

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年2月16日提出
【計算期間】	第1期(自 2019年12月17日至 2020年11月16日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド2019-12
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

#### < 商品分類の定義 >

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

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

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

#### 4. 独立した区分

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

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

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1)株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

###### (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

###### (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

###### (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

##### 2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

### 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 4. 投資形態による属性区分

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

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

### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

## ファンドの特色

### ◆「保証契約」の表記について

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

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

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

### ◆「保証会社」の表記について

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

## 投資対象

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

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

## ファンドの特色

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

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

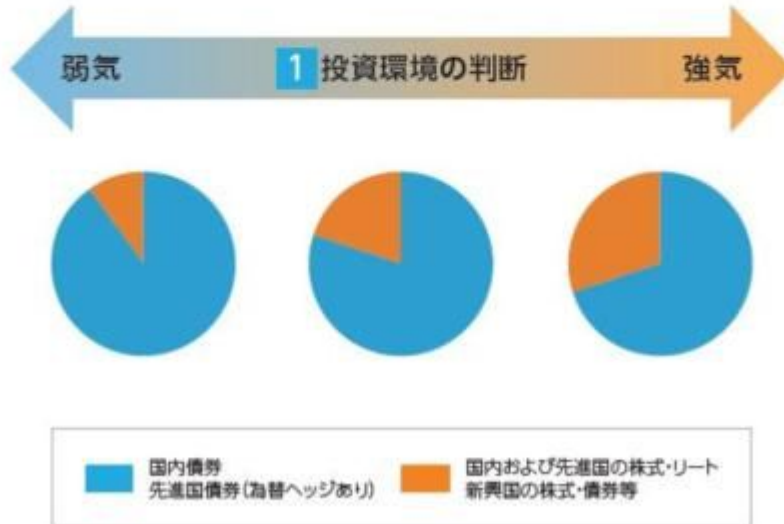
\*基準価額が「確保ライン」を上回っている場合でも、上記の条件以外の理由によって委託会社が繰上償還を決定することがあります。

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

## Point

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

## 投資環境の判断と投資割合のイメージ



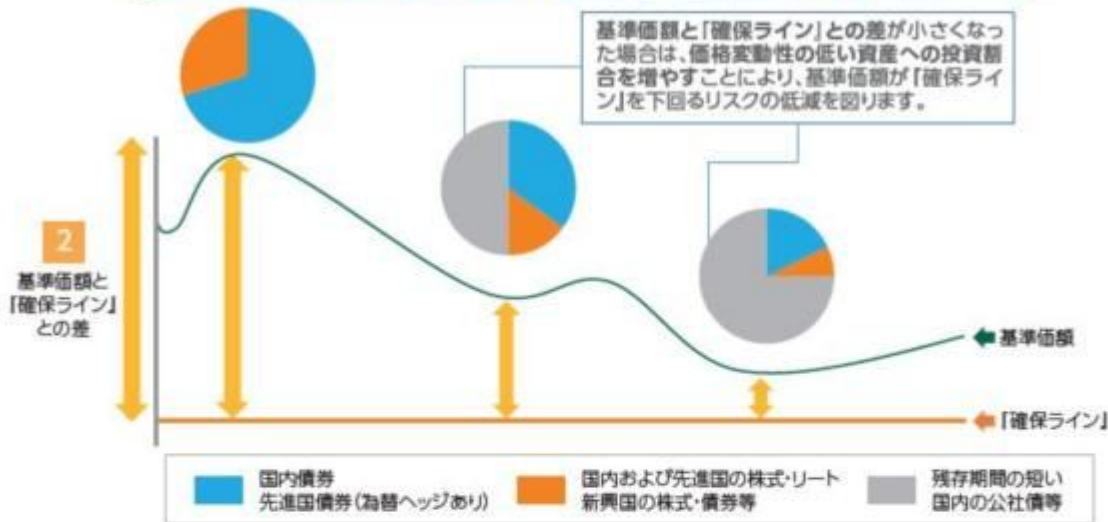


## 2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した「確保ライン」を上回る水準で運用を継続することを目指します。

### Point

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

### 「基準価額と「確保ライン」との差」と投資割合のイメージ

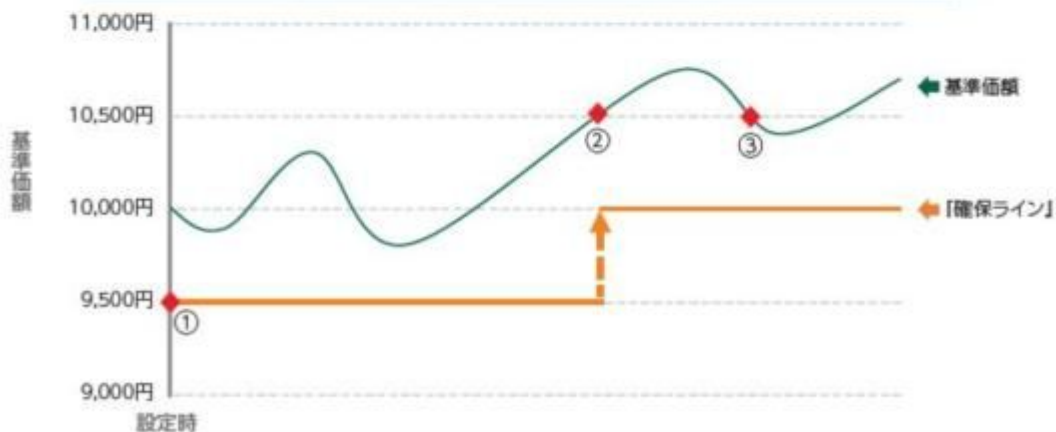


### 「確保ライン」は設定後に見直される場合があります。

### Point

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

### 「確保ライン」の引き上げイメージ



### ⚠️ ご注意ください

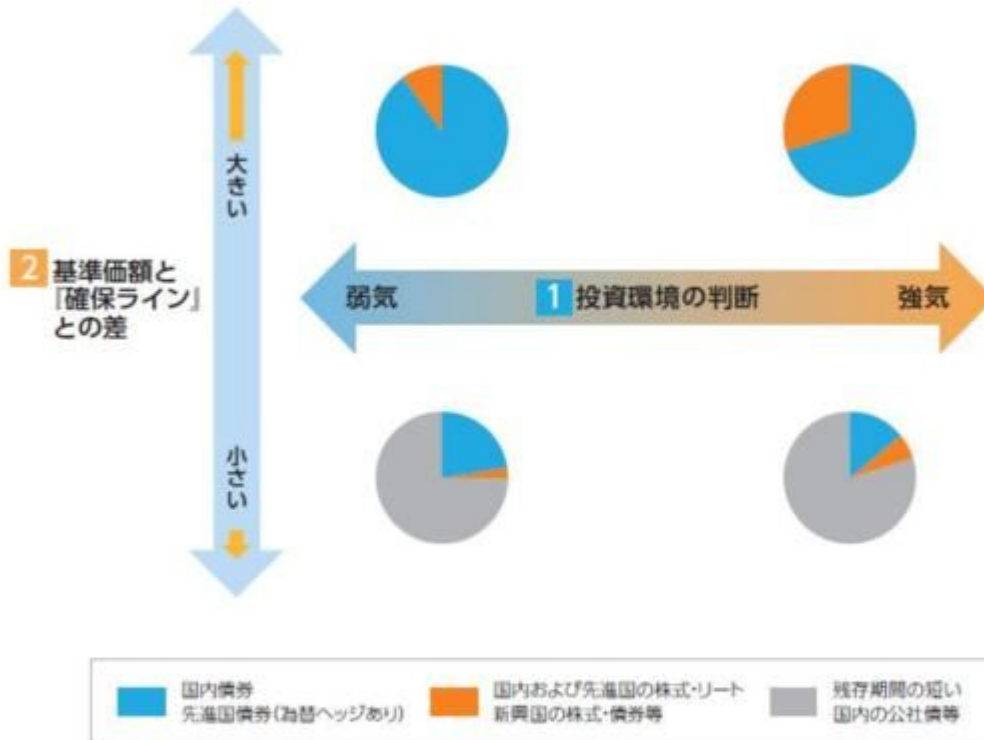
ファンドは、基準価額が下落時においても「確保ライン」を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が「確保ライン」を上回ることを委託会社が保証するものではありません。



## 投資対象資産への投資割合のイメージ

## 1 投資環境の判断 と 2 基準価額と「確保ライン」との差

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

⚠️ **ご注意ください**

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

3

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

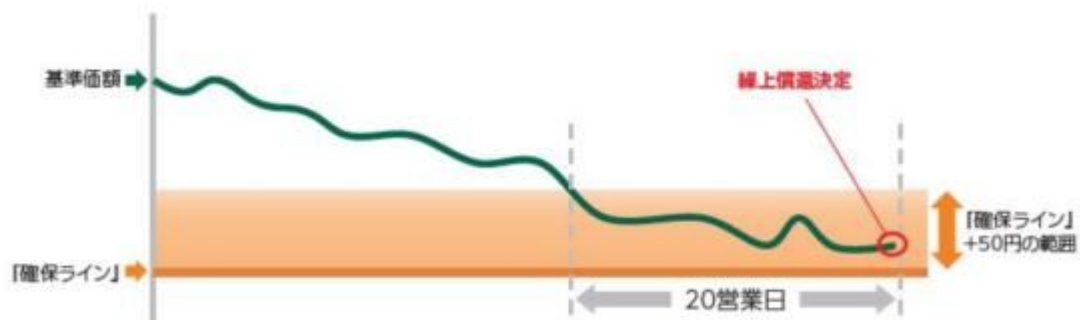
#### 条件① 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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

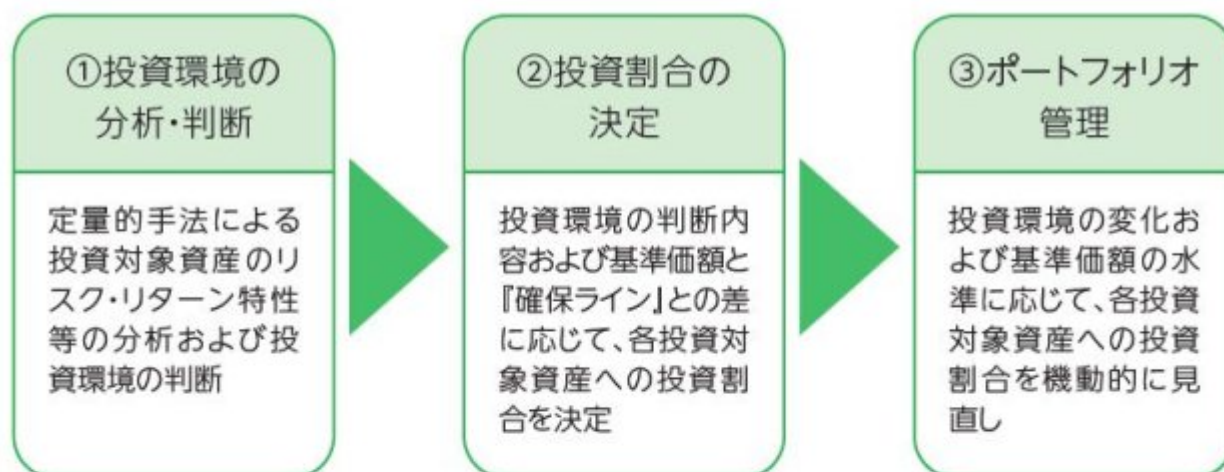


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

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

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

## 運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## 分配方針

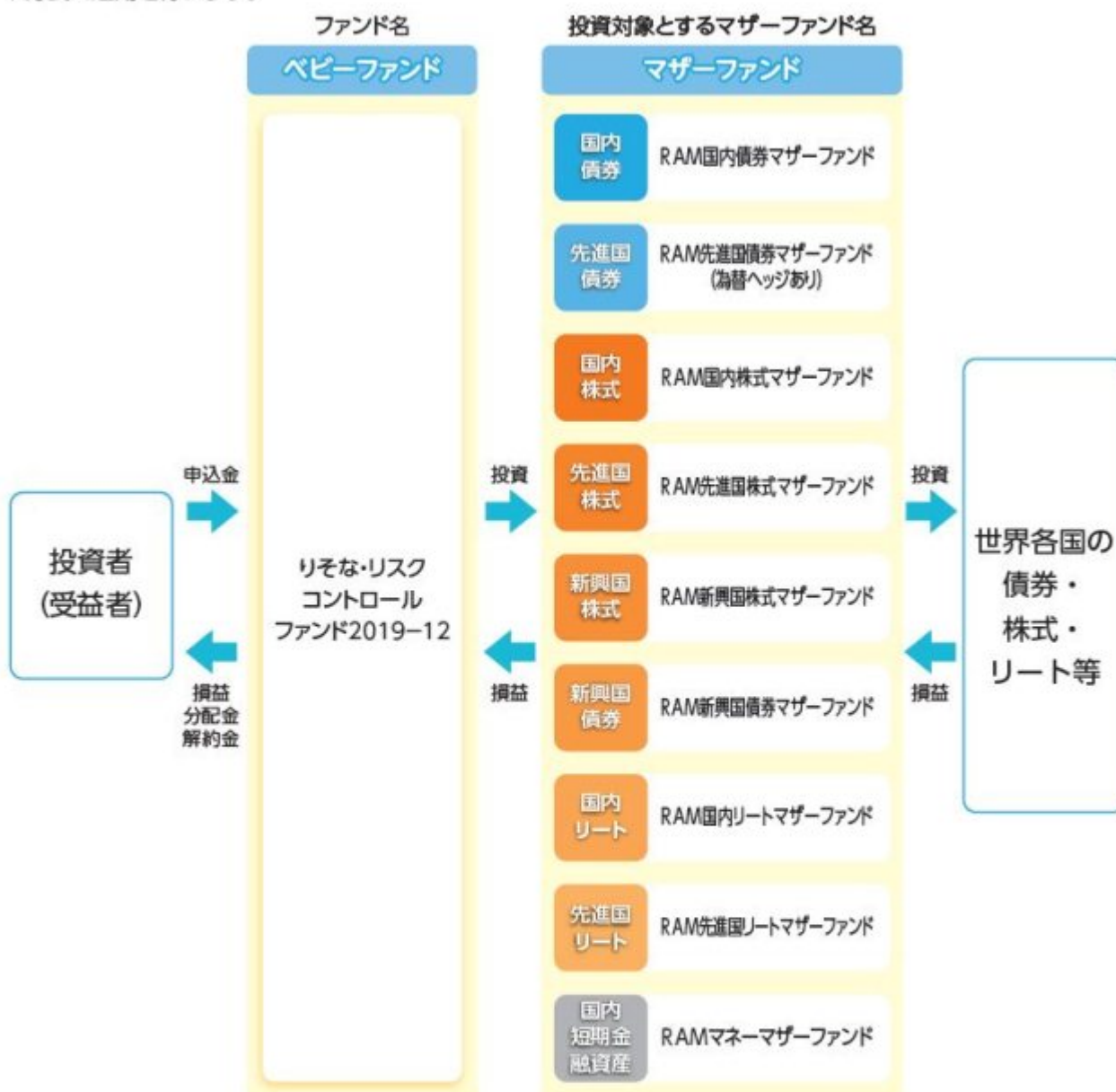
原則、毎年11月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## ファンドの仕組み

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



## 主な投資制限

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



## インデックスの著作権等について

### ●RAM国内債券マザーファンド

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

### ●RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

### ●RAM国内株式マザーファンド

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

### ●RAM先進国株式マザーファンド

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

### ●RAM新興国株式マザーファンド

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

### ●RAM新興国債券マザーファンド

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

### ●RAM国内リートマザーファンド

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

### ●RAM先進国リートマザーファンド

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

※RAMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

信託金限度額

700億円を限度とします。

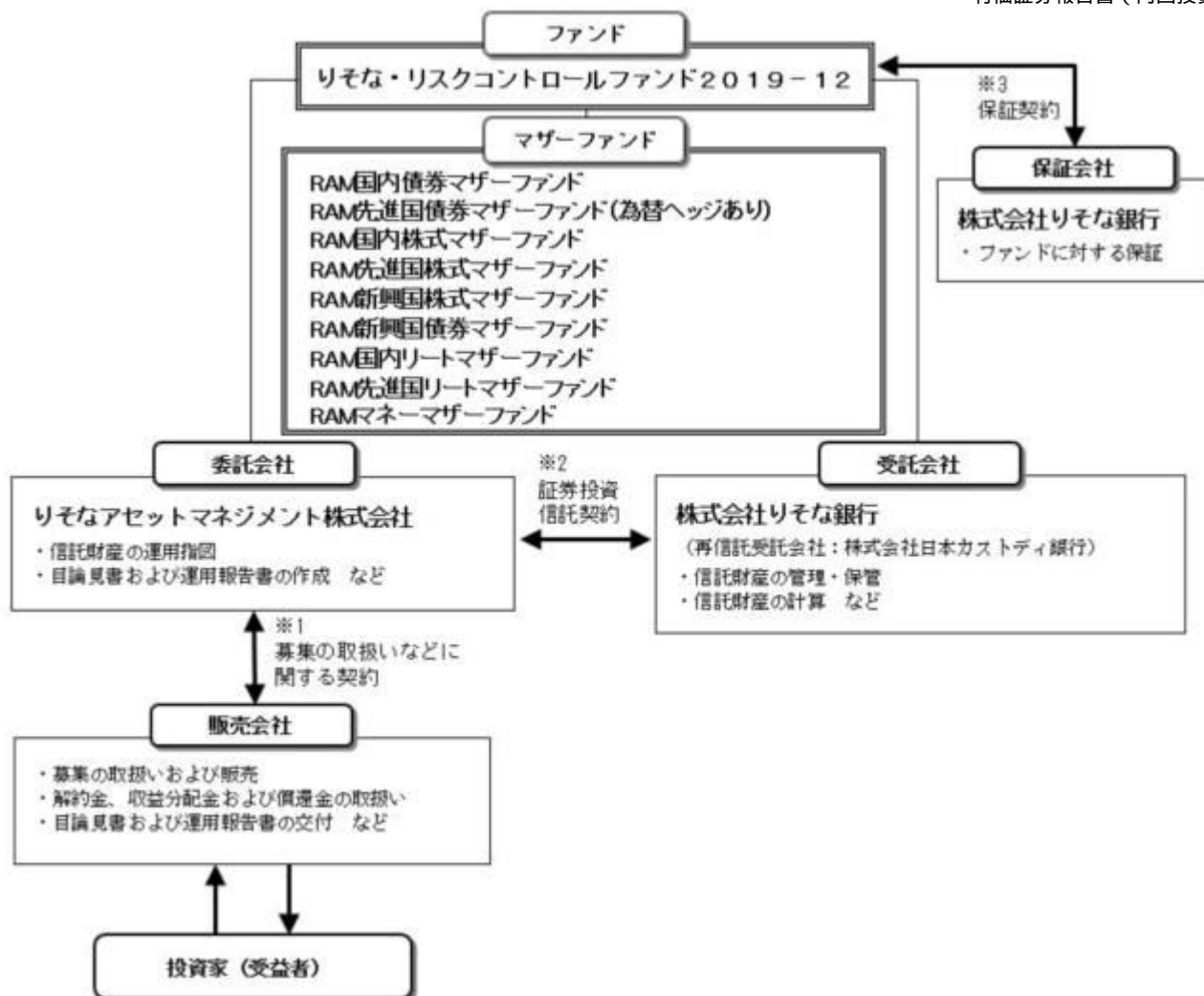
## (2)【ファンドの沿革】

2019年12月17日

・ファンドの信託契約締結、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

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

委託会社の概況（2020年11月末現在）

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

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

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

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

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

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

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

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

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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

