（10年）	261,000,000	268,193,160	
第335回利付国債（10年）	345,000,000	353,645,700	
第336回利付国債（10年）	210,000,000	215,491,500	
第337回利付国債（10年）	170,000,000	172,963,100	
第338回利付国債（10年）	631,000,000	645,235,360	
第339回利付国債（10年）	385,000,000	393,974,350	
第340回利付国債（10年）	814,000,000	834,179,060	
第341回利付国債（10年）	520,000,000	530,738,000	
第342回利付国債（10年）	190,000,000	191,919,000	
第343回利付国債（10年）	680,000,000	687,174,000	
第344回利付国債（10年）	690,000,000	697,596,900	
第345回利付国債（10年）	640,000,000	647,334,400	
第346回利付国債（10年）	870,000,000	880,361,700	
第347回利付国債（10年）	200,000,000	202,404,000	
第348回利付国債（10年）	470,000,000	475,522,500	
第349回利付国債（10年）	390,000,000	394,598,100	
第350回利付国債（10年）	730,000,000	738,614,000	
第351回利付国債（10年）	470,000,000	475,358,000	
第352回利付国債（10年）	790,000,000	798,650,500	
第353回利付国債（10年）	590,000,000	596,159,600	
第354回利付国債（10年）	640,000,000	646,048,000	
第355回利付国債（10年）	640,000,000	645,651,200	
第356回利付国債（10年）	910,000,000	917,434,700	
第357回利付国債（10年）	760,000,000	765,662,000	
第358回利付国債（10年）	720,000,000	724,816,800	
第359回利付国債（10年）	270,000,000	271,584,900	
第1回利付国債（30年）	60,000,000	75,135,000	
第7回利付国債（30年）	40,000,000	50,077,200	
第11回利付国債（30年）	50,000,000	59,574,000	
第12回利付国債（30年）	40,000,000	49,822,000	
第13回利付国債（30年）	90,000,000	111,193,200	
第14回利付国債（30年）	60,000,000	77,510,400	
第15回利付国債（30年）	160,000,000	209,411,200	
第16回利付国債（30年）	100,000,000	131,249,000	
第17回利付国債（30年）	50,000,000	65,152,000	
第18回利付国債（30年）	60,000,000	77,527,800	
第19回利付国債（30年）	100,000,000	129,515,000	
第20回利付国債（30年）	100,000,000	132,815,000	

第2 1 回利付国債(30年)	90,000,000	117,169,200
第2 2 回利付国債(30年)	50,000,000	66,776,500
第2 3 回利付国債(30年)	160,000,000	214,193,600
第2 4 回利付国債(30年)	100,000,000	134,284,000
第2 5 回利付国債(30年)	100,000,000	131,356,000
第2 6 回利付国債(30年)	145,000,000	193,263,250
第2 7 回利付国債(30年)	215,000,000	291,656,100
第2 8 回利付国債(30年)	110,000,000	150,049,900
第2 9 回利付国債(30年)	70,000,000	94,735,900
第3 0 回利付国債(30年)	190,000,000	254,877,400
第3 1 回利付国債(30年)	130,000,000	172,881,800
第3 2 回利付国債(30年)	215,000,000	291,045,500
第3 3 回利付国債(30年)	230,000,000	299,266,800
第3 4 回利付国債(30年)	255,000,000	342,952,050
第3 5 回利付国債(30年)	316,000,000	413,931,560
第3 6 回利付国債(30年)	285,000,000	374,492,850
第3 7 回利付国債(30年)	320,000,000	415,315,200
第3 8 回利付国債(30年)	220,000,000	281,758,400
第3 9 回利付国債(30年)	180,000,000	234,781,200
第4 0 回利付国債(30年)	155,000,000	199,184,300
第4 1 回利付国債(30年)	195,000,000	246,743,250
第4 2 回利付国債(30年)	190,000,000	240,640,700
第4 3 回利付国債(30年)	100,000,000	126,774,000
第4 4 回利付国債(30年)	180,000,000	228,405,600
第4 5 回利付国債(30年)	220,000,000	269,491,200
第4 6 回利付国債(30年)	220,000,000	269,643,000
第4 7 回利付国債(30年)	230,000,000	287,486,200
第4 8 回利付国債(30年)	253,000,000	304,781,510
第4 9 回利付国債(30年)	230,000,000	277,177,600
第5 0 回利付国債(30年)	250,000,000	265,505,000
第5 1 回利付国債(30年)	230,000,000	216,501,300
第5 2 回利付国債(30年)	230,000,000	227,375,700
第5 3 回利付国債(30年)	220,000,000	222,530,000
第5 4 回利付国債(30年)	230,000,000	243,901,200
第5 5 回利付国債(30年)	170,000,000	180,149,000
第5 6 回利付国債(30年)	220,000,000	232,966,800
第5 7 回利付国債(30年)	230,000,000	243,374,500
第5 8 回利付国債(30年)	350,000,000	370,069,000
第5 9 回利付国債(30年)	220,000,000	226,870,600
第6 0 回利付国債(30年)	190,000,000	205,429,900
第6 1 回利付国債(30年)	220,000,000	226,424,000
第6 2 回利付国債(30年)	220,000,000	214,629,800
第6 3 回利付国債(30年)	210,000,000	199,182,900
第6 4 回利付国債(30年)	180,000,000	170,449,200