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

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

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

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

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

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



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

## (2)【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 有価証券の指図範囲

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

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

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

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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

<RAM国内債券マザーファンド>

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

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

< R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; RAM国内株式マザーファンド &gt;

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

主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証株価指数(ＴＯＰＩＸ、配当込み)に採用されている株式
投資方針	主として、東証株価指数(ＴＯＰＩＸ、配当込み)に採用されている株式に投資し、東証株価指数(ＴＯＰＩＸ、配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証株価指数(ＴＯＰＩＸ、配当込み)への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたＥＴＦ(上場投資信託証券)または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 株式(指数先物取引、ＥＴＦ(上場投資信託証券)を含みます。)の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は、行いません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日(休業日の場合は翌営業日)
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R A M先進国株式マザーファンド &gt;

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

主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。）</li> <li>（*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。</li> <li>・先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	<p>主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSA I指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態を高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R A M新興国株式マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCIEマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。



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

## &lt; R A M新興国債券マザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・ J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券</li> <li>・ 新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	<p>主として、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたE T F（上場投資信託証券）に投資し、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、J PモルガンG B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。

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

## &lt; R A M国内リートマザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R A M先進国リートマザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）</li> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式</li> <li>・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	<p>主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、S &amp; P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S &amp; P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>不動産投資信託証券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

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

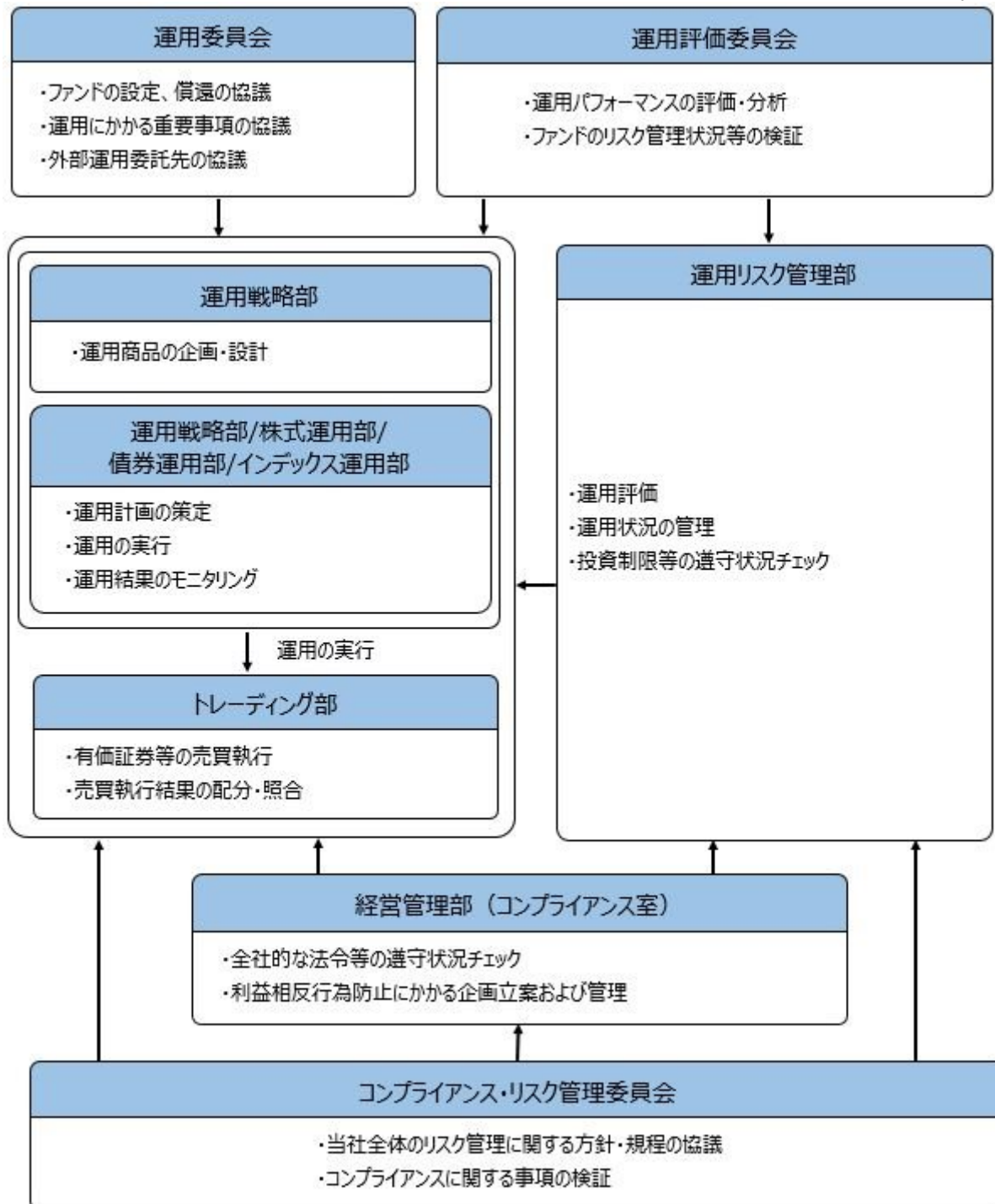
## &lt; RAMマネーマザーファンド &gt;

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

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

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

#### ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2020年11月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

#### (4) 【分配方針】

## 収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

## 収益分配金の支払い

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

## (5)【投資制限】

### 約款に定める投資制限

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



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

#### 10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

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

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

#### 17) 資金の借入れ

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

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・株価変動リスク

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

##### ・金利（債券価格）変動リスク

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

##### ・リートの価格変動リスク

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

##### ・為替変動リスク

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

#### 資産配分リスク

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

#### 信用リスク

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

### 流動性リスク

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

### カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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

### （その他の留意点）

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

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

次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。

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

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

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

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

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

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

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

## （２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

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

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

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

上記体制は2020年11月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

ありません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

##### (3)【信託報酬等】

信託報酬

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

###### 1) 当初設定日以降、2020年1月9日まで

年率1.243%（税抜1.13%）

###### 2) 2020年1月10日以降

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

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

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

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

1) 当初設定日以降、2020年1月9日まで

信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.495%	0.605%	0.03%

2) 2020年1月10日以降

リスク性資産割合	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
	委託会社	販売会社	受託会社
50%以上	0.495%	0.605%	0.03%
25%以上50%未満	0.216%	0.264%	0.03%
25%未満	0.108%	0.132%	0.03%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

#### 支払時期

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

#### 保証料

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

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

#### (4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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



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

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

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

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

## (5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### 1) 収益分配金に対する課税

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

### 2) 解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益(譲渡益)<sup>\*</sup>については譲渡所得として、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による申告分離課税の対象となり、確定申告が必要となります。なお、源泉徴収ありの特定口座(源泉徴収選択口座)を選択している場合は、20.315%(所得税15.315%および地方税5%)の税率による源泉徴収(原則として、確定申告は不要です。)が行なわれます。

<sup>\*</sup>解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益

確定申告等により、解約時および償還時の差損(譲渡損失)については、上場株式等の譲渡益、上場株式等の配当等および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限ります。)と損益通算が可能です。また、解約時および償還時の差益(譲渡益)、普通分配金および特定公社債等の利子所得(申告分離課税を選択したものに限ります。)については、上場株式等の譲渡損失と損益通算が可能です。

少額投資非課税制度「愛称：NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。また、未成年者少額投資非課税制度(ジュニアNISA)をご利用の場合、20歳未満の居住者などを対象に、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人受益者の場合

### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

上記は2020年11月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## 【りそな・リスクコントロールファンド2019-12】

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	11,689,285,680	76.29
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		3,633,098,639	23.71
合計（純資産総額）		15,322,384,319	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAMマネーマザーファンド	4,792,087,450	0.9991	4,787,774,572	0.9979	4,782,024,066	31.21
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)	3,835,074,617	1.0637	4,079,730,839	1.0742	4,119,637,153	26.89
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	713,182,797	1.3919	992,692,658	1.4867	1,060,288,864	6.92
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	977,024,125	1.0524	1,028,257,231	1.0522	1,028,024,784	6.71
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	119,707,955	1.3468	161,227,587	1.4662	175,515,803	1.15
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	138,807,054	1.1769	163,375,809	1.2556	174,286,137	1.14
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	171,925,322	0.9673	166,315,685	1.0120	173,988,425	1.14
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	74,359,478	1.1731	87,236,857	1.1827	87,944,954	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	82,680,792	1.0431	86,245,878	1.0592	87,575,494	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	76.29
合計	76.29

## 【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】

該当事項はありません。

### （３）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2020年11月16日)	15,333	15,333	0.9641	0.9641
2019年12月末日	19,295		1.0027	
2020年 1月末日	19,275		1.0114	
2月末日	18,719		1.0026	
3月末日	16,987		0.9585	
4月末日	16,401		0.9578	
5月末日	16,221		0.9583	
6月末日	15,977		0.9594	
7月末日	15,859		0.9624	
8月末日	15,747		0.9639	
9月末日	15,610		0.9629	
10月末日	15,364		0.9597	
11月末日	15,322		0.9659	

#### 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2019年12月17日～2020年11月16日	0.0000

#### 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2019年12月17日～2020年11月16日	3.59

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

### （４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2019年12月17日～2020年11月16日	19,250,909,180	3,346,033,820

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

## R A M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	70,023,418,290	83.04
地方債証券	日本	4,460,974,400	5.29
特殊債券	日本	5,648,109,942	6.70
社債券	日本	3,412,016,000	4.05
	フランス	98,731,000	0.12
	オーストラリア	100,226,000	0.12
	小計	3,610,973,000	4.28
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		580,779,456	0.69
合計（純資産総額）		84,324,255,088	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	100.43	1,285,542,400	0.100	2022/9/20	1.52
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	100.55	1,005,530,000	0.100	2023/3/20	1.19
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	950,000,000	100.99	959,485,900	100.85	958,132,000	0.100	2024/6/20	1.14
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	934,000,000	103.01	962,128,300	102.46	956,995,080	0.400	2025/9/20	1.13
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	920,000,000	100.85	927,868,200	100.79	927,314,000	0.100	2024/3/20	1.10
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	910,000,000	101.30	921,897,300	101.14	920,437,700	0.100	2029/9/20	1.09
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	910,000,000	100.80	917,369,000	100.60	915,469,100	0.100	2023/6/20	1.09
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	830,000,000	100.60	835,010,900	100.49	834,091,900	0.100	2022/12/20	0.99
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	820,000,000	101.80	834,760,000	101.26	830,389,400	0.100	2027/3/20	0.98
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	790,000,000	101.42	801,240,300	101.33	800,530,700	0.100	2028/9/20	0.95

日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	760,000,000	101.37	770,458,700	101.21	769,249,200	0.100	2026/12/20	0.91
日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	750,000,000	100.81	756,123,000	100.67	755,062,500	0.100	2023/9/20	0.90
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	720,000,000	100.85	726,151,400	100.97	727,027,200	0.100	2030/3/20	0.86
日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	720,000,000	100.90	726,484,900	100.78	725,623,200	0.100	2023/12/20	0.86
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	690,000,000	101.51	700,480,300	101.16	698,052,300	0.100	2026/9/20	0.83
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	670,000,000	100.79	675,316,300	100.85	675,748,600	0.100	2030/6/20	0.80
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	631,000,000	102.78	648,591,900	102.29	645,456,210	0.400	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	630,000,000	101.21	637,675,500	101.04	636,564,600	0.100	2029/12/20	0.75
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	630,000,000	100.97	636,170,500	100.99	636,262,200	0.100	2025/3/20	0.75
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	580,000,000	101.77	590,266,000	101.39	588,091,000	0.100	2028/3/20	0.70
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	580,000,000	101.01	585,901,600	101.00	585,834,800	0.100	2025/6/20	0.69
日本	国債証券	第354回利付国債(10年)	570,000,000	101.50	578,550,000	101.24	577,119,300	0.100	2029/3/20	0.68
日本	国債証券	第413回利付国債(2年)	550,000,000	100.46	552,569,700	100.37	552,062,500	0.100	2022/6/1	0.65
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	532,000,000	102.98	547,859,440	102.25	543,980,640	0.600	2023/12/20	0.65
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	520,000,000	102.49	532,981,900	102.05	530,691,200	0.300	2025/12/20	0.63
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	510,000,000	101.27	516,518,400	101.20	516,125,100	0.100	2029/6/20	0.61
日本	国債証券	第152回利付国債(20年)	450,000,000	114.94	517,245,300	113.98	512,910,000	1.200	2035/3/20	0.61
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	445,000,000	115.08	512,123,100	113.90	506,859,450	1.200	2034/12/20	0.60
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	490,000,000	101.38	496,803,800	101.11	495,468,400	0.100	2026/6/20	0.59
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	480,000,000	101.09	485,232,000	100.95	484,593,600	0.100	2024/12/20	0.57

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	83.04
地方債証券	5.29
特殊債券	6.70
社債券	4.28
合計	99.31

## 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

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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	85,775,632,584	43.15
	カナダ	4,003,705,319	2.01
	メキシコ	1,659,678,404	0.83
	ドイツ	15,379,472,546	7.74
	イタリア	19,116,068,434	9.62
	フランス	21,081,421,241	10.60
	オランダ	3,962,049,883	1.99
	スペイン	12,351,835,361	6.21
	ベルギー	5,076,460,365	2.55
	オーストリア	3,060,257,144	1.54
	フィンランド	1,267,087,033	0.64
	アイルランド	1,692,349,183	0.85
	イギリス	13,231,224,519	6.66
	スウェーデン	658,828,172	0.33
	ノルウェー	440,867,732	0.22
	デンマーク	1,118,334,343	0.56
	ポーランド	1,259,297,872	0.63
	オーストラリア	5,358,917,770	2.70
	シンガポール	867,997,083	0.44
	マレーシア	981,671,639	0.49
イスラエル	880,481,990	0.44	
	小計	199,223,638,617	100.22
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		428,125,880	0.22
合計（純資産総額）		198,795,512,737	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		199,108,274,360	100.16

(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	10,150,000	10,263.22	1,041,717,394	10,187.71	1,034,052,881	0.625	2030/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,840,000	11,990.31	820,137,423	12,110.48	828,357,480	2.875	2028/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,362.47	801,088,206	12,346.47	800,051,487	3.125	2028/11/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,330,000	22,692.22	755,650,997	23,683.14	788,648,763	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,900,000	9,796.36	773,912,976	9,881.72	780,656,181	1.375	2050/8/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,354.07	757,918,126	10,212.06	747,522,925	0.625	2030/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	11,761.07	716,249,364	12,077.21	735,502,241	2.875	2028/5/15	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,440,000	15,689.82	696,628,271	15,932.50	707,403,259	2.500	2030/5/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,720,000	14,512.80	685,004,196	14,871.55	701,937,486	1.500	2031/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,050,000	14,330.20	723,675,374	13,864.44	700,154,454	3.000	2048/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	11,630.06	680,358,925	11,950.59	699,109,899	2.750	2028/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,113.46	700,148,570	11,047.23	695,976,105	1.500	2030/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,179.25	683,052,543	11,206.32	684,706,232	2.375	2024/8/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,160,000	13,359.36	689,343,396	13,209.28	681,598,995	1.750	2023/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,159.89	685,818,183	11,970.07	675,112,283	2.625	2029/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,150,000	10,900.13	670,358,536	10,894.24	669,996,139	1.500	2024/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,172.35	652,465,354	11,202.66	654,235,904	2.500	2024/5/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	18,985.48	653,100,637	18,833.14	647,860,255	5.500	2029/4/25	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,180,000	15,284.10	638,875,636	15,347.57	641,528,492	2.750	2027/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,285.33	626,336,355	11,540.10	640,476,020	2.250	2027/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,139.73	620,483,243	11,349.98	632,194,025	2.250	2025/11/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,060,000	10,382.76	629,195,656	10,384.94	629,327,425	0.125	2022/8/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,381.37	622,882,402	10,387.37	623,242,572	0.125	2022/7/31	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,480,000	12,517.26	560,773,686	13,904.21	622,908,821	3.000	2049/2/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,400,000	10,009.96	640,637,824	9,576.54	612,899,005	1.250	2050/5/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,141.38	610,548,025	11,178.72	612,594,188	2.750	2023/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,460,000	10,827.55	591,184,529	11,200.84	611,566,039	2.250	2024/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,470,000	13,125.31	586,701,529	13,605.12	608,149,125	2.875	2049/5/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,240,000	11,501.39	602,672,955	11,563.44	605,924,424	2.250	2027/11/15	0.30
ドイツ	国債証券	GOV OF GERMANY	2,890,000	20,301.96	586,726,815	20,943.10	605,255,716	2.500	2044/7/4	0.30

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.22
合計	100.22

## 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	824,725,000.00	85,600,764,397	85,598,207,750	43.06
	カナダドル	売建	50,157,000.00	4,009,314,842	4,007,544,300	2.02
	メキシコペソ	売建	323,831,000.00	1,671,012,324	1,667,729,650	0.84
	ユーロ	売建	667,066,000.00	82,994,083,695	82,976,339,740	41.74
	英ポンド	売建	95,879,000.00	13,270,900,027	13,278,282,710	6.68
	スウェーデンクローナ	売建	54,589,000.00	667,929,168	667,077,580	0.34
	ノルウェークローネ	売建	38,088,000.00	447,998,673	447,153,120	0.22
	デンマーククローネ	売建	67,947,000.00	1,135,299,244	1,135,394,370	0.57
	ポーランドズロチ	売建	45,777,000.00	1,269,034,571	1,267,565,130	0.64
	オーストラリアドル	売建	70,117,000.00	5,388,276,891	5,389,192,620	2.71
	シンガポールドル	売建	11,335,000.00	879,777,360	879,709,350	0.44
	マレーシアリングット	売建	35,720,000.00	898,585,065	911,574,400	0.46
	イスラエルシケル	売建	28,177,000.00	883,554,642	882,503,640	0.44

(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11月30日現在です。

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

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	40,154,908,840	98.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		753,867,404	1.84
合計(純資産総額)		40,908,776,244	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	737,310,000	1.80

(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	183,800	7,180.46	1,319,769,396	6,999.00	1,286,416,200	3.14
日本	株式	ソニー	電気機器	103,200	7,709.70	795,641,932	9,704.00	1,001,452,800	2.45
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	128,200	5,413.05	693,953,044	7,272.00	932,270,400	2.28
日本	株式	キーエンス	電気機器	14,900	42,256.85	629,627,185	53,290.00	794,021,000	1.94
日本	株式	任天堂	その他製品	10,100	47,134.38	476,057,288	59,260.00	598,526,000	1.46
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	216,000	2,580.16	557,315,758	2,465.00	532,440,000	1.30
日本	株式	日本電産	電気機器	39,600	7,817.94	309,590,722	13,305.00	526,878,000	1.29
日本	株式	第一三共	医薬品	141,400	2,712.35	383,526,681	3,694.00	522,331,600	1.28
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	137,000	3,956.13	541,990,763	3,745.00	513,065,000	1.25
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,111,100	482.87	536,525,630	448.50	498,328,350	1.22
日本	株式	ダイキン工業	機械	21,000	16,926.68	355,460,474	23,665.00	496,965,000	1.21
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	112,700	4,020.85	453,150,076	4,400.00	495,880,000	1.21
日本	株式	信越化学工業	化学	27,700	12,749.90	353,172,378	17,135.00	474,639,500	1.16
日本	株式	HOYA	精密機器	32,700	10,941.20	357,777,377	13,910.00	454,857,000	1.11
日本	株式	村田製作所	電気機器	48,400	6,528.98	316,002,918	9,129.00	441,843,600	1.08
日本	株式	ファナック	電気機器	15,500	19,584.24	303,555,785	25,365.00	393,157,500	0.96
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	129,700	2,750.57	356,749,934	2,871.50	372,433,550	0.91
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	10,400	25,794.95	268,267,572	35,470.00	368,888,000	0.90
日本	株式	KDDI	情報・通信業	117,800	3,141.71	370,093,527	2,982.50	351,338,500	0.86
日本	株式	S M C	機械	5,200	52,621.53	273,631,989	66,320.00	344,864,000	0.84
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	112,300	3,333.51	374,353,369	3,032.00	340,493,600	0.83
日本	株式	エムスリー	サービス業	34,700	4,472.20	155,185,542	9,622.00	333,883,400	0.82
日本	株式	日立製作所	電気機器	79,100	3,843.55	304,024,867	3,966.00	313,710,600	0.77
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	113,400	2,506.47	284,234,409	2,758.50	312,813,900	0.76
日本	株式	花王	化学	39,400	8,557.22	337,154,854	7,808.00	307,635,200	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	57,400	5,281.03	303,131,652	5,190.00	297,906,000	0.73
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,700	14,488.64	241,960,386	17,765.00	296,675,500	0.73
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	220,700	1,436.37	317,007,648	1,327.50	292,979,250	0.72
日本	株式	中外製薬	医薬品	51,500	4,306.44	221,781,693	5,044.00	259,766,000	0.63
日本	株式	三菱商事	卸売業	106,300	2,577.53	273,991,562	2,433.00	258,627,900	0.63

## 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	0.08
		鉱業	0.14
		建設業	2.32
		食料品	3.48
		繊維製品	0.46
		パルプ・紙	0.20

化学	7.46
医薬品	5.96
石油・石炭製品	0.35
ゴム製品	0.53
ガラス・土石製品	0.78
鉄鋼	0.60
非鉄金属	0.65
金属製品	0.61
機械	5.65
電気機器	16.64
輸送用機器	6.88
精密機器	2.75
その他製品	2.65
電気・ガス業	1.30
陸運業	3.44
海運業	0.17
空運業	0.35
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.23
卸売業	4.37
小売業	4.72
銀行業	4.47
証券、商品先物取引業	0.77
保険業	1.90
その他金融業	1.09
不動産業	2.00
サービス業	5.98
合 計	98.16

## 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

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	42	日本円	684,128,100	737,310,000	1.80

(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11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	41,012,014,133	53.79
	カナダ	2,092,153,242	2.74
	パナマ	14,875,313	0.02
	ドイツ	1,840,546,850	2.41
	イタリア	387,399,094	0.51
	フランス	2,141,831,539	2.81
	オランダ	1,229,740,528	1.61
	スペイン	515,510,499	0.68
	ベルギー	186,997,594	0.25
	オーストリア	33,842,592	0.04
	ルクセンブルク	43,277,543	0.06
	フィンランド	252,870,822	0.33
	アイルランド	1,125,668,513	1.48
	ポルトガル	34,021,815	0.04
	イギリス	2,585,843,745	3.39
	スイス	2,160,739,914	2.83
	スウェーデン	647,525,692	0.85
	ノルウェー	120,292,471	0.16
	デンマーク	496,439,536	0.65
	ケイマン	130,688,514	0.17
	リベリア	20,832,260	0.03
	オーストラリア	1,303,039,376	1.71
	パミューダ	185,741,163	0.24
	ニュージーランド	64,733,422	0.08
	パプアニューギニア	4,127,167	0.01
	香港	494,314,491	0.65
	シンガポール	202,108,126	0.27
	イスラエル	118,410,457	0.16
	キュラソー	42,195,800	0.06
	ジャージー	201,940,146	0.26
マン島	10,038,467	0.01	
小計		59,699,760,824	78.30
新株予約権証券	スイス	353,702	0.00
投資証券	アメリカ	1,145,072,380	1.50
	カナダ	8,595,740	0.01
	フランス	34,919,645	0.05
	イギリス	27,171,108	0.04

	オーストラリア	96,503,533	0.13
	香港	28,730,270	0.04
	シンガポール	26,501,410	0.03
	小計	1,367,494,086	1.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		15,175,057,408	19.90
合計（純資産総額）		76,242,666,020	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	12,165,030,706	15.96
	買建	ドイツ	3,212,312,497	4.21

(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。

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		224,728,350	0.29

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	224,180	9,406.96	2,108,853,866	12,112.53	2,715,388,119	3.56
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	93,149	19,232.47	1,791,486,155	22,360.24	2,082,834,434	2.73
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	5,483	249,329.83	1,367,075,501	331,963.87	1,820,157,913	2.39
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	31,154	24,535.36	764,374,622	28,861.68	899,156,807	1.18
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	3,924	155,432.10	609,915,565	186,294.50	731,019,654	0.96
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	3,892	155,679.41	605,904,273	185,653.50	722,563,452	0.95
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	9,615	22,556.01	216,876,127	60,854.60	585,117,041	0.77
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	34,128	15,421.34	526,299,720	14,960.15	510,560,340	0.67
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	39,445	12,260.44	483,613,262	12,593.54	496,752,414	0.65
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	21,845	21,155.71	462,146,643	21,920.79	478,859,658	0.63

アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	32,028	13,126.76	420,423,901	14,400.19	461,209,378	0.60
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	38,555	12,404.79	478,266,960	11,761.43	453,461,972	0.59
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	7,959	35,361.05	281,438,658	55,108.45	438,608,158	0.58
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	18,044	22,099.98	398,772,153	24,055.72	434,061,583	0.57
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	12,296	30,997.28	381,142,616	35,108.58	431,695,181	0.57
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	11,575	33,638.75	389,368,593	35,225.98	407,740,745	0.53
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	13,939	25,473.18	355,070,658	28,672.60	399,667,387	0.52
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	23,512	13,770.76	323,778,230	15,285.33	359,388,813	0.47
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	53,764	6,132.08	329,685,594	6,293.65	338,372,132	0.44
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	59,369	4,498.91	267,096,103	5,376.30	319,186,000	0.42
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	14,458	15,237.11	220,298,185	21,961.30	317,516,578	0.42
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,120	37,250.79	339,727,264	34,778.42	317,179,236	0.42
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	6,244	41,627.17	259,920,053	49,558.64	309,444,190	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	101,165	3,122.29	315,867,224	3,011.77	304,685,823	0.40
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	11,655	21,272.34	247,929,222	25,726.28	299,839,802	0.39
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	5,727	43,238.39	247,626,274	51,047.39	292,348,405	0.38
アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活必需品小売り	18,404	12,596.55	231,827,001	15,749.72	289,857,921	0.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	52,919	5,518.66	292,042,152	5,475.00	289,731,684	0.38
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	92,649	3,639.78	337,222,371	3,015.92	279,422,593	0.37
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	72,105	3,768.13	271,701,545	3,867.82	278,889,500	0.37

#### 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	2.46
		素材	3.53
		資本財	5.26
		商業・専門サービス	0.95
		運輸	1.69
		自動車・自動車部品	1.52

	耐久消費財・アパレル	1.58
	消費者サービス	1.28
	メディア・娯楽	5.57
	小売	4.79
	食品・生活必需品小売り	1.21
	食品・飲料・タバコ	3.38
	家庭用品・パーソナル用品	1.65
	ヘルスケア機器・サービス	4.21
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.28
	銀行	4.59
	各種金融	3.50
	保険	2.55
	不動産	0.36
	ソフトウェア・サービス	9.58
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.74
	電気通信サービス	1.59
	公益事業	2.70
	半導体・半導体製造装置	3.33
新株予約権証券		0.00
投資証券		1.79
合 計		80.10

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIN2012	買建	644	米ドル	109,996,852.5	11,427,573,006	117,095,300	12,165,030,706	15.96
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002012	買建	1,315	ユーロ	24,386,671	3,033,214,139	25,826,600	3,212,312,497	4.21

(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。

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	1,421,000.00	147,612,201	147,613,480	0.19
	カナダドル	買建	331,000.00	26,461,894	26,460,140	0.03
	ユーロ	買建	142,000.00	17,660,185	17,661,960	0.02
	英ポンド	買建	51,000.00	7,065,254	7,065,540	0.01

ノルウェークローネ	買建	299,000.00	3,514,774	3,513,250	0.00
デンマーククローネ	買建	582,000.00	9,726,675	9,725,220	0.01
オーストラリアドル	買建	126,000.00	9,689,765	9,689,400	0.01
香港ドル	買建	224,000.00	3,001,801	2,999,360	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	35,678,137	0.29
	アルゼンチン	1,809,774	0.01
	メキシコ	155,466,245	1.28
	ブラジル	447,153,209	3.67
	チリ	47,171,909	0.39
	コロンビア	14,693,074	0.12
	ペルー	2,360,204	0.02
	オランダ	31,333,370	0.26
	ルクセンブルク	18,061,749	0.15
	ギリシャ	10,723,103	0.09
	トルコ	31,968,202	0.26
	チェコ	9,141,383	0.08
	ハンガリー	19,212,852	0.16
	ポーランド	56,940,636	0.47
	ロシア	228,787,632	1.88
	ケイマン	2,409,123,918	19.77
	バミューダ	71,625,113	0.59
	香港	190,748,598	1.57
	シンガポール	2,014,958	0.02
	マレーシア	146,983,509	1.21
	タイ	175,097,455	1.44
	フィリピン	76,017,185	0.62
	インドネシア	128,319,618	1.05
	韓国	1,160,563,101	9.52
	台湾	1,117,242,827	9.17
	中国	1,027,297,802	8.43
インド	908,634,411	7.46	
カタール	64,518,883	0.53	
エジプト	7,609,668	0.06	

	南アフリカ	314,178,439	2.58
	ジャージー	6,706,304	0.06
	アラブ首長国連邦	48,955,859	0.40
	マン島	2,255,355	0.02
	サウジアラビア	235,964,329	1.94
	小計	9,204,358,811	75.53
投資証券	メキシコ	3,525,421	0.03
	南アフリカ	2,673,996	0.02
	小計	6,199,417	0.05
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,976,060,784	24.42
合計（純資産総額）		12,186,619,012	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	3,002,317,098	24.64

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

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		34,198,381	0.28
	売建		160,164	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	投資比率（％）
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	22,430	23,628.54	529,988,176	28,723.50	644,268,266	5.29
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	68,500	5,728.09	392,374,726	7,812.20	535,135,700	4.39
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半 導体製造装 置	294,000	1,254.23	368,744,234	1,779.96	523,308,240	4.29
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロ ジー・ハ ードウェア および機器	57,181	5,485.50	313,666,555	6,424.44	367,355,904	3.01
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	42,600	2,164.34	92,201,006	4,180.80	178,102,080	1.46
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,210	18,209.95	94,873,850	21,579.23	112,427,789	0.92
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	37,549	2,345.90	88,086,376	2,721.01	102,171,505	0.84
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	10,220	5,370.28	54,884,338	9,288.80	94,931,586	0.78
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,153,000	83.92	96,761,174	81.74	94,246,220	0.77



中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	71,500	1,196.92	85,580,474	1,228.78	87,857,770	0.72
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	13,000	1,020.42	13,265,532	5,610.06	72,930,780	0.60
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	22,428	3,125.62	70,101,489	3,181.31	71,350,477	0.59
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	44,914	1,162.94	52,232,502	1,551.00	69,661,614	0.57
ブラジル	株式	VALE SA	素材	44,400	1,063.82	47,233,792	1,526.44	67,774,043	0.56
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	6,610	8,616.47	56,954,871	9,306.96	61,519,006	0.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	9,959	4,480.16	44,617,922	5,821.55	57,976,916	0.48
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	3,300	6,294.68	20,772,463	14,965.35	49,385,670	0.41
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	731,000	71.42	52,213,067	65.25	47,703,598	0.39
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	4,910	7,893.26	38,755,923	9,697.09	47,612,725	0.39
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	18,000	1,664.27	29,956,920	2,639.00	47,502,000	0.39
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	74,000	860.57	63,682,873	637.17	47,150,580	0.39
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,250	13,193.45	42,878,715	14,484.34	47,074,117	0.39
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,388	3,163.29	39,186,870	3,778.30	46,805,661	0.38
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	32,945	1,568.26	51,666,399	1,409.78	46,445,443	0.38
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	151,800	317.25	48,158,871	300.66	45,640,795	0.37
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	67,302	656.80	44,204,426	667.42	44,918,936	0.37
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	128,400	200.39	25,730,429	349.07	44,820,588	0.37
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	552	40,806.87	22,525,397	76,302.00	42,118,704	0.35
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,478	20,378.12	30,118,864	26,799.89	39,610,252	0.33
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS(CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	37,500	608.93	22,834,908	1,019.74	38,240,250	0.31

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	3.99
		素材	5.48
		資本財	2.05
		商業・専門サービス	0.19
		運輸	1.04
		自動車・自動車部品	2.55

	耐久消費財・アパレル	0.98
	消費者サービス	1.24
	メディア・娯楽	6.82
	小売	10.05
	食品・生活必需品小売り	0.96
	食品・飲料・タバコ	2.64
	家庭用品・パーソナル用品	0.84
	ヘルスケア機器・サービス	0.90
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.23
	銀行	9.83
	各種金融	1.69
	保険	2.35
	不動産	1.64
	ソフトウェア・サービス	1.71
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.33
	電気通信サービス	2.29
	公益事業	1.59
	半導体・半導体製造装置	6.14
投資証券		0.05
合計		75.58

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 2012	買建	468	米ドル	26,212,085	2,723,173,517	28,899,000	3,002,317,098	24.64

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

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	290,540.87	30,182,035	30,181,381	0.25
	香港ドル	買建	300,000.00	4,020,300	4,017,000	0.03
	ブラジルリアル	売建	5,945.94	116,123	115,706	0.00
	フィリピンペソ	売建	4,176.90	9,022	9,022	0.00
	オフショア人民元	売建	2,242.80	35,570	35,436	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## RAM新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,397,492,641	29.89
	アイルランド	3,257,205,430	69.67
	小計	4,654,698,071	99.56
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		20,396,414	0.44
合計(純資産総額)		4,675,094,485	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	538,147	6,008.71	3,233,570,119	6,052.63	3,257,205,430	69.67
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	414,152	3,379.13	1,399,474,797	3,374.34	1,397,492,641	29.89

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	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。

## RAM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	17,798,743,380	97.16
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		520,190,579	2.84
合計(純資産総額)		18,318,933,959	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	503,024,000	2.75

(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	2,230	749,888.13	1,672,250,546	577,000	1,286,710,000	7.02
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,981	709,486.08	1,405,491,931	542,000	1,073,702,000	5.86
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	2,998	305,429.17	915,676,655	327,500	981,845,000	5.36
日本	投資証券	GLP投資法人	5,697	144,247.61	821,778,689	157,900	899,556,300	4.91
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	6,407	167,523.54	1,073,323,336	136,000	871,352,000	4.76
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	2,827	274,714.06	776,616,667	251,300	710,425,100	3.88
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	3,722	199,630.72	743,025,550	166,500	619,713,000	3.38
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	3,948	202,775.88	800,559,183	156,000	615,888,000	3.36
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,882	333,837.19	628,281,604	301,500	567,423,000	3.10
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4,237	167,352.52	709,072,651	118,000	499,966,000	2.73
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	2,801	169,931.65	475,978,577	176,000	492,976,000	2.69
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	5,827	84,055.02	489,788,617	74,600	434,694,200	2.37
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	613	767,993.71	470,780,145	662,000	405,806,000	2.22
日本	投資証券	アクティブピア・プロパティーズ投資法人	993	497,918.81	494,433,385	390,000	387,270,000	2.11
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,294	286,638.13	370,909,744	295,000	381,730,000	2.08
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	658	671,590.21	441,906,362	577,000	379,666,000	2.07
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,234	426,750.42	526,610,028	306,500	378,221,000	2.06
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,208	167,935.23	370,801,006	156,200	344,889,600	1.88
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	691	511,924.1	353,739,554	496,000	342,736,000	1.87
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,382	62,529.87	399,065,671	51,400	328,034,800	1.79
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,327	167,188.6	389,047,893	137,900	320,893,300	1.75
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	8,284	45,474.87	376,713,827	30,950	256,389,800	1.40

日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	422	770,423.7	325,118,804	599,000	252,778,000	1.38
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	865	341,405.25	295,315,544	289,300	250,244,500	1.37
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	657	409,618.46	269,119,334	375,000	246,375,000	1.34
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,010	137,062.18	275,494,990	122,100	245,421,000	1.34
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	1,293	201,626.21	260,702,699	178,100	230,283,300	1.26
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,838	169,110.12	310,824,403	124,200	228,279,600	1.25
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,595	174,380.06	278,136,211	141,800	226,171,000	1.23
日本	投資証券	日本リート投資法人	644	443,614.15	285,687,518	350,500	225,722,000	1.23

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.16
合計	97.16

## 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

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	298	日本円	507,068,980	503,024,000	2.75

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

## RAM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	オーストラリア	16,409,517	0.07
投資証券	アメリカ	16,152,894,892	72.60
	カナダ	433,410,995	1.95
	ドイツ	68,164,235	0.31
	イタリア	2,207,662	0.01
	フランス	568,873,999	2.56
	オランダ	44,163,108	0.20
	スペイン	111,241,786	0.50
	ベルギー	319,695,133	1.44