第65回利付国債(30年)	150,000,000	141,807,000	
第66回利付国債(30年)	230,000,000	217,347,700	
第67回利付国債(30年)	100,000,000	99,621,000	
第52回利付国債(20年)	190,000,000	194,637,900	
第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,597,000	
第54回利付国債(20年)	180,000,000	185,616,000	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	103,391,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,391,500	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	114,104,100	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	104,244,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,712,800	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,073,400	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,459,500	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	82,096,000	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	63,280,800	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	127,498,800	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	405,669,000	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,447,400	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	97,485,300	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,774,200	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	120,642,500	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	108,904,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	229,021,800	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	196,475,400	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	110,085,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	109,164,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,925,000	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,795,000	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,015,200	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	99,504,900	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,189,300	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	188,941,400	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,169,000	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	133,384,800	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	168,301,500	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	113,323,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	101,485,800	
第88回利付国債(20年)	185,000,000	210,764,950	
第89回利付国債(20年)	120,000,000	136,008,000	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	193,662,300	
第91回利付国債(20年)	80,000,000	91,624,800	
第92回利付国債(20年)	255,000,000	290,327,700	
第93回利付国債(20年)	80,000,000	90,987,200	
第94回利付国債(20年)	140,000,000	160,154,400	

第95回利付国債(20年)	185,000,000	215,125,400	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	80,437,000	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	150,919,600	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	80,766,000	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	98,498,850	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	176,872,340	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,731,400	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	172,818,250	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	118,399,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,682,600	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	14,078,640	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	47,253,200	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	94,206,400	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	255,391,400	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	93,130,400	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	230,357,400	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,722,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	243,048,000	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	101,133,850	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	191,024,000	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	120,322,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	169,038,800	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	269,518,500	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	156,161,170	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	175,870,500	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	230,574,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	243,074,650	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	223,381,100	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	320,385,000	
第124回利付国債(20年)	140,000,000	167,822,200	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	146,781,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	120,218,000	
第127回利付国債(20年)	70,000,000	83,416,900	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	268,710,750	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	213,037,200	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	213,562,800	
第131回利付国債(20年)	170,000,000	199,835,000	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	200,273,600	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	291,373,600	
第134回利付国債(20年)	205,000,000	244,355,900	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,222,000	
第136回利付国債(20年)	110,000,000	128,603,200	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	201,116,800	