	アイルランド	28,996,805	0.13
	イギリス	1,202,045,620	5.40
	オーストラリア	1,699,511,317	7.64
	ニュージーランド	111,550,914	0.50
	香港	382,271,314	1.72
	シンガポール	928,049,901	4.17
	韓国	20,102,845	0.09
	イスラエル	14,500,380	0.07
	ガーンジー	54,073,047	0.24
	マン島	6,330,453	0.03
	小計	22,148,084,406	99.54
	コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	85,942,593	0.39
	合計（純資産総額）	22,250,436,516	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		27,943,720	0.13

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	129,005	9,837.56	1,269,095,628	10,451.33	1,348,274,343	6.06
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,469	68,168.79	1,054,503,143	72,777.02	1,125,787,766	5.06
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,031	14,262.03	670,757,887	14,204.87	668,069,697	3.00
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,533	21,912.25	581,397,804	22,858.91	606,515,637	2.73
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	56,941	10,523.82	599,237,266	8,887.78	506,079,622	2.27
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	73,069	7,056.37	515,602,399	6,705.06	489,932,073	2.20
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,574	19,377.42	476,180,942	17,440.01	428,570,911	1.93
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	291,553	1,188.90	346,627,604	1,431.29	417,298,380	1.88
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	60,474	6,923.17	418,672,356	6,403.77	387,262,168	1.74
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	59,805	7,254.01	433,826,388	6,150.28	367,817,974	1.65
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,543	16,825.48	345,645,923	16,844.72	346,041,177	1.56
香港	投資証券	LINK REIT	362,700	968.11	351,136,741	917.90	332,922,330	1.50
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	65,417	4,863.30	318,142,501	4,976.33	325,536,645	1.46
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,394	27,827.75	317,069,394	25,973.53	295,942,502	1.33
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	94,407	3,219.48	303,941,762	3,104.23	293,061,344	1.32
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	97,951	2,997.46	293,605,115	2,987.87	292,665,481	1.32
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	24,531	11,752.32	288,296,196	10,641.45	261,045,476	1.17

アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	65,092	3,713.91	241,746,042	3,988.33	259,608,839	1.17
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	22,544	10,774.77	242,906,607	11,427.90	257,630,578	1.16
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,990	12,994.19	259,753,861	12,882.35	257,518,376	1.16
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	206,116	1,256.98	259,085,147	1,248.88	257,416,149	1.16
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	92,446	2,429.23	224,572,814	2,667.89	246,636,240	1.11
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,005	15,262.26	259,534,807	14,400.19	244,875,280	1.10
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	30,177	7,753.58	233,980,028	7,260.87	219,111,337	0.98
アメリカ	投資証券	UDR INC	51,122	4,407.60	225,325,483	4,074.56	208,299,953	0.94
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	914,141	229.04	209,381,239	221.50	202,482,963	0.91
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,922	11,061.49	264,613,015	7,855.84	187,927,424	0.84
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	91,838	2,091.78	192,105,502	2,033.12	186,718,345	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	122,445	1,443.45	176,743,605	1,518.87	185,978,258	0.84
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,344	6,982.19	204,885,596	6,099.38	178,980,263	0.80

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産	0.07
投資証券			99.54
合計			99.61

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	269,000.00	27,943,477	27,943,720	0.13

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R A Mマネーマザーファンド

以下の運用状況は2020年11月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	18,202,523,800	71.52
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		7,247,282,540	28.48
合計(純資産総額)		25,449,806,340	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938回国庫短期証券	2,200,000,000	100.02	2,200,594,000	100.00	2,200,107,800		2020/12/21	8.64
日本	国債証券	第943回国庫短期証券	2,000,000,000	100.02	2,000,508,000	100.01	2,000,288,000		2021/1/18	7.86
日本	国債証券	第941回国庫短期証券	2,000,000,000	100.04	2,000,828,000	100.01	2,000,280,000		2021/1/12	7.86
日本	国債証券	第940回国庫短期証券	2,000,000,000	100.05	2,001,020,000	100.01	2,000,240,000		2021/1/6	7.86
日本	国債証券	第951回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,378,000	100.02	1,500,378,000		2021/2/22	5.90
日本	国債証券	第955回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,361,500	100.02	1,500,346,500		2021/3/8	5.90
日本	国債証券	第949回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,354,000	100.02	1,500,340,500		2021/2/15	5.90
日本	国債証券	第948回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,340,500	100.02	1,500,309,000		2021/2/8	5.90
日本	国債証券	第936回国庫短期証券	1,500,000,000	100.02	1,500,441,000	100.00	1,500,048,000		2020/12/14	5.89
日本	国債証券	第934回国庫短期証券	1,500,000,000	100.03	1,500,463,500	100.00	1,500,021,000		2020/12/7	5.89
日本	国債証券	第944回国庫短期証券	1,000,000,000	100.02	1,000,224,000	100.01	1,000,165,000		2021/1/25	3.93

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	71.52
合計	71.52

## 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

該当事項はありません。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なってありません。

## 2【換金（解約）手続等】



- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の扱いとなります。
- (3) 解約請求不可日  
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・ニューヨークの銀行の休業日
  - ・ニューヨーク証券取引所の休業日
  - ・ロンドンの銀行の休業日
  - ・ロンドン証券取引所の休業日
- (4) 解約制限  
ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (5) 解約価額  
解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
- ・基準価額につきましては、販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。
- 委託会社の照会先  
りそなアセットマネジメント株式会社  
電話番号：0120-223351  
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)  
ホームページ アドレス：<https://www.resona-am.co.jp/>
- (6) 手取額  
1口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。  
税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。  
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。
- (7) 解約単位  
最低単位を1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。
- (8) 解約代金の支払い  
原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。
- (9) 受付の中止および取消
- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。  
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。
  - ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。
  - ・また基準価額が『確保ライン』まで下落した場合は、償還日までの一定期間において解約請求の受付を中止する場合があります。

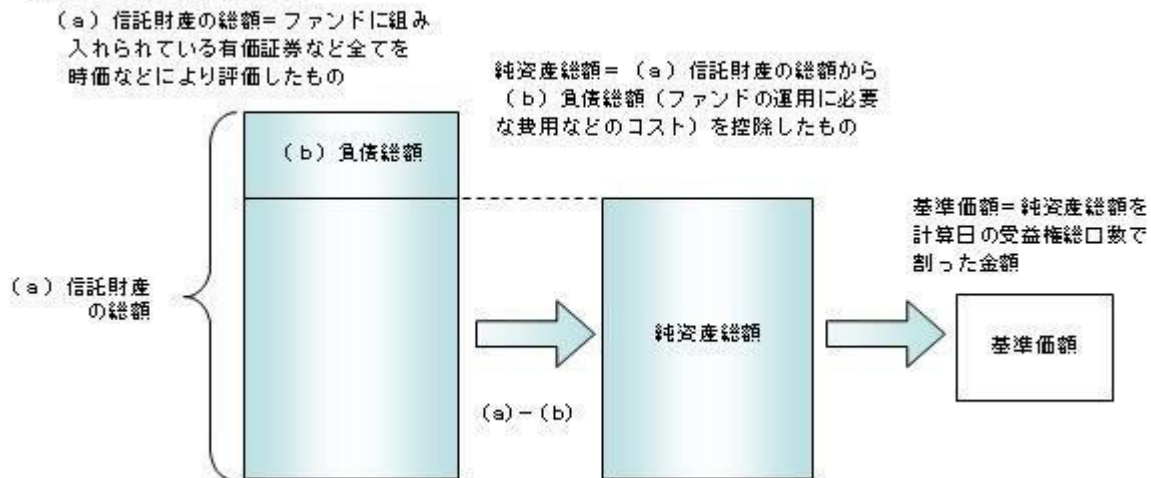
### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

#### <基準価額算出の流れ>



#### 有価証券などの評価基準

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

#### <主な資産の評価方法>

##### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### 国内上場株式

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

##### 外国株式

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

##### 公社債（国内・外国）

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

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
  - ・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
  - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

##### 国内上場不動産投信

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

##### 海外上場不動産投信

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

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

#### 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

##### 委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

**（２）【保管】**

該当事項はありません。

**（３）【信託期間】**

2029年11月15日までとします（2019年12月17日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

**（４）【計算期間】**

毎年11月16日から翌年11月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

**（５）【その他】**

信託の終了（繰上償還）

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

償還金について

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

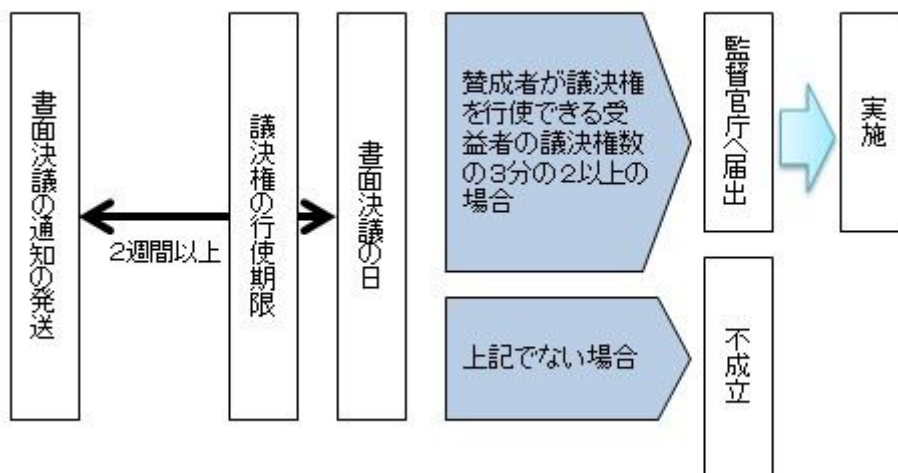
信託約款の変更など

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

## 書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行いません。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

### <書面決議の主な流れ>



## 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

## 運用報告書の作成

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

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

## 関係法人との契約について

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

## 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2019年12月17日から2020年11月16日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【りそな・リスクコントロールファンド2019 - 12】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2020年11月16日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,461,590,698
親投資信託受益証券		10,923,813,338
未収入金		43,810,000
流動資産合計		15,429,214,036
資産合計		15,429,214,036
負債の部		
流動負債		
未払金		14,365,000
未払解約金		32,454,049
未払受託者報酬		2,117,178
未払委託者報酬		31,666,570
未払利息		12,101
その他未払費用		14,819,367
流動負債合計		95,434,265
負債合計		95,434,265
純資産の部		
元本等		
元本		15,904,875,360
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		571,095,589
元本等合計		15,333,779,771
純資産合計		15,333,779,771
負債純資産合計		15,429,214,036

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2019年12月17日 至 2020年11月16日
営業収益	
有価証券売買等損益	501,344,233
営業収益合計	501,344,233
営業費用	
支払利息	2,363,800
受託者報酬	5,092,738
委託者報酬	109,524,151
その他費用	35,201,647
営業費用合計	152,182,336
営業利益又は営業損失（ ）	653,526,569
経常利益又は経常損失（ ）	653,526,569
当期純利益又は当期純損失（ ）	653,526,569
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	82,430,980
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	82,430,980
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	571,095,589



## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日(2019年12月17日)から2020年11月16日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2020年11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
設定年月日	2019年12月17日
設定元本額	19,250,909,180円
期首元本額	19,250,909,180円
元本残存率	82.6%
2. 計算期間の末日における受益権の総数	15,904,875,360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	571,095,589円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9641円
(10,000口当たり純資産額)	(9,641円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年12月17日 至 2020年11月16日	
分配金の計算過程	
A 当ファンドの配当等収益額	2,363,800円
B 親ファンドの配当等収益額	132,730,999円
RAM国内株式マザーファンド	2,537,570円
RAM国内リートマザーファンド	4,133,424円
RAM先進国株式マザーファンド	14,547,474円
RAM新興国株式マザーファンド	2,350,413円
RAM先進国リートマザーファンド	6,368,790円
RAM国内債券マザーファンド	8,631,716円
RAM新興国債券マザーファンド	6,288,569円
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	89,334,510円
RAMマネーマザーファンド	1,461,467円
C 配当等収益額合計(A+B)	130,367,199円

D 経費	149,818,536円
E 差引配当等収益額(C-D)	19,451,337円
F 当ファンドの当期末残存受益権口数	15,904,875,360口
G 当ファンドの期中平均残存受益権口数	17,198,370,078口
H 分配対象配当等収益額(E×F/G)	0円
I 元本超過額	0円
J 分配可能額(H<I)	0円
K 10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	0円
L 10,000口当たりの分配額	0円
M 収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

<p>第1期 自 2019年12月17日 至 2020年11月16日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期 2020年11月16日現在</p>
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

第1期 自 2019年12月17日 至 2020年11月16日
該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2019年12月17日 至 2020年11月16日
	計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	102,524,222
合計	102,524,222

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	915,287,182	962,882,115	
	R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	3,616,044,675	3,868,082,988	
	R A M国内株式マザーファンド	106,597,834	132,085,376	
	R A M先進国株式マザーファンド	537,255,429	785,359,986	
	R A M新興国株式マザーファンド	92,355,993	132,032,127	
	R A M新興国債券マザーファンド	61,950,301	65,233,666	
	R A M国内リートマザーファンド	54,904,314	64,699,243	
	R A M先進国リートマザーファンド	129,229,788	131,413,771	
	R A Mマネーマザーファンド	4,792,087,450	4,782,024,066	
合計		10,305,712,966	10,923,813,338	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

## RAM国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2020年11月16日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	340,112
コール・ローン	533,873,440
国債証券	69,715,347,180
地方債証券	4,463,091,000
特殊債券	5,649,807,418
社債券	3,611,213,000
未収入金	828,000
未収利息	159,898,115
前払費用	7,689,081
流動資産合計	84,142,087,346
資産合計	84,142,087,346
負債の部	
流動負債	
未払解約金	12,551,000
未払利息	1,448
流動負債合計	12,552,448
負債合計	12,552,448
純資産の部	
元本等	
元本	79,972,852,240
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,156,682,658
元本等合計	84,129,534,898
純資産合計	84,129,534,898
負債純資産合計	84,142,087,346

## 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11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	69,535,830,577円
期中追加設定元本額	66,052,543,701円
期中一部解約元本額	55,615,522,038円
期末元本額	79,972,852,240円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	7,335,838,450円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,284,346,389円
りそなラップ型ファンド(成長型)	410,039,911円
DCりそな グローバルバランス	429,517,101円
つみたてバランスファンド	1,824,356,238円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,335,171,405円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	275,554,376円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	63,416,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	21,886,870円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	6,568,432円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	778,790円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	290,654円
リスクコントロール・オープン	53,313,365円
FWりそな円建債券アクティブファンド	520,837,035円
FWりそな国内債券インデックスファンド	43,376,047,558円
Smart-i 国内債券インデックス	912,888,077円
Smart-i 8資産バランス 安定型	517,792,646円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	290,194,512円
Smart-i 8資産バランス 成長型	104,392,988円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,074,127,299円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,452,149,660円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,410,023,438円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	915,287,182円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,696,355,137円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	446,003,991円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	10,616,119円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,067,368,018円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	137,690,182円
2. 計算日における受益権の総数	79,972,852,240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	1.0520円
(10,000口当たり純資産額)	(10,520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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		991,359,560
地方債証券		24,934,000
特殊債券		39,755,713

社債券	23,345,000
合計	1,079,394,273

(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407回利付国債(2年)	330,000,000	330,874,500	
	第408回利付国債(2年)	270,000,000	270,772,200	
	第409回利付国債(2年)	30,000,000	30,092,400	
	第410回利付国債(2年)	410,000,000	411,476,000	
	第411回利付国債(2年)	420,000,000	421,524,600	
	第412回利付国債(2年)	330,000,000	331,320,000	
	第413回利付国債(2年)	550,000,000	552,288,000	
	第414回利付国債(2年)	430,000,000	431,849,000	
	第415回利付国債(2年)	240,000,000	241,065,600	
	第416回利付国債(2年)	120,000,000	120,559,200	
	第417回利付国債(2年)	500,000,000	502,390,000	
	第130回利付国債(5年)	240,000,000	240,614,400	
	第131回利付国債(5年)	360,000,000	361,155,600	
	第132回利付国債(5年)	40,000,000	40,156,000	
	第133回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,285,900,800	
	第134回利付国債(5年)	680,000,000	683,563,200	
	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,005,860,000	
	第136回利付国債(5年)	910,000,000	915,787,600	
	第137回利付国債(5年)	750,000,000	755,235,000	



第138回利付国債（5年）	720,000,000	725,472,000	
第139回利付国債（5年）	860,000,000	867,060,600	
第140回利付国債（5年）	950,000,000	958,388,500	
第141回利付国債（5年）	450,000,000	454,257,000	
第142回利付国債（5年）	480,000,000	484,838,400	
第143回利付国債（5年）	630,000,000	636,596,100	
第144回利付国債（5年）	550,000,000	555,835,500	
第145回利付国債（5年）	130,000,000	131,392,300	
第1回利付国債（40年）	40,000,000	58,347,600	
第2回利付国債（40年）	100,000,000	141,317,000	
第3回利付国債（40年）	110,000,000	156,044,900	
第4回利付国債（40年）	150,000,000	213,790,500	
第5回利付国債（40年）	170,000,000	234,634,000	
第6回利付国債（40年）	170,000,000	231,417,600	
第7回利付国債（40年）	160,000,000	209,766,400	
第8回利付国債（40年）	190,000,000	232,943,800	
第9回利付国債（40年）	300,000,000	275,283,000	
第10回利付国債（40年）	290,000,000	311,767,400	
第11回利付国債（40年）	240,000,000	250,440,000	
第12回利付国債（40年）	250,000,000	235,597,500	
第13回利付国債（40年）	140,000,000	131,566,400	
第319回利付国債（10年）	240,000,000	243,249,600	
第320回利付国債（10年）	202,000,000	204,512,880	
第321回利付国債（10年）	241,000,000	244,680,070	
第322回利付国債（10年）	220,000,000	223,064,600	
第323回利付国債（10年）	340,000,000	345,657,600	
第324回利付国債（10年）	183,000,000	185,754,150	
第325回利付国債（10年）	330,000,000	335,755,200	
第326回利付国債（10年）	280,000,000	284,958,800	
第327回利付国債（10年）	387,000,000	394,666,470	
第328回利付国債（10年）	411,000,000	418,130,850	
第329回利付国債（10年）	297,000,000	304,252,740	
第330回利付国債（10年）	257,000,000	263,890,170	
第331回利付国債（10年）	90,000,000	91,899,000	
第332回利付国債（10年）	532,000,000	544,214,720	
第333回利付国債（10年）	225,000,000	230,580,000	
第334回利付国債（10年）	261,000,000	267,966,090	
第335回利付国債（10年）	345,000,000	353,524,950	
第336回利付国債（10年）	210,000,000	215,527,200	
第337回利付国債（10年）	170,000,000	173,077,000	
第338回利付国債（10年）	631,000,000	645,866,360	
第339回利付国債（10年）	385,000,000	394,417,100	

第340回利付国債(10年)	934,000,000	957,648,880
第341回利付国債(10年)	520,000,000	531,185,200
第342回利付国債(10年)	210,000,000	212,423,400
第343回利付国債(10年)	390,000,000	394,715,100
第344回利付国債(10年)	690,000,000	698,721,600
第345回利付国債(10年)	760,000,000	769,781,200
第346回利付国債(10年)	820,000,000	830,988,000
第347回利付国債(10年)	230,000,000	233,128,000
第348回利付国債(10年)	340,000,000	344,800,800
第349回利付国債(10年)	400,000,000	405,712,000
第350回利付国債(10年)	580,000,000	588,352,000
第351回利付国債(10年)	80,000,000	81,130,400
第352回利付国債(10年)	790,000,000	800,902,000
第353回利付国債(10年)	450,000,000	456,034,500
第354回利付国債(10年)	570,000,000	577,398,600
第355回利付国債(10年)	510,000,000	516,150,600
第356回利付国債(10年)	910,000,000	920,483,200
第357回利付国債(10年)	630,000,000	636,589,800
第358回利付国債(10年)	720,000,000	727,056,000
第359回利付国債(10年)	670,000,000	675,775,400
第360回利付国債(10年)	270,000,000	272,119,500
第1回利付国債(30年)	60,000,000	74,985,600
第7回利付国債(30年)	40,000,000	50,122,400
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,760,000
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,952,400
第13回利付国債(30年)	90,000,000	111,518,100
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,651,400
第15回利付国債(30年)	160,000,000	209,932,800
第16回利付国債(30年)	100,000,000	131,597,000
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,298,000
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,723,400
第19回利付国債(30年)	100,000,000	129,860,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	133,150,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	117,426,600
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,913,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	214,659,200
第24回利付国債(30年)	100,000,000	134,489,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	131,709,000
第26回利付国債(30年)	145,000,000	193,779,450
第27回利付国債(30年)	215,000,000	292,232,300
第28回利付国債(30年)	110,000,000	150,376,600
第29回利付国債(30年)	70,000,000	94,893,400
第30回利付国債(30年)	190,000,000	255,380,900

第3 1 回利付国債(30年)	130,000,000	173,121,000	
第3 2 回利付国債(30年)	215,000,000	291,458,300	
第3 3 回利付国債(30年)	290,000,000	378,073,000	
第3 4 回利付国債(30年)	255,000,000	343,260,600	
第3 5 回利付国債(30年)	316,000,000	414,459,280	
第3 6 回利付国債(30年)	295,000,000	388,169,850	
第3 7 回利付国債(30年)	320,000,000	415,577,600	
第3 8 回利付国債(30年)	230,000,000	294,816,300	
第3 9 回利付国債(30年)	190,000,000	247,760,000	
第4 0 回利付国債(30年)	155,000,000	198,958,000	
第4 1 回利付国債(30年)	155,000,000	195,935,500	
第4 2 回利付国債(30年)	190,000,000	240,410,800	
第4 3 回利付国債(30年)	80,000,000	101,324,800	
第4 4 回利付国債(30年)	180,000,000	228,198,600	
第4 5 回利付国債(30年)	190,000,000	232,599,900	
第4 6 回利付国債(30年)	240,000,000	293,985,600	
第4 7 回利付国債(30年)	230,000,000	287,286,100	
第4 8 回利付国債(30年)	203,000,000	244,178,550	
第4 9 回利付国債(30年)	230,000,000	276,763,600	
第5 0 回利付国債(30年)	250,000,000	265,372,500	
第5 1 回利付国債(30年)	210,000,000	197,778,000	
第5 2 回利付国債(30年)	230,000,000	227,141,100	
第5 3 回利付国債(30年)	220,000,000	222,255,000	
第5 4 回利付国債(30年)	230,000,000	243,227,300	
第5 5 回利付国債(30年)	70,000,000	73,973,200	
第5 6 回利付国債(30年)	220,000,000	232,320,000	
第5 7 回利付国債(30年)	230,000,000	242,698,300	
第5 8 回利付国債(30年)	350,000,000	369,036,500	
第5 9 回利付国債(30年)	220,000,000	226,008,200	
第6 0 回利付国債(30年)	190,000,000	204,573,000	
第6 1 回利付国債(30年)	180,000,000	184,325,400	
第6 2 回利付国債(30年)	180,000,000	174,792,600	
第6 3 回利付国債(30年)	210,000,000	198,057,300	
第6 4 回利付国債(30年)	180,000,000	169,275,600	
第6 5 回利付国債(30年)	190,000,000	178,377,700	
第6 6 回利付国債(30年)	200,000,000	187,448,000	
第6 7 回利付国債(30年)	200,000,000	197,518,000	
第6 8 回利付国債(30年)	130,000,000	128,215,100	
第5 3 回利付国債(20年)	20,000,000	20,489,200	
第5 4 回利付国債(20年)	180,000,000	184,599,000	
第5 5 回利付国債(20年)	100,000,000	102,872,000	
第5 6 回利付国債(20年)	10,000,000	10,341,600	

第57回利付国債(20年)	110,000,000	113,582,700
第58回利付国債(20年)	100,000,000	103,775,000
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,547,200
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,971,700
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,342,000
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,953,600
第63回利付国債(20年)	60,000,000	63,024,600
第64回利付国債(20年)	120,000,000	126,963,600
第65回利付国債(20年)	380,000,000	403,997,000
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,367,800
第68回利付国債(20年)	90,000,000	97,060,500
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,505,400
第70回利付国債(20年)	110,000,000	120,078,200
第71回利付国債(20年)	100,000,000	108,440,000
第72回利付国債(20年)	210,000,000	228,120,900
第73回利付国債(20年)	180,000,000	195,805,800
第75回利付国債(20年)	100,000,000	109,750,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	108,877,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,862,600
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,673,000
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,961,400
第80回利付国債(20年)	90,000,000	99,242,100
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,088,800
第82回利付国債(20年)	170,000,000	188,331,100
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,134,100
第84回利付国債(20年)	120,000,000	132,994,800
第85回利付国債(20年)	150,000,000	167,841,000
第86回利付国債(20年)	100,000,000	112,968,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	101,187,900
第88回利付国債(20年)	185,000,000	210,130,400
第89回利付国債(20年)	120,000,000	135,626,400
第90回利付国債(20年)	170,000,000	193,142,100
第91回利付国債(20年)	80,000,000	91,360,800
第92回利付国債(20年)	255,000,000	289,552,500
第93回利付国債(20年)	80,000,000	90,771,200
第94回利付国債(20年)	140,000,000	159,744,200
第95回利付国債(20年)	185,000,000	214,520,450
第96回利付国債(20年)	70,000,000	80,241,000
第97回利付国債(20年)	130,000,000	150,646,600
第98回利付国債(20年)	70,000,000	80,635,100
第99回利付国債(20年)	85,000,000	98,317,800
第100回利付国債(20年)	151,000,000	176,538,630
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,678,000

第102回利付国債(20年)	145,000,000	172,455,750	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	118,172,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,664,500	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	14,053,080	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	47,158,800	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	94,086,400	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	255,158,200	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	93,098,400	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	230,193,600	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,652,500	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	242,808,150	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	101,048,850	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	190,803,200	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	120,162,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	168,835,800	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	269,241,750	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	155,972,530	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	175,720,500	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	230,462,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	242,851,200	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	223,215,800	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	320,183,600	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	239,636,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	146,757,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	120,238,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	154,970,400	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	268,985,250	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	213,291,000	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	213,849,000	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	35,318,100	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	200,605,100	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	291,804,800	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,725,950	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,306,800	
第136回利付国債(20年)	160,000,000	187,428,800	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	201,506,100	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,614,200	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	211,294,800	
第140回利付国債(20年)	380,000,000	451,413,400	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	220,227,700	
第142回利付国債(20年)	210,000,000	252,495,600	
第143回利付国債(20年)	245,000,000	289,256,800	

	第144回利付国債(20年)	190,000,000	222,009,300
	第145回利付国債(20年)	385,000,000	460,152,000
	第146回利付国債(20年)	350,000,000	419,135,500
	第147回利付国債(20年)	395,000,000	468,829,450
	第148回利付国債(20年)	405,000,000	476,174,700
	第149回利付国債(20年)	380,000,000	447,423,400
	第150回利付国債(20年)	270,000,000	314,695,800
	第151回利付国債(20年)	445,000,000	507,024,100
	第152回利付国債(20年)	450,000,000	513,072,000
	第153回利付国債(20年)	270,000,000	311,879,700
	第154回利付国債(20年)	118,000,000	134,715,880
	第155回利付国債(20年)	380,000,000	422,670,200
	第156回利付国債(20年)	430,000,000	439,524,500
	第157回利付国債(20年)	280,000,000	277,272,800
	第158回利付国債(20年)	110,000,000	113,843,400
	第159回利付国債(20年)	330,000,000	346,523,100
	第160回利付国債(20年)	320,000,000	340,995,200
	第161回利付国債(20年)	330,000,000	346,189,800
	第162回利付国債(20年)	220,000,000	230,579,800
	第163回利付国債(20年)	330,000,000	345,529,800
	第164回利付国債(20年)	420,000,000	432,415,200
	第165回利付国債(20年)	330,000,000	339,325,800
	第166回利付国債(20年)	440,000,000	467,033,600
	第167回利付国債(20年)	320,000,000	328,163,200
	第168回利付国債(20年)	310,000,000	312,132,800
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	276,589,600
	第170回利付国債(20年)	330,000,000	325,644,000
	第171回利付国債(20年)	270,000,000	265,917,600
	第172回利付国債(20年)	250,000,000	250,447,500
	第173回利付国債(20年)	320,000,000	320,000,000
	第174回利付国債(20年)	70,000,000	69,935,600
	国債証券合計	64,647,000,000	69,715,347,180
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	116,423,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,387,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,103,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,220,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,174,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,957,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,966,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,732,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,186,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,911,000

	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,501,400
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,522,000
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,345,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,920,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,823,000
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,059,000
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,643,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,397,000
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,115,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,211,000
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,683,000
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,048,000
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	118,373,000
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,770,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,061,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,592,000
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	112,097,000
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,324,000
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,467,000
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,209,000
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,298,000
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,293,000
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,993,000
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,314,000
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,568,000
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,697,000
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,056,000
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,983,000
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,134,000
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,317,600
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,999,000
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,963,000
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,256,000
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,463,091,000
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,944,000
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,400,000
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,683,000
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,564,000
	第27回道路債券	100,000,000	107,938,000
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	175,888,500

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	116,631,120	
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	129,653,030	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,910,000	
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	102,235,000	
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	105,698,600	
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	135,179,870	
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	100,650,000	
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	100,984,000	
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	101,273,000	
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	100,743,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	126,405,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	109,791,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,617,470	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,881,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,427,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,142,600	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,378,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,562,790	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,000,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,168,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,365,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,026,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	113,717,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	88,226,000	87,950,734	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	93,929,000	93,939,332	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,024,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,784,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,046,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,070,000	87,207,845	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,107,000	87,006,818	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,449,000	88,225,547	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,917,000	87,813,983	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,083,000	90,789,250	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,013,000	92,305,384	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,676,000	95,030,187	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,634,000	97,693,556	



	第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,870,000	100,254,499
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	61,681,000	61,645,225
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	64,164,000	64,171,058
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	68,380,000	68,434,020
	第327回信金中金債	100,000,000	100,057,000
	第340回信金中金債	100,000,000	100,176,000
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,392,000
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,010,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,068,000
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,899,000
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,028,000
	特殊債券合計	5,409,199,000	5,649,807,418
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	98,727,000
	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	100,238,000
	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	98,596,000
	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	99,722,000
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,887,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,435,000
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,905,000
	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	99,863,000
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,330,000
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,266,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,288,000
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,576,000
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,907,000
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,630,000
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,992,000
	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	98,799,000
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,006,000
	第14回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,830,000
	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	98,414,000
	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	100,331,000
	第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,174,000
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,917,000
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,625,000

第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,246,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,603,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,917,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,093,000	
第22回K D D I 株式会社無担保社債	100,000,000	99,793,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,023,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,133,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,810,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,484,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,068,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,730,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,174,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,681,000	
社債券合計	3,600,000,000	3,611,213,000	
合計		83,439,458,598	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R A M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

### 貸借対照表

(単位:円)

2020年11月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	244,270,457
コール・ローン	856,098,011
国債証券	199,105,557,503
派生商品評価勘定	19,848,544
未収入金	90,755,839
未収利息	1,085,598,527
前払費用	138,804,824
流動資産合計	201,540,933,705
資産合計	201,540,933,705
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,126,353,342

2020年11月16日現在

未払金	716,757,951
未払解約金	13,678,000
未払利息	2,322
流動負債合計	2,856,791,615
負債合計	2,856,791,615
純資産の部	
元本等	
元本	185,743,028,889
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	12,941,113,201
元本等合計	198,684,142,090
純資産合計	198,684,142,090
負債純資産合計	201,540,933,705

## 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 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。</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 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 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 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11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	148,135,279,822円
期中追加設定元本額	196,192,128,442円
期中一部解約元本額	158,584,379,375円
期末元本額	185,743,028,889円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	16,796,545,257円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	7,665,957,569円
りそなラップ型ファンド(成長型)	943,446,164円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,305,965,967円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	270,119,973円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	62,275,490円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	21,616,043円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	6,486,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	768,532円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	284,130円
リスクコントロール・オープン	210,624,388円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,143,267,661円
FWりそな円建債券アクティブファンド	857,994,040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)	98,987,039,747円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	721,525,912円
Smart-i 8資産バランス 安定型	509,111,990円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	284,691,976円
Smart-i 8資産バランス 成長型	102,166,128円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	12,079,428,291円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	9,687,682,318円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	5,570,540,001円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	3,616,044,675円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	10,589,675,696円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,751,888,825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)	7,280,297,840円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	10,416,793円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	5,179,695,055円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	87,471,499円
2. 計算日における受益権の総数	185,743,028,889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	1.0697円
(10,000口当たり純資産額)	(10,697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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		2,797,320,561

合計	2,797,320,561
----	---------------

(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11月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	530,539,163	-	530,535,372	3,791
	米ドル	224,568,631	-	224,067,540	501,091
	ユーロ	248,082,297	-	248,276,608	194,311
	英ポンド	57,888,235	-	58,191,224	302,989
	売建	198,479,687,993	-	200,586,189,000	2,106,501,007
	米ドル	86,675,777,731	-	86,848,856,540	173,078,809
	カナダドル	3,952,663,934	-	4,012,854,220	60,190,286
	メキシコペソ	1,552,669,552	-	1,628,733,960	76,064,408
	ユーロ	82,086,723,735	-	83,276,427,250	1,189,703,515
	英ポンド	13,077,805,333	-	13,369,461,000	291,655,667
	スウェーデンクローナ	641,161,653	-	659,034,070	17,872,417
	ノルウェークローネ	398,220,213	-	416,241,850	18,021,637
	デンマーククローネ	1,115,273,278	-	1,130,241,320	14,968,042
	ポーランドズロチ	1,212,148,149	-	1,263,539,230	51,391,081
	オーストラリアドル	5,191,540,826	-	5,368,756,170	177,215,344
	シンガポールドル	867,864,075	-	881,182,900	13,318,825
	マレーシアリンギット	898,585,065	-	907,288,000	8,702,935
	イスラエルシケル	809,254,449	-	823,572,490	14,318,041
	合計	199,010,227,156	-	201,116,724,372	2,106,504,798

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,285,351.87	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,356,348.06	
		US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,198,824.13	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,054,812.60	
		US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,386,283.32	
		US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,270,478.96	
		US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,245,835.20	
		US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,464,500.00	
		US TREASURY N/B	3,730,000.00	3,807,951.03	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,541,992.00	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,109,687.20	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,388,416.86	
		US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,664,442.77	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,044,531.10	
		US TREASURY N/B	5,360,000.00	5,484,787.23	

US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,224,962.50	
US TREASURY N/B	4,670,000.00	4,773,615.62	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,657,859.26	
US TREASURY N/B	4,520,000.00	4,653,392.88	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,350,492.13	
US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,811,760.84	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,262,948.90	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,088,476.30	
US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,240,814.78	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,511,154.20	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,527,839.42	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,815,527.27	
US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,068,721.01	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,868,250.00	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,498,437.50	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,177,257.58	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,413,347.62	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,948,687.50	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,997,031.20	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,257,792.90	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,495,435.75	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,035,503.68	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,995,312.20	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,819,985.30	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,558,154.25	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,410,931.25	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,753,685.02	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	6,054,555.09	
US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,502,427.13	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,575,063.24	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,795,326.43	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,795,128.58	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,536,623.36	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	5,268,538.68	
US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,945,284.71	



US TREASURY N/B	5,080,000.00	5,226,843.49	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,334,790.41	
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,656,500.00	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,622,802.79	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,396,259.37	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,441,493.63	
US TREASURY N/B	3,830,000.00	4,014,617.86	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,818,455.35	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,566,601.50	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,368,820.14	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,583,320.20	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,525,156.25	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,206,206.25	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,478,423.74	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,504,784.85	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,707,685.48	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,399,073.33	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,580,542.63	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,893,068.14	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,134,353.02	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,916,015.58	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,454,312.50	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,256,775.00	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,360,484.26	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,090,710.63	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,158,816.38	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,553,752.28	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,719,570.05	
US TREASURY N/B	6,140,000.00	6,125,129.53	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,394,765.48	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,280,098.33	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,487,695.20	
US TREASURY N/B	3,960,000.00	4,091,484.27	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,957,492.14	
US TREASURY N/B	800,000.00	862,437.44	

US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,892,712.50	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,559,244.38	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,434,337.67	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,040,374.97	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,900,496.06	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,628,985.76	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,144,257.80	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,546,115.58	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,910,320.20	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,593,821.72	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,684,897.16	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,458,610.72	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,277,405.45	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,293,056.10	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,331,036.96	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,527,913.19	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,674,887.71	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,580,535.80	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,215,624.80	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,586,149.85	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,797,162.36	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,569,125.00	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,696,990.43	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,887,326.52	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,604,903.00	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,349,874.88	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,880,803.83	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,394,453.06	
US TREASURY N/B	6,150,000.00	6,442,125.00	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,963,866.90	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,022,656.06	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,857,949.18	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,708,457.53	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,548,163.85	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,536,333.97	

US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,780,133.76
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,823,269.43
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,654,359.37
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,260,445.11
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,749,466.91
US TREASURY N/B	3,920,000.00	3,900,400.00
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,351,295.18
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,624,206.91
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,512,001.92
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,691,975.00
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,703,089.38
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,102,366.44
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,967,578.00
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,735,648.31
US TREASURY N/B	5,670,000.00	5,630,575.35
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,480,156.14
US TREASURY N/B	5,570,000.00	6,078,262.50
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,931,472.62
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,890,320.27
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,139,452.98
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,245,469.34
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,883,281.25
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,925,422.88
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,758,300.75
US TREASURY N/B	4,710,000.00	5,006,950.42
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,944,687.50
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,908,511.55
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,802,007.78
US TREASURY N/B	5,130,000.00	5,420,265.66
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,022,312.32
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,777,283.07
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,682,717.15
US TREASURY N/B	3,910,000.00	4,250,444.87
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,715,351.43
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,218,554.50