	第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,374,800
	第139回利付国債(20年)	180,000,000	210,848,400
	第140回利付国債(20年)	380,000,000	450,478,600
	第141回利付国債(20年)	185,000,000	219,739,300
	第142回利付国債(20年)	150,000,000	179,985,000
	第143回利付国債(20年)	245,000,000	288,347,850
	第144回利付国債(20年)	230,000,000	267,858,000
	第145回利付国債(20年)	405,000,000	482,549,400
	第146回利付国債(20年)	380,000,000	453,579,400
	第147回利付国債(20年)	375,000,000	443,501,250
	第148回利付国債(20年)	405,000,000	474,323,850
	第149回利付国債(20年)	380,000,000	445,618,400
	第150回利付国債(20年)	400,000,000	464,188,000
	第151回利付国債(20年)	445,000,000	504,567,700
	第152回利付国債(20年)	440,000,000	499,175,600
	第153回利付国債(20年)	290,000,000	333,326,000
	第154回利付国債(20年)	208,000,000	236,217,280
	第155回利付国債(20年)	350,000,000	387,348,500
	第156回利付国債(20年)	430,000,000	436,725,200
	第157回利付国債(20年)	240,000,000	236,013,600
	第158回利付国債(20年)	260,000,000	267,568,600
	第159回利付国債(20年)	330,000,000	344,345,100
	第160回利付国債(20年)	350,000,000	370,653,500
	第161回利付国債(20年)	270,000,000	281,402,100
	第162回利付国債(20年)	280,000,000	291,757,200
	第163回利付国債(20年)	300,000,000	312,258,000
	第164回利付国債(20年)	490,000,000	501,760,000
	第165回利付国債(20年)	290,000,000	296,554,000
	第166回利付国債(20年)	490,000,000	517,415,500
	第167回利付国債(20年)	290,000,000	295,710,100
	第168回利付国債(20年)	350,000,000	350,301,000
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	274,853,600
	第170回利付国債(20年)	370,000,000	362,792,400
	第171回利付国債(20年)	270,000,000	264,440,700
	第172回利付国債(20年)	330,000,000	328,805,400
	第173回利付国債(20年)	180,000,000	179,011,800
	国債証券合計	67,233,000,000	72,372,779,130
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	116,797,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,646,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,303,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,341,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,030,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,815,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,945,000

	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,837,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,055,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,885,000	
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,701,600	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,106,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,222,000	
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,782,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,685,000	
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,216,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,339,000	
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,613,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,970,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,037,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,530,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,809,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	118,562,000	
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,253,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,213,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,734,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,585,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,182,000	
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,654,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,435,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,484,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,167,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,864,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,159,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	111,908,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,316,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,198,000	
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,982,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,129,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,185,600	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,011,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,763,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,111,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,460,560,200	
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,056,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,158,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,240,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,354,000	
	第27回道路債券	100,000,000	108,548,000	

第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,835,180	
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	129,846,070	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,030,000	
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,351,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,851,040	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	135,320,850	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,723,000	
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,871,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,126,000	
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,536,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	126,511,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	110,322,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,801,620	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,016,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,772,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,235,400	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,700,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,293,850	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,276,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,910,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,013,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,031,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	114,358,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	93,017,000	92,616,096	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	98,650,000	98,529,647	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,534,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,453,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,372,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,530,000	88,476,199	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,587,000	88,286,820	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,830,000	89,396,735	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,398,000	89,091,040	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,647,000	92,128,146	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,576,000	93,623,034	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,051,000	96,105,723	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,702,000	98,473,011	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	65,862,000	65,756,620	

	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	68,587,000	68,524,585
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	72,676,000	72,660,011
	第327回信金中金債	100,000,000	100,068,000
	第340回信金中金債	100,000,000	100,221,000
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,384,000
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,013,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,146,000
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,850,000
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,015,000
	特殊債券合計	5,193,113,000	5,408,809,677
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,556,000
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,190,000
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	98,221,000
	第7回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,888,000
	第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,619,000
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,786,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	99,934,000
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,652,000
	第12回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,640,000
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,112,000
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	99,772,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	99,835,000
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,189,000
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,472,000
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,833,000
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,515,000
	第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	98,473,000
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,206,000
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,817,000
	第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	98,309,000
	第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,065,000
	第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,831,000
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,785,000
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,081,000
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,261,000

第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,323,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,219,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,144,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,520,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,715,000	
第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,076,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,093,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,568,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,363,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,931,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,755,000	
社債券合計	3,600,000,000	3,601,749,000	
合計		85,843,898,007	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2020年 8月17日現在

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

2020年 8月17日現在

純資産の部	
元本等	
元本	173,467,819,943
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,576,784,293
元本等合計	185,044,604,236
純資産合計	185,044,604,236
負債純資産合計	191,081,436,250

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,654,581円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	492,011円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	152,300円
リスクコントロール・オープン	192,424,240円
FWりそな円建債券アクティブファンド	2,080,021,987円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	85,155,629,161円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	667,875,005円
Smart-i 8資産バランス 安定型	346,460,521円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	241,206,245円
Smart-i 8資産バランス 成長型	87,398,970円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	12,667,170,331円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	11,272,736,507円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	7,070,666,752円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	4,167,617,441円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	11,726,350,580円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,921,451,139円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,284,066,437円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,343,108円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	5,330,613,848円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	88,914,229円
2. 計算日における受益権の総数	173,467,819,943口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0667円
(10,000口当たり純資産額)	(10,667円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 8月17日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.時価の算定方法	
国債証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 8月17日現在	
該当事項はありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2020年 8月17日現在)