US TREASURY N/B	4,470,000.00	4,728,421.87
US TREASURY N/B	2,730,000.00	3,015,156.96
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,034,531.20
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,808,202.88
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,156,324.06
US TREASURY N/B	4,620,000.00	5,148,412.50
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,564,781.04
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,475,390.45
US TREASURY N/B	5,550,000.00	6,151,611.12
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,758,749.76
US TREASURY N/B	4,370,000.00	4,293,183.26
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,818,446.74
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,714,245.65
US TREASURY N/B	6,090,000.00	7,064,400.00
US TREASURY N/B	220,000.00	299,990.61
US TREASURY N/B	6,840,000.00	7,956,041.76
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,685,887.17
US TREASURY N/B	530,000.00	722,373.41
US TREASURY N/B	5,640,000.00	6,484,897.94
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,671,476.31
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,178,331.69
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,006,261.58
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,678,737.73
US TREASURY N/B	780,000.00	1,169,360.08
US TREASURY N/B	7,320,000.00	7,169,025.00
US TREASURY N/B	8,450,000.00	8,255,913.64
US TREASURY N/B	610,000.00	881,664.41
US TREASURY N/B	540,000.00	796,278.49
US TREASURY N/B	130,000.00	204,988.66
US TREASURY N/B	690,000.00	1,032,735.90
US TREASURY N/B	520,000.00	790,420.28
US TREASURY N/B	960,000.00	1,311,037.44
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,925,526.49
US TREASURY N/B	1,340,000.00	2,061,767.95
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,431,874.88

US TREASURY N/B	780,000.00	1,222,314.83
US TREASURY N/B	950,000.00	1,450,197.23
US TREASURY N/B	4,970,000.00	4,736,254.43
US TREASURY N/B	1,410,000.00	2,029,133.11
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,652,034.71
US TREASURY N/B	770,000.00	1,162,669.89
US TREASURY N/B	900,000.00	1,443,726.54
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,739,670.25
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,540,265.54
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,364,796.78
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,763,042.15
US TREASURY N/B	1,550,000.00	2,000,468.75
US TREASURY N/B	1,640,000.00	2,039,237.50
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,311,267.80
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,949,624.83
US TREASURY N/B	3,200,000.00	4,059,249.92
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,444,714.78
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,264,728.87
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,463,215.46
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,719,157.38
US TREASURY N/B	2,850,000.00	3,770,015.62
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,635,843.68
US TREASURY N/B	3,380,000.00	4,040,288.07
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,642,734.20
US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,303,666.21
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,679,769.49
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,658,623.38
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,887,951.92
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,719,599.32
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,640,670.22
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,807,412.50
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,705,037.50
US TREASURY N/B	2,370,000.00	2,980,089.66
US TREASURY N/B	2,690,000.00	3,385,511.87
US TREASURY N/B	4,050,000.00	5,328,122.89

	US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,416,994.43
	US TREASURY N/B	5,050,000.00	6,658,700.73
	US TREASURY N/B	3,600,000.00	5,069,250.00
	US TREASURY N/B	4,480,000.00	5,916,574.72
	US TREASURY N/B	3,870,000.00	5,000,614.30
	US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,739,972.53
	US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,880,626.59
	US TREASURY N/B	3,860,000.00	4,196,543.75
	US TREASURY N/B	6,400,000.00	5,803,499.52
	US TREASURY N/B	9,360,000.00	8,758,912.02
	米ドル 小計	760,950,000.00	824,702,160.69 (86,338,069,202)
カナダドル	GOV OF CANADA	830,000.00	838,739.90
	GOV OF CANADA	610,000.00	619,784.40
	GOV OF CANADA	1,450,000.00	1,455,829.00
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,120,812.00
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,122,390.00
	GOV OF CANADA	1,750,000.00	1,750,787.50
	GOV OF CANADA	2,280,000.00	2,311,441.20
	GOV OF CANADA	3,100,000.00	3,100,465.00
	GOV OF CANADA	800,000.00	799,928.00
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,871,793.40
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,206,621.00
	GOV OF CANADA	1,960,000.00	2,054,021.20
	GOV OF CANADA	840,000.00	893,499.60
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,270,494.20
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,231,436.20
	GOV OF CANADA	1,090,000.00	1,130,112.00
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,191,190.00
	GOV OF CANADA	3,500,000.00	3,511,340.00
	GOV OF CANADA	950,000.00	939,018.00
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,213,526.00
	GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,369,407.90
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,104,210.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	497,759.50

	GOV OF CANADA	1,410,000.00	1,596,923.70
	GOV OF CANADA	3,600,000.00	3,768,948.00
	GOV OF CANADA	790,000.00	768,180.20
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,501,161.50
	GOV OF CANADA	860,000.00	1,391,316.60
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,456,654.00
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,751,747.40
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,559,975.00
	GOV OF CANADA	2,350,000.00	2,790,202.00
	GOV OF CANADA	420,000.00	628,735.80
	カナダドル 小計	45,260,000.00	49,818,450.20 (3,975,512,325)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	19,950,000.00	20,552,591.74
	UNITED MEXICAN STATE	26,930,000.00	27,773,582.25
	UNITED MEXICAN STATE	16,750,000.00	17,589,175.00
	UNITED MEXICAN STATE	22,780,000.00	24,961,640.60
	UNITED MEXICAN STATE	21,980,000.00	24,410,548.40
	UNITED MEXICAN STATE	22,670,000.00	26,896,141.40
	UNITED MEXICAN STATE	18,620,000.00	19,043,977.40
	UNITED MEXICAN STATE	27,110,000.00	30,060,381.30
	UNITED MEXICAN STATE	26,110,000.00	30,929,906.00
	UNITED MEXICAN STATE	13,346,000.00	15,128,625.22
	UNITED MEXICAN STATE	7,560,000.00	8,510,594.40
	UNITED MEXICAN STATE	6,300,000.00	8,407,665.00
	UNITED MEXICAN STATE	17,820,000.00	20,956,592.64
	UNITED MEXICAN STATE	17,000,000.00	18,562,980.00
	UNITED MEXICAN STATE	16,400,000.00	18,295,512.00
	メキシコペソ 小計	281,326,000.00	312,079,913.35 (1,607,211,553)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	743,670.90
	GOV OF AUSTRIA	800,000.00	810,804.80
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	943,014.75
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	600,255.97
	GOV OF AUSTRIA	1,060,000.00	1,080,458.00
	GOV OF AUSTRIA	1,050,000.00	1,126,784.40
	GOV OF AUSTRIA	930,000.00	953,901.93

GOV OF AUSTRIA	900,000.00	984,424.50	
GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,028,120.30	
GOV OF AUSTRIA	840,000.00	1,091,956.72	
GOV OF AUSTRIA	1,240,000.00	1,342,188.40	
GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,104,189.87	
GOV OF AUSTRIA	820,000.00	1,202,289.08	
GOV OF AUSTRIA	910,000.00	997,189.99	
GOV OF AUSTRIA	1,040,000.00	1,126,613.28	
GOV OF AUSTRIA	790,000.00	820,296.50	
GOV OF AUSTRIA	840,000.00	1,143,902.76	
GOV OF AUSTRIA	1,260,000.00	2,156,467.32	
GOV OF AUSTRIA	190,000.00	190,393.18	
GOV OF AUSTRIA	670,000.00	1,174,509.65	
GOV OF AUSTRIA	690,000.00	948,844.35	
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	415,264.50	
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	848,383.90	
GOV OF AUSTRIA	540,000.00	1,188,631.26	
GOV OF AUSTRIA	260,000.00	433,434.30	
GOV OF BELGIUM	1,250,000.00	1,330,473.87	
GOV OF BELGIUM	1,560,000.00	1,705,814.76	
GOV OF BELGIUM	1,220,000.00	1,314,867.20	
GOV OF BELGIUM	810,000.00	831,505.74	
GOV OF BELGIUM	1,330,000.00	1,489,372.57	
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,287,674.70	
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,644,265.70	
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,189,021.74	
GOV OF BELGIUM	1,660,000.00	1,810,593.54	
GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,373,100.12	
GOV OF BELGIUM	770,000.00	797,418.16	
GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	2,205,356.59	
GOV OF BELGIUM	1,680,000.00	1,847,244.00	
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,717,976.26	
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,284,301.28	
GOV OF BELGIUM	1,630,000.00	1,855,797.38	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,045,023.48	



GOV OF BELGIUM	770,000.00	913,167.55
GOV OF BELGIUM	700,000.00	1,003,058.70
GOV OF BELGIUM	1,750,000.00	3,053,650.25
GOV OF BELGIUM	490,000.00	607,624.50
GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,034,854.86
GOV OF BELGIUM	480,000.00	504,261.21
GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	2,767,137.20
GOV OF BELGIUM	990,000.00	1,814,783.85
GOV OF BELGIUM	970,000.00	1,288,974.21
GOV OF BELGIUM	670,000.00	923,599.02
GOV OF BELGIUM	550,000.00	893,008.60
GOV OF BELGIUM	650,000.00	1,100,473.40
GOV OF FINLAND	430,000.00	434,421.07
GOV OF FINLAND	530,000.00	553,098.46
GOV OF FINLAND	340,000.00	358,522.52
GOV OF FINLAND	670,000.00	683,836.84
GOV OF FINLAND	510,000.00	557,933.37
GOV OF FINLAND	280,000.00	287,471.24
GOV OF FINLAND	520,000.00	634,650.64
GOV OF FINLAND	620,000.00	666,858.36
GOV OF FINLAND	610,000.00	648,200.64
GOV OF FINLAND	550,000.00	590,531.15
GOV OF FINLAND	470,000.00	590,055.86
GOV OF FINLAND	510,000.00	550,975.89
GOV OF FINLAND	480,000.00	520,934.40
GOV OF FINLAND	360,000.00	373,666.32
GOV OF FINLAND	350,000.00	391,357.75
GOV OF FINLAND	390,000.00	461,589.18
GOV OF FINLAND	420,000.00	437,323.74
GOV OF FINLAND	320,000.00	338,754.56
GOV OF FINLAND	380,000.00	603,162.22
GOV OF FINLAND	350,000.00	476,211.40
GOV OF FRANCE	2,430,000.00	2,451,422.88
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	4,402,877.60
GOV OF FRANCE	2,860,000.00	2,890,570.54

GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,723,790.40	
GOV OF FRANCE	2,070,000.00	2,102,559.03	
GOV OF FRANCE	3,740,000.00	3,802,558.98	
GOV OF FRANCE	5,160,000.00	5,482,685.76	
GOV OF FRANCE	3,830,000.00	4,394,435.90	
GOV OF FRANCE	4,110,000.00	4,206,068.35	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,347,528.85	
GOV OF FRANCE	3,220,000.00	3,537,934.74	
GOV OF FRANCE	4,550,000.00	4,679,802.40	
GOV OF FRANCE	4,720,000.00	4,968,177.60	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	3,028,012.02	
GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,324,196.00	
GOV OF FRANCE	2,500,000.00	2,578,752.25	
GOV OF FRANCE	3,770,000.00	4,628,775.84	
GOV OF FRANCE	3,430,000.00	3,640,138.95	
GOV OF FRANCE	3,960,000.00	4,158,107.30	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,340,556.82	
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	5,152,563.10	
GOV OF FRANCE	4,130,000.00	4,520,202.40	
GOV OF FRANCE	3,630,000.00	3,988,237.44	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,202,852.08	
GOV OF FRANCE	3,660,000.00	3,952,909.80	
GOV OF FRANCE	4,150,000.00	4,295,295.65	
GOV OF FRANCE	4,440,000.00	5,674,542.00	
GOV OF FRANCE	3,240,000.00	3,341,259.72	
GOV OF FRANCE	4,720,000.00	5,626,844.16	
GOV OF FRANCE	2,700,000.00	4,672,121.04	
GOV OF FRANCE	3,210,000.00	3,820,227.42	
GOV OF FRANCE	2,540,000.00	4,358,035.48	
GOV OF FRANCE	3,200,000.00	3,850,371.20	
GOV OF FRANCE	2,360,000.00	4,061,446.48	
GOV OF FRANCE	2,500,000.00	3,298,232.50	
GOV OF FRANCE	930,000.00	1,001,118.03	
GOV OF FRANCE	3,330,000.00	6,310,649.70	
GOV OF FRANCE	2,320,000.00	4,004,398.88	

GOV OF FRANCE	2,380,000.00	3,467,060.24	
GOV OF FRANCE	2,680,000.00	3,565,504.16	
GOV OF FRANCE	2,190,000.00	2,434,940.55	
GOV OF FRANCE	1,490,000.00	3,227,880.87	
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	3,332,575.60	
GOV OF FRANCE	1,180,000.00	1,807,535.80	
GOV OF GERMANY	1,650,000.00	1,662,679.42	
GOV OF GERMANY	1,830,000.00	1,887,224.64	
GOV OF GERMANY	1,440,000.00	1,453,531.68	
GOV OF GERMANY	1,540,000.00	1,555,544.76	
GOV OF GERMANY	1,220,000.00	1,233,898.24	
GOV OF GERMANY	2,290,000.00	2,383,713.67	
GOV OF GERMANY	1,670,000.00	1,738,102.09	
GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,621,620.80	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	1,876,286.65	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	2,019,155.70	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	1,894,731.78	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	1,966,588.23	
GOV OF GERMANY	1,840,000.00	1,982,029.60	
GOV OF GERMANY	2,470,000.00	2,526,687.23	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,188,420.52	
GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,576,084.78	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,183,030.16	
GOV OF GERMANY	2,210,000.00	2,359,148.48	
GOV OF GERMANY	3,370,000.00	3,471,332.53	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,795,091.47	
GOV OF GERMANY	1,760,000.00	1,818,905.44	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,690,700.80	
GOV OF GERMANY	1,950,000.00	2,021,904.30	
GOV OF GERMANY	2,600,000.00	2,773,837.29	
GOV OF GERMANY	2,990,000.00	3,119,138.10	
GOV OF GERMANY	3,360,000.00	3,568,920.42	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,507,111.90	
GOV OF GERMANY	2,780,000.00	3,011,597.35	
GOV OF GERMANY	2,030,000.00	2,128,273.31	

GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,903,505.50	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,959,770.72	
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,626,845.77	
GOV OF GERMANY	2,380,000.00	2,552,740.40	
GOV OF GERMANY	2,350,000.00	2,527,166.50	
GOV OF GERMANY	2,640,000.00	2,785,561.68	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,220,172.68	
GOV OF GERMANY	2,710,000.00	2,859,274.93	
GOV OF GERMANY	2,970,000.00	3,132,943.11	
GOV OF GERMANY	700,000.00	740,110.00	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	3,024,921.67	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,887,638.72	
GOV OF GERMANY	1,700,000.00	1,789,537.30	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	4,380,781.02	
GOV OF GERMANY	1,640,000.00	3,090,842.40	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	3,899,950.08	
GOV OF GERMANY	1,740,000.00	3,116,522.70	
GOV OF GERMANY	3,010,000.00	5,019,719.81	
GOV OF GERMANY	2,730,000.00	4,673,150.11	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,131,742.87	
GOV OF GERMANY	1,420,000.00	1,474,540.78	
GOV OF IRELAND	560,000.00	570,729.60	
GOV OF IRELAND	510,000.00	516,247.50	
GOV OF IRELAND	630,000.00	697,308.17	
GOV OF IRELAND	790,000.00	896,941.51	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,325,370.90	
GOV OF IRELAND	1,040,000.00	1,128,422.88	
GOV OF IRELAND	710,000.00	740,140.92	
GOV OF IRELAND	770,000.00	845,640.18	
GOV OF IRELAND	810,000.00	909,354.60	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,043,909.26	
GOV OF IRELAND	740,000.00	771,786.70	
GOV OF IRELAND	640,000.00	744,722.56	
GOV OF IRELAND	420,000.00	494,300.94	
GOV OF IRELAND	390,000.00	412,917.71	

GOV OF IRELAND	490,000.00	621,849.20	
GOV OF IRELAND	840,000.00	1,185,473.52	
GOV OF IRELAND	490,000.00	643,232.31	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	2,510,241.21	
GOV OF ITALY	2,150,000.00	2,211,987.72	
GOV OF ITALY	690,000.00	738,893.40	
GOV OF ITALY	1,140,000.00	1,165,775.40	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,671,062.14	
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,412,753.33	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,942,996.04	
GOV OF ITALY	1,010,000.00	1,117,026.16	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,654,800.00	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,628,811.04	
GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,664,843.40	
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,410,757.50	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,741,027.86	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,172,055.04	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,577,323.44	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,276,426.00	
GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,666,633.60	
GOV OF ITALY	1,700,000.00	1,834,233.70	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,653,890.21	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,751,797.89	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,287,648.44	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,499,899.80	
GOV OF ITALY	2,630,000.00	2,812,495.70	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,962,909.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,637,258.70	
GOV OF ITALY	1,720,000.00	1,901,437.64	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,802,406.93	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,436,280.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,642,796.54	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,850,823.20	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,878,318.09	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,617,336.00	

GOV OF ITALY	1,680,000.00	1,846,756.80	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	1,910,186.66	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,390,953.00	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,882,518.18	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,687,473.60	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,479,860.94	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,776,122.28	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,925,357.40	
GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,492,408.56	
GOV OF ITALY	1,300,000.00	1,355,555.50	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	2,675,112.16	
GOV OF ITALY	3,250,000.00	3,632,902.00	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,491,107.41	
GOV OF ITALY	1,850,000.00	2,196,462.45	
GOV OF ITALY	2,010,000.00	2,439,635.49	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	2,673,017.55	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,156,450.99	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,499,099.75	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,161,342.15	
GOV OF ITALY	3,660,000.00	4,021,747.08	
GOV OF ITALY	2,460,000.00	3,780,355.80	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,397,378.70	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	2,736,132.60	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,166,892.00	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	3,320,140.00	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,069,068.46	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,284,702.98	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,659,166.74	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,685,860.24	
GOV OF ITALY	1,230,000.00	1,583,273.22	
GOV OF ITALY	2,160,000.00	3,537,216.00	
GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,460,595.72	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	3,173,022.72	
GOV OF ITALY	850,000.00	922,993.75	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,702,294.84	