(単位：円)

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 232銘柄	100.0%	44.2%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 322銘柄	100.0%	41.4%
英ポンド	国債証券 47銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 25銘柄	100.0%	2.3%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 33銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M国内株式マザーファンド

貸借対照表

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

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方	先物取引

法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。
3.収益及び費用の計上基準	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。 受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	17,018,260,162円
期中追加設定元本額	10,588,889,507円
期中一部解約元本額	2,101,793,315円
期末元本額	25,505,356,354円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,818,623,871円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,271,689,678円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,160,002,769円
DCりそな グローバルバランス	34,271,446円
つみたてバランスファンド	2,183,777,159円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	720,401,133円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	355,077,012円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	214,439,375円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	14,178,914円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	11,524,192円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,312,404円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,849,210円
リスクコントロール・オープン	6,080,312円
FWりそな国内株式アクティブファンド	302,384,638円
FWりそな国内株式インデックスファンド	11,294,090,263円
Smart-i TOPIXインデックス	959,099,444円
Smart-i 8資産バランス 安定型	95,047,000円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	282,699,059円
Smart-i 8資産バランス 成長型	307,517,518円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	408,744,667円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	362,206,580円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	226,843,213円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	133,879,905円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	369,207,471円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	59,995,302円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,019,263円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	531,808,232円

りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	827,263,864円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,495,483,821円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	45,838,639円
2. 計算日における受益権の総数	25,505,356,354口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1417円
(10,000口当たり純資産額)	(11,417円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2020年 8月17日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2020年 8月17日現在)

(単位 : 円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	532,298,150	-	530,970,000	1,328,150
合計		532,298,150	-	530,970,000	1,328,150

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2020年 8月17日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	16,024,675,387
コール・ローン	65,648,577
株式	46,219,640,881
投資証券	1,131,728,662
派生商品評価勘定	1,250,812,061
未収入金	51,948
未収配当金	61,739,195
差入委託証拠金	3,246,875,125
流動資産合計	68,001,171,836
資産合計	68,001,171,836
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,802,271
未払解約金	72,339,000
未払利息	178
流動負債合計	75,141,449
負債合計	75,141,449
純資産の部	
元本等	
元本	48,607,586,553
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,318,443,834
元本等合計	67,926,030,387
純資産合計	67,926,030,387
負債純資産合計	68,001,171,836

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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>
--------------------	--

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

(貸借対照表に関する注記)

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

リスクコントロール・オープン	32,523,146円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	315,363,564円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	192,790,764円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	20,810,154,909円
Smart-i 先進国株式インデックス	3,128,542,370円
Smart-i 8資産バランス 安定型	96,427,431円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	255,819,900円
Smart-i 8資産バランス 成長型	274,615,261円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,999,611,491円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,771,139,198円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,110,307,528円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	654,752,545円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,819,513,562円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	294,968,864円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,685,180円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	385,632,189円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,250,163,169円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	40,811,675円
2. 計算日における受益権の総数	48,607,586,553口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3974円
(10,000口当たり純資産額)	(13,974円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 8月17日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2020年 8月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	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	19,275,944,458	-	20,523,954,248	1,248,009,790
	合計	19,275,944,458	-	20,523,954,248	1,248,009,790

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	4,823	66,943.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,379	234,733.38	
		AMERICAN TOWER CORP	4,757	1,189,820.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	120,512.97	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,572	240,594.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,674	144,683.82	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	97,703.44	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,493	739,682.59	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,875	440,795.00	
		DUKE REALTY CORP	4,194	158,910.66	
		EQUINIX INC	925	704,859.25	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	101,270.16	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,162	226,371.18	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	753	165,019.95	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,476	153,813.96	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	50,519.96	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,755	155,442.55	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	73,215.00	
		INVITATION HOMES INC	4,955	142,059.85	
		IRON MOUNTAIN INC	2,044	60,788.56	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	113,775.76			

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

ユーロ	株式	239銘柄	99.6%		10.8%
	投資証券	5銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式	85銘柄	98.8%		4.5%
	投資証券	3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%		3.4%
スウェーデンクローナ	株式	36銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式	9銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式	58銘柄	93.9%		2.2%
	投資証券	7銘柄		6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	33銘柄	95.7%		1.0%
	投資証券	1銘柄		4.3%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	83.7%		0.3%
	投資証券	6銘柄		16.3%	0.1%
イスラエルシェケル	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 8月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,143,615,725
コール・ローン	8,158,160
株式	6,809,961,144
投資証券	5,804,727
派生商品評価勘定	247,138,511

2020年 8月17日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	5,330,781,126円
期中追加設定元本額	2,824,074,999円
期中一部解約元本額	850,313,133円
期末元本額	7,304,542,992円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	477,932,450円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	993,313,573円
りそなラップ型ファンド(成長型)	988,757,853円
DCりそな グローバルバランス	9,609,812円
つみたてバランスファンド	299,912,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	247,497,615円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	122,838,568円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	74,383,397円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,832,871円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,027,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,475,137円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,327,151円
リスクコントロール・オープン	5,218,762円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	59,237,330円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,541,583,247円
Smart-i 新興国株式インデックス	920,321,576円
Smart-i 8資産バランス 安定型	29,363,095円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	88,156,053円
Smart-i 8資産バランス 成長型	101,164,991円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	344,433,903円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	309,509,996円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	193,930,852円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	114,410,913円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	317,562,273円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	51,717,369円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	1,024,053円
2. 計算日における受益権の総数	7,304,542,992口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3317円
(10,000口当たり純資産額)	(13,317円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2020年 8月17日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,666,742,457	-	2,913,876,125	247,133,668
合計		2,666,742,457	-	2,913,876,125	247,133,668

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

（通貨関連）

（2020年 8月17日現在）

（単位：円）

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

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

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

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

	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	37.17	613,305.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	26,700	82.15	2,193,405.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	17,800	17.18	305,804.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	341,600	14.24	4,864,384.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	69.15	428,730.00	
	メキシコペソ 小計	773,310		23,619,544.65 (114,554,791)	
ブラジルリアル	COSAN SA	1,200	82.80	99,360.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	37,700	23.25	876,525.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	48,200	22.67	1,092,694.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,600	18.78	142,728.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	23.97	55,131.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	13.68	99,864.00	
	GERDAU SA-PREF	11,500	17.99	206,885.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,400	25.15	186,110.00	
	SUZANO SA	5,007	50.49	252,803.43	
	VALE SA	37,400	61.35	2,294,490.00	
	WEG SA	8,650	69.17	598,320.50	
	CCR SA	13,400	13.50	180,900.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	6,610	49.58	327,723.80	
	RUMO SA	10,100	22.81	230,381.00	
	COGNA EDUCACAO	18,400	7.19	132,296.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,100	113.60	238,560.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	9,200	34.24	315,008.00	
	LOJAS RENNER S.A.	8,100	41.61	337,041.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	7,400	81.76	605,024.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	7,000	21.09	147,630.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.19	60,570.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	65.62	111,554.00	
	RAIA DROGASIL SA	2,200	112.98	248,556.00	
	AMBEV SA	47,800	13.26	633,828.00	
	BRF SA	5,900	20.70	122,130.00	
	JBS SA	9,700	23.30	226,010.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	7,000	51.43	360,010.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,400	64.12	153,888.00	

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

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 8月17日現在

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

2020年 8月17日現在

元本等合計	4,964,923,165
純資産合計	4,964,923,165
負債純資産合計	4,966,397,256

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

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

りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	3,041,258円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,567,995円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	963,601円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,556,383円
リスクコントロール・オープン	1,669,251円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	76,142,670円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,735,991,728円
Smart-i 8資産バランス 安定型	24,627,412円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	62,853,772円
Smart-i 8資産バランス 成長型	64,195,452円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	220,331,718円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	197,267,710円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	123,639,844円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	72,921,967円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	203,513,683円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	33,314,279円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	672,704円
2. 計算日における受益権の総数	4,774,608,043口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0399円
(10,000口当たり純資産額)	(10,399円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 8月17日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RAM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2020年 8月17日現在