GOV OF ITALY	1,620,000.00	2,252,496.60	
GOV OF ITALY	1,860,000.00	2,365,998.12	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	2,224,992.00	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,814,516.73	
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,490,606.98	
GOV OF ITALY	820,000.00	850,537.62	
GOV OF ITALY	860,000.00	1,128,054.26	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	1,502,361.04	
GOV OF NETHERLANDS	1,310,000.00	1,375,337.82	
GOV OF NETHERLANDS	990,000.00	1,086,857.73	
GOV OF NETHERLANDS	2,040,000.00	2,176,380.51	
GOV OF NETHERLANDS	1,410,000.00	1,442,492.04	
GOV OF NETHERLANDS	1,280,000.00	1,409,057.28	
GOV OF NETHERLANDS	1,420,000.00	1,483,817.64	
GOV OF NETHERLANDS	1,510,000.00	1,610,871.02	
GOV OF NETHERLANDS	1,270,000.00	1,319,049.94	
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,486,418.12	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,619,856.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,501,100.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,196,334.94	
GOV OF NETHERLANDS	1,250,000.00	1,306,265.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,330,000.00	1,806,967.26	
GOV OF NETHERLANDS	1,430,000.00	2,442,352.77	
GOV OF NETHERLANDS	810,000.00	918,847.80	
GOV OF NETHERLANDS	1,420,000.00	2,634,618.30	
GOV OF NETHERLANDS	1,600,000.00	2,828,468.80	
GOV OF NETHERLANDS	530,000.00	537,359.58	
GOV OF SPAIN	2,000,000.00	2,011,734.00	
GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,239,283.70	
GOV OF SPAIN	2,570,000.00	2,606,494.00	
GOV OF SPAIN	1,750,000.00	1,785,777.00	
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,287,985.11	
GOV OF SPAIN	1,860,000.00	1,884,921.75	
GOV OF SPAIN	1,980,000.00	2,027,260.62	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,041,964.38	

GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,804,920.04	
GOV OF SPAIN	1,890,000.00	2,174,127.28	
GOV OF SPAIN	2,190,000.00	2,251,328.76	
GOV OF SPAIN	2,050,000.00	2,314,130.20	
GOV OF SPAIN	2,190,000.00	2,229,409.05	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,127,754.20	
GOV OF SPAIN	2,050,000.00	2,542,684.07	
GOV OF SPAIN	2,230,000.00	2,512,260.02	
GOV OF SPAIN	2,380,000.00	2,680,147.75	
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,701,040.32	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,421,510.26	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,170,439.49	
GOV OF SPAIN	1,510,000.00	1,609,533.00	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,136,535.68	
GOV OF SPAIN	1,970,000.00	2,194,702.14	
GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,724,547.92	
GOV OF SPAIN	1,610,000.00	2,282,193.51	
GOV OF SPAIN	2,170,000.00	3,252,202.87	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,813,357.50	
GOV OF SPAIN	1,810,000.00	1,906,409.65	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,605,670.00	
GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,399,330.08	
GOV OF SPAIN	2,700,000.00	3,004,122.60	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	3,154,504.32	
GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,424,477.58	
GOV OF SPAIN	1,610,000.00	1,938,316.03	
GOV OF SPAIN	1,860,000.00	2,949,563.82	
GOV OF SPAIN	1,670,000.00	3,004,253.51	
GOV OF SPAIN	1,050,000.00	1,154,250.72	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	3,420,516.48	
GOV OF SPAIN	1,260,000.00	2,471,680.89	
GOV OF SPAIN	1,630,000.00	2,422,441.12	
GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,890,587.40	
GOV OF SPAIN	1,220,000.00	1,246,528.90	
GOV OF SPAIN	1,390,000.00	2,503,248.22	



	ユーロ 小計	553,280,000.00	666,709,052.40 (82,631,919,954)
英債券	UK TREASURY	1,470,000.00	1,547,632.17
	UK TREASURY	2,070,000.00	2,088,816.30
	UK TREASURY	2,260,000.00	2,333,242.08
	UK TREASURY	2,750,000.00	2,757,975.00
	UK TREASURY	2,260,000.00	2,308,816.00
	UK TREASURY	1,260,000.00	1,341,404.06
	UK TREASURY	2,060,000.00	2,133,173.87
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,625,432.65
	UK TREASURY	880,000.00	1,070,125.40
	UK TREASURY	2,910,000.00	2,991,110.10
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,369,509.12
	UK TREASURY	1,410,000.00	1,413,595.50
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,591,578.40
	UK TREASURY	1,710,000.00	1,838,250.00
	UK TREASURY	1,310,000.00	1,690,242.95
	UK TREASURY	1,310,000.00	1,304,105.00
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,692,230.59
	UK TREASURY	950,000.00	1,387,456.19
	UK TREASURY	1,810,000.00	1,903,958.54
	UK TREASURY	2,610,000.00	2,612,871.00
	UK TREASURY	1,430,000.00	2,053,499.15
	UK TREASURY	1,750,000.00	2,496,550.00
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,900,626.50
	UK TREASURY	1,020,000.00	1,010,750.84
	UK TREASURY	1,630,000.00	2,480,900.26
	UK TREASURY	2,270,000.00	2,627,336.81
	UK TREASURY	1,320,000.00	2,215,683.61
	UK TREASURY	1,280,000.00	2,056,635.13
	UK TREASURY	1,380,000.00	2,254,638.60
	UK TREASURY	1,570,000.00	1,683,558.10
UK TREASURY	1,700,000.00	2,942,545.30	
UK TREASURY	2,080,000.00	3,104,474.66	
UK TREASURY	2,000,000.00	3,126,630.39	

	UK TREASURY	1,470,000.00	2,607,216.69
	UK TREASURY	2,080,000.00	2,364,228.67
	UK TREASURY	830,000.00	1,002,031.44
	UK TREASURY	1,260,000.00	2,333,754.36
	UK TREASURY	1,580,000.00	1,456,681.00
	UK TREASURY	1,190,000.00	2,123,763.01
	UK TREASURY	1,110,000.00	1,340,788.98
	UK TREASURY	1,570,000.00	3,151,685.51
	UK TREASURY	2,080,000.00	2,642,223.58
	UK TREASURY	1,140,000.00	2,325,241.12
	UK TREASURY	960,000.00	841,958.40
	UK TREASURY	1,340,000.00	2,156,269.04
	UK TREASURY	1,400,000.00	2,858,462.60
	UK TREASURY	560,000.00	761,076.06
	英ポンド 小計	73,990,000.00	94,920,734.73 (13,130,385,235)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,045,000.00	10,653,325.20
	GOV OF SWEDEN	8,400,000.00	8,874,364.80
	GOV OF SWEDEN	6,380,000.00	7,205,587.30
	GOV OF SWEDEN	6,020,000.00	6,477,038.40
	GOV OF SWEDEN	5,160,000.00	5,517,598.32
	GOV OF SWEDEN	5,130,000.00	5,525,625.60
	GOV OF SWEDEN	3,200,000.00	3,235,310.71
	GOV OF SWEDEN	4,100,000.00	6,396,741.25
	スウェーデンクローナ 小計	48,435,000.00	53,885,591.58 (650,399,090)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	7,080,000.00	7,391,195.73
	GOV OF NORWAY	5,470,000.00	5,954,368.50
	GOV OF NORWAY	3,640,000.00	3,847,552.80
	GOV OF NORWAY	3,150,000.00	3,316,894.55
	GOV OF NORWAY	3,560,000.00	3,817,914.88
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,657,871.80
	GOV OF NORWAY	3,590,000.00	3,903,550.60
	GOV OF NORWAY	3,760,000.00	3,973,304.80
	ノルウェークローネ 小計	33,580,000.00	35,862,653.66 (410,627,384)

デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	5,600,000.00	5,802,624.80	
	GOV OF DENMARK	5,400,000.00	5,496,757.20	
	GOV OF DENMARK	5,820,000.00	6,199,283.58	
	GOV OF DENMARK	5,900,000.00	6,604,012.78	
	GOV OF DENMARK	7,000,000.00	7,507,451.00	
	GOV OF DENMARK	9,990,000.00	10,853,435.70	
	GOV OF DENMARK	11,420,000.00	21,766,746.11	
	GOV OF DENMARK	2,250,000.00	2,421,517.50	
デンマーククローネ 小計		53,380,000.00	66,651,828.67	(1,108,419,910)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	3,410,000.00	3,520,876.81	
	GOV OF POLAND	2,730,000.00	2,729,637.17	
	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,644,582.80	
	GOV OF POLAND	3,920,000.00	4,131,951.64	
	GOV OF POLAND	2,120,000.00	2,365,644.40	
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,146,359.50	
	GOV OF POLAND	3,010,000.00	3,250,803.91	
	GOV OF POLAND	1,900,000.00	1,930,061.99	
	GOV OF POLAND	2,610,000.00	2,953,867.50	
	GOV OF POLAND	4,300,000.00	4,762,419.42	
	GOV OF POLAND	2,790,000.00	3,104,680.75	
	GOV OF POLAND	3,120,000.00	3,536,676.00	
	GOV OF POLAND	740,000.00	1,034,224.00	
	GOV OF POLAND	4,790,000.00	5,480,239.00	
	GOV OF POLAND	940,000.00	944,643.87	
ポーランドズロチ 小計		41,680,000.00	45,536,668.76	(1,256,356,691)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	1,550,000.00	1,583,041.66	
	GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	2,232,165.75	
	GOV OF AUSTRALIA	2,690,000.00	2,806,141.81	
	GOV OF AUSTRALIA	2,990,000.00	3,379,613.74	
	GOV OF AUSTRALIA	2,980,000.00	3,248,880.33	
	GOV OF AUSTRALIA	3,020,000.00	3,027,236.50	
	GOV OF AUSTRALIA	2,930,000.00	3,319,854.08	
	GOV OF AUSTRALIA	1,740,000.00	1,735,529.58	

	GOV OF AUSTRALIA	2,750,000.00	3,328,510.07
	GOV OF AUSTRALIA	3,170,000.00	3,188,561.30
	GOV OF AUSTRALIA	2,560,000.00	3,256,946.94
	GOV OF AUSTRALIA	2,610,000.00	3,009,593.08
	GOV OF AUSTRALIA	2,740,000.00	3,072,499.54
	GOV OF AUSTRALIA	3,180,000.00	3,698,405.17
	GOV OF AUSTRALIA	2,940,000.00	3,551,297.44
	GOV OF AUSTRALIA	2,840,000.00	3,327,185.52
	GOV OF AUSTRALIA	3,310,000.00	3,817,228.02
	GOV OF AUSTRALIA	2,890,000.00	2,923,697.95
	GOV OF AUSTRALIA	1,960,000.00	2,076,010.44
	GOV OF AUSTRALIA	2,540,000.00	2,552,371.31
	GOV OF AUSTRALIA	1,720,000.00	1,769,012.93
	GOV OF AUSTRALIA	1,300,000.00	1,827,208.89
	GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	975,944.86
	GOV OF AUSTRALIA	1,220,000.00	1,647,270.96
	GOV OF AUSTRALIA	710,000.00	907,449.93
	GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	679,197.68
	GOV OF AUSTRALIA	1,210,000.00	1,519,386.82
	GOV OF AUSTRALIA	1,330,000.00	1,294,913.12
	オーストラリアドル 小計	62,300,000.00	69,755,155.42 (5,322,318,358)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	510,407.10
	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	694,171.50
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	630,008.00
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	808,792.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	305,428.00
	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	725,010.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	586,710.00
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	531,405.00
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	891,100.00
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	474,810.00
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	732,375.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	733,385.60
	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	725,895.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	621,791.10

	GOV OF SINGAPORE	390,000.00	464,663.55
	GOV OF SINGAPORE	400,000.00	511,400.00
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	810,080.00
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	414,872.50
	シンガポールドル 小計	9,800,000.00	11,172,304.35 (868,870,109)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,204,254.42
	GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,235,193.36
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	834,084.45
	GOV OF MALAYSIA	1,250,000.00	1,297,933.25
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,670,829.02
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	637,729.56
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	871,159.61
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	798,586.79
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	893,424.45
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,354,604.07
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	783,766.17
	GOV OF MALAYSIA	1,700,000.00	1,842,422.77
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	897,409.44
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,291,518.54
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,097,558.11
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,907,573.28
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,476,902.70
	GOV OF MALAYSIA	1,310,000.00	1,421,780.99
	GOV OF MALAYSIA	2,000,000.00	2,183,436.60
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,296,791.61
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,951,086.21
	GOV OF MALAYSIA	1,060,000.00	1,152,182.05
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,287,737.11
	GOV OF MALAYSIA	1,540,000.00	1,664,751.24
	GOV OF MALAYSIA	600,000.00	668,345.15
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,089,441.99
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	1,045,157.26
	GOV OF MALAYSIA	1,270,000.00	1,330,573.78
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	862,560.05

	GOV OF MALAYSIA	750,000.00	846,687.60	
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,070,525.60	
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	824,915.16	
	マレーシアリングット 小計	35,720,000.00	38,790,922.39 (986,453,156)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,570,000.00	1,741,679.50	
	GOV OF ISRAEL	1,860,000.00	1,885,203.00	
	GOV OF ISRAEL	1,120,000.00	1,159,480.00	
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	1,808,593.50	
	GOV OF ISRAEL	1,820,000.00	1,916,005.00	
	GOV OF ISRAEL	1,450,000.00	1,653,942.50	
	GOV OF ISRAEL	920,000.00	928,602.00	
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,968,340.00	
	GOV OF ISRAEL	1,360,000.00	1,828,996.00	
	GOV OF ISRAEL	1,800,000.00	1,994,130.00	
	GOV OF ISRAEL	1,540,000.00	1,733,270.00	
	GOV OF ISRAEL	1,310,000.00	1,339,933.50	
	GOV OF ISRAEL	930,000.00	935,905.50	
	GOV OF ISRAEL	1,740,000.00	3,035,430.00	
	GOV OF ISRAEL	1,720,000.00	2,430,790.00	
	イスラエルシュケル 小計	22,590,000.00	26,360,300.50 (819,014,536)	
	合計		199,105,557,503 (199,105,557,503)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 235銘柄	100.0%	43.4%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.0%
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%	41.5%
英ポンド	国債証券 47銘柄	100.0%	6.6%

スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券	15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	28銘柄	100.0%	2.7%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年11月16日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	417,868,772
株式	38,796,698,380
派生商品評価勘定	44,614,100
未収配当金	265,912,005
差入委託証拠金	30,210,000
流動資産合計	39,555,303,257
<b>資産合計</b>	
39,555,303,257	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	32,095,000
未払解約金	52,212,000
未払利息	1,133
流動負債合計	84,308,133
<b>負債合計</b>	
84,308,133	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	31,855,538,813
剰余金	

2020年11月16日現在

剰余金又は欠損金（ ）	7,615,456,311
元本等合計	39,470,995,124
純資産合計	39,470,995,124
負債純資産合計	39,555,303,257

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年11月16日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	35,012,990,352円
期中追加設定元本額	30,356,437,027円
期中一部解約元本額	33,513,888,566円
期末元本額	31,855,538,813円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,007,842,797円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,304,635,751円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,240,332,383円
DCりそな グローバルバランス	34,201,695円
つみたてバランスファンド	2,415,313,331円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	822,215,834円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	415,749,326円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	242,847,847円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	20,746,766円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	14,708,791円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,912,645円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	12,092,142円
リスクコントロール・オープン	6,359,316円



FWりそな国内株式アクティブファンド	520,764,842円
FWりそな国内株式インデックスファンド	16,716,408,593円
Smart-i TOPIXインデックス	1,076,362,242円
Smart-i 8資産バランス 安定型	131,470,496円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	321,351,372円
Smart-i 8資産バランス 成長型	347,687,594円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	361,565,299円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	285,575,570円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	164,213,487円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	106,597,834円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	317,236,775円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	52,451,706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)	2,150,259円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	531,616,958円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	840,854,234円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,490,263,994円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	46,008,934円
2. 計算日における受益権の総数	31,855,538,813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	1.2391円
(10,000口当たり純資産額)	(12,391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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,574,874,547
合計		2,574,874,547

(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11月16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	614,685,900	-	659,300,000	44,614,100
	合計	614,685,900	-	659,300,000	44,614,100

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	2,804.00	2,243,200	
日本水産	21,700	430.00	9,331,000	
マルハニチロ	3,100	2,285.00	7,083,500	
雪国まいたけ	1,300	1,900.00	2,470,000	
カネコ種苗	700	1,594.00	1,115,800	
サカタのタネ	2,600	3,585.00	9,321,000	
ホクト	1,700	2,128.00	3,617,600	
ホクリヨウ	300	688.00	206,400	
住石ホールディングス	4,300	124.00	533,200	
日鉄鉱業	500	5,040.00	2,520,000	
三井松島ホールディングス	800	747.00	597,600	
国際石油開発帝石	79,900	548.00	43,785,200	
石油資源開発	2,800	1,798.00	5,034,400	
K&Oエナジーグループ	1,100	1,461.00	1,607,100	
ヒノキヤグループ	500	2,383.00	1,191,500	

ショーボンドホールディングス	3,400	5,450.00	18,530,000	
ミライト・ホールディングス	6,500	1,655.00	10,757,500	
タマホーム	1,200	1,468.00	1,761,600	
サンヨーホームズ	200	698.00	139,600	
日本アクア	900	612.00	550,800	
ファーストコーポレーション	700	769.00	538,300	
ベストセラ	400	1,549.00	619,600	
TATERU	4,000	196.00	784,000	
キャンディル	400	571.00	228,400	
スペースバリューホールディングス	2,700	608.00	1,641,600	
ダイセキ環境ソリューション	400	708.00	283,200	
第一カッター興業	300	2,385.00	715,500	
安藤・間	12,900	735.00	9,481,500	
東急建設	6,400	499.00	3,193,600	
コムシスホールディングス	7,700	3,115.00	23,985,500	
ピーアールホールディングス	2,400	687.00	1,648,800	
高松コンストラクショングループ	1,400	2,175.00	3,045,000	
東建コーポレーション	700	7,920.00	5,544,000	
ソネック	200	858.00	171,600	
ヤマウラ	900	905.00	814,500	
大成建設	16,700	3,540.00	59,118,000	
大林組	50,200	926.00	46,485,200	
清水建設	50,900	797.00	40,567,300	
飛鳥建設	1,400	1,095.00	1,533,000	
長谷工コーポレーション	19,400	1,228.00	23,823,200	
松井建設	2,000	804.00	1,608,000	
銭高組	200	4,585.00	917,000	
鹿島建設	39,400	1,287.00	50,707,800	
不動テトラ	1,300	1,579.00	2,052,700	
大末建設	600	902.00	541,200	
鉄建建設	1,100	1,905.00	2,095,500	
西松建設	3,900	1,987.00	7,749,300	
三井住友建設	12,100	430.00	5,203,000	
大豊建設	1,100	3,480.00	3,828,000	
前田建設工業	12,600	854.00	10,760,400	
佐田建設	1,100	457.00	502,700	