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

原則として、約定日基準で計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	13,297,314,709円
期中追加設定元本額	4,540,786,524円
期中一部解約元本額	2,100,860,365円
期末元本額	15,737,240,868円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	535,287,691円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	395,651,760円
りそなラップ型ファンド(成長型)	371,148,960円
DCりそな グローバルバランス	10,732,791円
つみたてバランスファンド	691,464,201円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	174,962,235円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	85,187,205円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	52,114,717円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	3,342,882円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,789,512円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,008,772円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,628,993円
リスクコントロール・オープン	1,493,805円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,338,933,517円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,323,391,178円
Smart-i Jリートインデックス	2,276,837,904円
Smart-i 8資産バランス 安定型	22,063,243円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	70,819,330円
Smart-i 8資産バランス 成長型	69,181,890円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	197,792,518円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	176,156,582円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	110,443,552円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	65,120,248円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	181,806,838円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,607,286円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,193,526,250円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	629,921円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,354,117,087円
2. 計算日における受益権の総数	15,737,240,868口
3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1671円
(10,000口当たり純資産額)	(11,671円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

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

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2020年 8月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		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	385,189,970	-	380,906,000	4,283,970
合計		385,189,970	-	380,906,000	4,283,970

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

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

(単位：円)

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

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

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

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

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券
--------------------	------

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 8月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	13,000,812,433円
期中追加設定元本額	10,696,062,743円
期中一部解約元本額	1,939,052,896円
期末元本額	21,757,822,280円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	671,077,584円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	772,425,009円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,793,781,924円
DCりそな グローバルバランス	13,317,891円
つみたてバランスファンド	412,484,360円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	251,074,520円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	121,835,055円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	73,723,399円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,694,812円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,948,590円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,425,555円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,202,444円
リスクコントロール・オープン	7,151,488円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,493,740,740円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,269,174,772円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,272,784,243円
Smart-i 8資産バランス 安定型	27,326,385円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	88,234,898円

Smart-i 8資産バランス 成長型	98,046,426円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	478,033,534円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	419,475,068円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	263,098,543円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	155,082,503円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	435,095,213円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	70,843,905円
グローバル9資産バランスファンド（適格機関投資家限定）	2,021,384円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	1,555,722,035円
2. 計算日における受益権の総数	21,757,822,280口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	816,402,910円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9625円
(10,000口当たり純資産額)	(9,625円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 8月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 8月17日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 8月17日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	2,445,826,226
合計	2,445,826,226

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

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

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2020年 8月31日現在です。

【リスクコントロール・オープン】

【純資産額計算書】

資産総額	338,245,146円
負債総額	193,880円
純資産総額（ - ）	338,051,266円
発行済口数	330,667,106口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0223円

（参考）

R A M国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	88,999,117,006円
負債総額	2,105,439,099円
純資産総額（ - ）	86,893,677,907円

発行済口数	82,796,382,100口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0495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	186,501,459,639円
負債総額	3,261,597,279円
純資産総額（ - ）	183,239,862,360円
発行済口数	172,272,857,448口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0637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	29,843,552,205円
負債総額	36,058,062円
純資産総額（ - ）	29,807,494,143円
発行済口数	25,966,196,404口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1479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	70,971,926,071円
負債総額	768,587,711円
純資産総額（ - ）	70,203,338,360円
発行済口数	49,091,404,620口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4301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	10,212,867,385円
負債総額	134,633,225円
純資産総額（ - ）	10,078,234,160円

発行済口数	7,439,467,860口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3547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	5,080,464,673円
負債総額	15,303,129円
純資産総額（ - ）	5,065,161,544円
発行済口数	4,895,593,131口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0346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	19,388,537,150円
負債総額	27,397,353円
純資産総額（ - ）	19,361,139,797円
発行済口数	15,935,900,244口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2149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	21,513,039,975円
負債総額	37,033,214円
純資産総額（ - ）	21,476,006,761円
発行済口数	22,147,889,423口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9697円

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】

< 更新後 >

(1) 資本金の額

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

過去5年間における主な資本金の増減

年月日	変更後（変更前）
2017年7月7日	1,000,000,000円（490,000,000円）

(2) 委託会社の機構（2020年8月末現在）

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】

<更新後>

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

2020年8月末現在、委託会社が運用する証券投資信託は以下のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

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

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

(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				
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
		資本剰余金	その他利益剰余金	利益剰余金	利益剰余金

		資本準備金	合計	繰越利益 剰余金	合計	株主資本 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	25.96%

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1) 取引の概要

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。

5【その他】

<訂正前>

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(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。

<訂正後>

(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

<訂正前>

名 称	資本金の額 (2019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 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額 : 51,000百万円(2019年3月末現在)

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(日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)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。

<訂正後>

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。

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

<更新後>

(3) 保証会社

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

独立監査人の監査報告書

2020年10月9日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
東京事務所指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

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。