ナカノフドー建設	1,400	431.00	603,400	
奥村組	2,400	2,502.00	6,004,800	
東鉄工業	2,200	2,935.00	6,457,000	
イチケン	400	1,735.00	694,000	
富士ピー・エス	700	603.00	422,100	
浅沼組	600	4,125.00	2,475,000	
戸田建設	20,800	635.00	13,208,000	
熊谷組	2,300	2,475.00	5,692,500	
北野建設	300	2,685.00	805,500	
植木組	200	2,904.00	580,800	
矢作建設工業	2,200	920.00	2,024,000	
ピーエス三菱	1,700	578.00	982,600	
日本ハウスホールディングス	3,400	243.00	826,200	
大東建託	5,500	10,110.00	55,605,000	
新日本建設	2,100	915.00	1,921,500	
N I P P O	4,200	2,850.00	11,970,000	
東亜道路工業	300	3,670.00	1,101,000	
前田道路	4,400	1,856.00	8,166,400	
日本道路	500	8,340.00	4,170,000	
東亜建設工業	1,600	2,036.00	3,257,600	
日本国土開発	4,900	571.00	2,797,900	
若築建設	900	1,234.00	1,110,600	
東洋建設	5,600	412.00	2,307,200	
五洋建設	19,900	792.00	15,760,800	
世紀東急工業	2,400	827.00	1,984,800	
福田組	600	5,230.00	3,138,000	
住友林業	12,700	1,884.00	23,926,800	
日本基礎技術	1,700	492.00	836,400	
巴コーポレーション	2,200	393.00	864,600	
大和ハウス工業	49,700	3,208.00	159,437,600	
ライト工業	2,900	1,647.00	4,776,300	
積水ハウス	54,400	1,918.00	104,339,200	
日特建設	1,300	831.00	1,080,300	
北陸電気工事	900	1,210.00	1,089,000	
ユアテック	2,900	680.00	1,972,000	
日本リーテック	1,100	2,540.00	2,794,000	

四電工	300	2,409.00	722,700	
中電工	2,000	2,135.00	4,270,000	
関電工	7,100	799.00	5,672,900	
きんでん	11,900	1,711.00	20,360,900	
東京エネシス	1,700	840.00	1,428,000	
トーエネック	500	3,655.00	1,827,500	
住友電設	1,400	2,915.00	4,081,000	
日本電設工業	2,800	2,223.00	6,224,400	
協和エクシオ	7,600	2,749.00	20,892,400	
新日本空調	1,300	2,247.00	2,921,100	
九電工	3,500	3,110.00	10,885,000	
三機工業	3,600	1,151.00	4,143,600	
日揮ホールディングス	15,500	941.00	14,585,500	
中外炉工業	500	1,570.00	785,000	
ヤマト	1,600	757.00	1,211,200	
太平電業	1,200	2,440.00	2,928,000	
高砂熱学工業	3,800	1,504.00	5,715,200	
三晃金属工業	200	2,687.00	537,400	
朝日工業社	300	2,981.00	894,300	
明星工業	3,200	848.00	2,713,600	
大気社	2,400	2,901.00	6,962,400	
ダイダン	1,200	2,758.00	3,309,600	
日比谷総合設備	1,600	1,812.00	2,899,200	
フィル・カンパニー	300	2,119.00	635,700	
OSJBホールディングス	7,900	251.00	1,982,900	
東洋エンジニアリング	2,100	335.00	703,500	
レイズネクスト	2,700	1,193.00	3,221,100	
日本製粉	4,700	1,737.00	8,163,900	
日清製粉グループ本社	18,200	1,770.00	32,214,000	
日東富士製粉	100	6,550.00	655,000	
昭和産業	1,500	3,370.00	5,055,000	
鳥越製粉	1,400	1,075.00	1,505,000	
中部飼料	2,000	1,484.00	2,968,000	
フィード・ワン	2,200	896.00	1,971,200	
東洋精糖	300	1,224.00	367,200	
日本甜菜製糖	800	1,730.00	1,384,000	

三井製糖	1,400	1,810.00	2,534,000	
塩水港精糖	1,700	230.00	391,000	
日新製糖	800	1,899.00	1,519,200	
森永製菓	3,800	4,115.00	15,637,000	
中村屋	400	4,225.00	1,690,000	
江崎グリコ	4,400	4,500.00	19,800,000	
名糖産業	800	1,497.00	1,197,600	
井村屋グループ	900	2,650.00	2,385,000	
不二家	1,000	2,473.00	2,473,000	
山崎製パン	12,000	1,816.00	21,792,000	
第一屋製パン	300	1,008.00	302,400	
モロゾフ	300	6,120.00	1,836,000	
亀田製菓	900	4,890.00	4,401,000	
寿スピリッツ	1,500	5,730.00	8,595,000	
カルビー	7,300	3,015.00	22,009,500	
森永乳業	3,000	5,180.00	15,540,000	
六甲バター	1,100	1,906.00	2,096,600	
ヤクルト本社	11,100	5,070.00	56,277,000	
明治ホールディングス	10,600	7,550.00	80,030,000	
雪印メグミルク	3,900	2,454.00	9,570,600	
プリマハム	2,500	2,965.00	7,412,500	
日本ハム	6,100	4,415.00	26,931,500	
林兼産業	500	597.00	298,500	
丸大食品	1,700	1,715.00	2,915,500	
S Foods	1,300	3,275.00	4,257,500	
柿安本店	600	2,550.00	1,530,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	10,300	695.00	7,158,500	
サッポロホールディングス	5,500	2,085.00	11,467,500	
アサヒグループホールディングス	35,100	4,114.00	144,401,400	
キリンホールディングス	68,100	2,240.50	152,578,050	
宝ホールディングス	11,900	1,251.00	14,886,900	
オエノンホールディングス	4,600	449.00	2,065,400	
養命酒製造	500	1,869.00	934,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	12,300	1,694.00	20,836,200	
サントリー食品インターナショナル	10,800	3,875.00	41,850,000	

ダイドーグループホールディングス	800	5,870.00	4,696,000	
伊藤園	4,900	7,880.00	38,612,000	
キーコーヒー	1,600	2,219.00	3,550,400	
ユニカフェ	500	1,110.00	555,000	
ジャパンフーズ	200	1,299.00	259,800	
日清オイリオグループ	2,100	3,020.00	6,342,000	
不二製油グループ本社	3,900	3,010.00	11,739,000	
かどや製油	200	3,875.00	775,000	
J - オイルミルズ	800	3,760.00	3,008,000	
キッコーマン	11,600	6,830.00	79,228,000	
味の素	35,500	2,264.00	80,372,000	
キューピー	8,900	2,254.00	20,060,600	
ハウス食品グループ本社	6,000	3,810.00	22,860,000	
カゴメ	6,600	3,985.00	26,301,000	
焼津水産化学工業	800	1,000.00	800,000	
アリアケジャパン	1,500	7,480.00	11,220,000	
ピエトロ	200	1,720.00	344,000	
エバラ食品工業	400	2,350.00	940,000	
やまみ	100	2,227.00	222,700	
ニチレイ	7,700	3,010.00	23,177,000	
東洋水産	8,300	5,260.00	43,658,000	
イトアンドホールディングス	600	1,899.00	1,139,400	
大冷	200	2,129.00	425,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	882.00	793,800	
日清食品ホールディングス	6,800	8,660.00	58,888,000	
永谷園ホールディングス	800	2,437.00	1,949,600	
一正蒲鉾	600	1,122.00	673,200	
フジッコ	1,700	2,025.00	3,442,500	
ロック・フィールド	1,700	1,563.00	2,657,100	
日本たばこ産業	86,100	2,160.50	186,019,050	
ケンコーマヨネーズ	900	1,794.00	1,614,600	
わらべや日洋ホールディングス	1,100	1,493.00	1,642,300	
なとり	900	2,118.00	1,906,200	
イフジ産業	300	829.00	248,700	
ピクルスコーポレーション	300	2,955.00	886,500	
北の達人コーポレーション	5,600	523.00	2,928,800	



ユーグレナ	6,900	820.00	5,658,000	
ミヨシ油脂	600	1,233.00	739,800	
理研ビタミン	1,500	1,526.00	2,289,000	
片倉工業	2,100	1,302.00	2,734,200	
ゲンゼ	1,200	3,765.00	4,518,000	
東洋紡	6,200	1,365.00	8,463,000	
ユニチカ	4,600	381.00	1,752,600	
富士紡ホールディングス	800	3,615.00	2,892,000	
倉敷紡績	1,600	1,818.00	2,908,800	
シキボウ	800	1,021.00	816,800	
日本毛織	5,200	1,061.00	5,517,200	
ダイトウボウ	2,500	130.00	325,000	
トーア紡コーポレーション	600	498.00	298,800	
ダイドーリミテッド	2,000	200.00	400,000	
帝国繊維	1,800	2,700.00	4,860,000	
帝人	12,800	1,851.00	23,692,800	
東レ	113,500	538.70	61,142,450	
サカイオーベックス	400	2,054.00	821,600	
住江織物	300	2,201.00	660,300	
日本フェルト	900	481.00	432,900	
イチカワ	200	1,358.00	271,600	
日東製網	200	1,457.00	291,400	
アツギ	1,300	574.00	746,200	
ダイニック	600	820.00	492,000	
セーレン	3,900	1,656.00	6,458,400	
ソトー	600	934.00	560,400	
東海染工	200	1,175.00	235,000	
小松マテーレ	2,600	938.00	2,438,800	
ワコールホールディングス	3,900	2,116.00	8,252,400	
ホギメディカル	1,800	3,200.00	5,760,000	
クラウディアホールディングス	400	303.00	121,200	
T S Iホールディングス	4,700	230.00	1,081,000	
マツオカコーポレーション	400	2,660.00	1,064,000	
ワールド	2,200	1,343.00	2,954,600	
三陽商会	800	526.00	420,800	
ナイガイ	600	370.00	222,000	

オンワードホールディングス	9,400	210.00	1,974,000	
ルックホールディングス	500	1,085.00	542,500	
キムラタン	8,800	25.00	220,000	
ゴールドウイン	2,800	7,100.00	19,880,000	
デサント	3,100	1,894.00	5,871,400	
キング	700	588.00	411,600	
ヤマトインターナショナル	1,400	346.00	484,400	
特種東海製紙	1,000	5,330.00	5,330,000	
王子ホールディングス	65,500	492.00	32,226,000	
日本製紙	6,900	1,230.00	8,487,000	
三菱製紙	1,800	342.00	615,600	
北越コーポレーション	9,300	373.00	3,468,900	
中越パルプ工業	700	1,344.00	940,800	
巴川製紙所	500	977.00	488,500	
大王製紙	7,600	1,792.00	13,619,200	
阿波製紙	400	454.00	181,600	
レンゴー	14,800	837.00	12,387,600	
トーモク	1,000	1,749.00	1,749,000	
ザ・パック	1,200	3,130.00	3,756,000	
クラレ	24,700	1,105.00	27,293,500	
旭化成	103,900	977.00	101,510,300	
共和レザー	900	633.00	569,700	
昭和電工	11,900	1,943.00	23,121,700	
住友化学	115,200	379.00	43,660,800	
住友精化	700	3,705.00	2,593,500	
日産化学	8,600	6,340.00	54,524,000	
ラサ工業	600	2,073.00	1,243,800	
クレハ	1,300	5,030.00	6,539,000	
多木化学	600	6,990.00	4,194,000	
テイカ	1,200	1,514.00	1,816,800	
石原産業	2,800	610.00	1,708,000	
片倉コープアグリ	400	1,290.00	516,000	
日本曹達	2,300	2,752.00	6,329,600	
東ソー	24,200	1,714.00	41,478,800	
トクヤマ	4,500	2,321.00	10,444,500	
セントラル硝子	3,200	2,267.00	7,254,400	

東亜合成	9,800	1,167.00	11,436,600	
大阪ソーダ	1,600	2,535.00	4,056,000	
関東電化工業	3,700	721.00	2,667,700	
デンカ	5,700	3,325.00	18,952,500	
信越化学工業	26,900	15,330.00	412,377,000	
日本カーバイド工業	600	1,224.00	734,400	
堺化学工業	1,000	2,050.00	2,050,000	
第一稀元素化学工業	1,700	740.00	1,258,000	
エア・ウォーター	14,600	1,745.00	25,477,000	
日本酸素ホールディングス	15,100	1,751.00	26,440,100	
日本化学工業	500	2,368.00	1,184,000	
東邦アセチレン	200	1,242.00	248,400	
日本パーカラライジング	7,900	1,117.00	8,824,300	
高压ガス工業	2,500	819.00	2,047,500	
チタン工業	200	1,798.00	359,600	
四国化成工業	2,300	1,235.00	2,840,500	
戸田工業	400	2,005.00	802,000	
ステラ ケミファ	900	3,190.00	2,871,000	
保土谷化学工業	600	4,400.00	2,640,000	
日本触媒	2,400	5,350.00	12,840,000	
大日精化工業	1,400	2,266.00	3,172,400	
カネカ	4,100	3,180.00	13,038,000	
三菱瓦斯化学	14,600	1,903.00	27,783,800	
三井化学	14,500	2,932.00	42,514,000	
J S R	14,600	2,665.00	38,909,000	
東京応化工業	2,700	6,290.00	16,983,000	
大阪有機化学工業	1,400	2,626.00	3,676,400	
三菱ケミカルホールディングス	104,800	594.40	62,293,120	
K Hネオケム	2,600	2,752.00	7,155,200	
ダイセル	19,600	760.00	14,896,000	
住友ベークライト	2,500	3,200.00	8,000,000	
積水化学工業	33,200	1,763.00	58,531,600	
日本ゼオン	14,100	1,289.00	18,174,900	
アイカ工業	4,700	3,805.00	17,883,500	
宇部興産	7,900	1,795.00	14,180,500	
積水樹脂	2,800	2,257.00	6,319,600	

タキロンシーアイ	3,400	670.00	2,278,000	
旭有機材	900	1,437.00	1,293,300	
ニチバン	800	1,766.00	1,412,800	
リケンテクノス	3,800	432.00	1,641,600	
大倉工業	700	1,980.00	1,386,000	
積水化成成品工業	2,100	568.00	1,192,800	
群栄化学工業	400	2,657.00	1,062,800	
タイガースポリマー	800	437.00	349,600	
ミライアル	600	1,220.00	732,000	
ダイキアクシス	600	877.00	526,200	
ダイキョーニシカワ	3,300	711.00	2,346,300	
竹本容器	600	912.00	547,200	
森六ホールディングス	800	2,059.00	1,647,200	
日本化薬	9,700	935.00	9,069,500	
カーリットホールディングス	1,700	552.00	938,400	
日本精化	1,300	1,510.00	1,963,000	
扶桑化学工業	1,600	3,250.00	5,200,000	
トリケミカル研究所	300	12,660.00	3,798,000	
A D E K A	7,200	1,598.00	11,505,600	
日油	5,900	4,425.00	26,107,500	
新日本理化	2,600	170.00	442,000	
ハリマ化成グループ	1,300	1,035.00	1,345,500	
花王	38,300	7,902.00	302,646,600	
第一工業製薬	600	4,425.00	2,655,000	
石原ケミカル	400	2,280.00	912,000	
日華化学	500	985.00	492,500	
ニイタカ	300	3,310.00	993,000	
三洋化成工業	900	4,505.00	4,054,500	
有機合成薬品工業	1,200	315.00	378,000	
大日本塗料	1,800	963.00	1,733,400	
日本ペイントホールディングス	12,900	10,750.00	138,675,000	
関西ペイント	17,600	2,907.00	51,163,200	
神東塗料	1,200	177.00	212,400	
中国塗料	4,500	989.00	4,450,500	
日本特殊塗料	1,200	1,138.00	1,365,600	
藤倉化成	2,100	534.00	1,121,400	

太陽ホールディングス	1,200	5,770.00	6,924,000	
D I C	6,600	2,629.00	17,351,400	
サカタインクス	3,400	1,157.00	3,933,800	
東洋インキＳＣホールディングス	3,300	1,992.00	6,573,600	
T & K T O K A	1,200	885.00	1,062,000	
富士フィルムホールディングス	30,700	5,671.00	174,099,700	
資生堂	31,800	7,252.00	230,613,600	
ライオン	20,800	2,450.00	50,960,000	
高砂香料工業	1,000	2,417.00	2,417,000	
マンダム	3,600	1,687.00	6,073,200	
ミルボン	2,100	5,810.00	12,201,000	
ファンケル	6,500	3,865.00	25,122,500	
コーセー	3,000	15,780.00	47,340,000	
コタ	900	1,378.00	1,240,200	
シーボン	200	1,975.00	395,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,800	2,095.00	14,246,000	
ノエビアホールディングス	1,400	4,605.00	6,447,000	
アジュバンコスメジャパン	400	1,037.00	414,800	
エステー	1,000	2,003.00	2,003,000	
アグロ カネショウ	600	1,800.00	1,080,000	
コニシ	2,600	1,592.00	4,139,200	
長谷川香料	2,800	2,112.00	5,913,600	
星光P M C	900	664.00	597,600	
小林製薬	4,500	11,410.00	51,345,000	
荒川化学工業	1,400	1,146.00	1,604,400	
メック	1,100	2,034.00	2,237,400	
日本高純度化学	400	2,763.00	1,105,200	
タカラバイオ	4,200	2,997.00	12,587,400	
J C U	1,900	3,445.00	6,545,500	
新田ゼラチン	1,000	718.00	718,000	
O A T アグリオ	300	1,355.00	406,500	
デクセリアルズ	4,100	1,191.00	4,883,100	
アース製薬	1,200	6,370.00	7,644,000	
北興化学工業	1,500	1,072.00	1,608,000	
大成ラミック	500	2,940.00	1,470,000	
クミアイ化学工業	6,600	1,064.00	7,022,400	

日本農薬	2,900	539.00	1,563,100	
アキレス	1,100	1,528.00	1,680,800	
有沢製作所	2,500	979.00	2,447,500	
日東電工	11,000	8,050.00	88,550,000	
レック	1,700	1,531.00	2,602,700	
三光合成	1,800	302.00	543,600	
きもと	2,700	183.00	494,100	
藤森工業	1,400	4,465.00	6,251,000	
前澤化成工業	1,000	998.00	998,000	
未来工業	900	1,916.00	1,724,400	
ウェーブロックホールディングス	600	720.00	432,000	
J S P	900	1,529.00	1,376,100	
エフピコ	3,400	4,350.00	14,790,000	
天馬	1,100	1,900.00	2,090,000	
信越ポリマー	2,900	939.00	2,723,100	
東リ	4,000	276.00	1,104,000	
ニフコ	5,900	3,520.00	20,768,000	
バルカー	1,300	1,863.00	2,421,900	
ユニ・チャーム	33,900	5,310.00	180,009,000	
ショーエイコーポレーション	200	1,231.00	246,200	
協和キリン	16,100	2,912.00	46,883,200	
武田薬品工業	133,200	3,565.00	474,858,000	
アステラス製薬	138,800	1,655.00	229,714,000	
大日本住友製薬	11,900	1,422.00	16,921,800	
塩野義製薬	20,100	5,622.00	113,002,200	
わかもと製薬	1,900	269.00	511,100	
あすか製薬	1,800	1,612.00	2,901,600	
日本新薬	4,200	7,450.00	31,290,000	
バイオフェルミン製薬	300	2,470.00	741,000	
中外製薬	50,100	4,627.00	231,812,700	
科研製薬	2,700	4,025.00	10,867,500	
エーザイ	19,200	7,813.00	150,009,600	
ロート製薬	8,200	3,455.00	28,331,000	
小野薬品工業	36,800	3,161.00	116,324,800	
久光製薬	4,200	5,840.00	24,528,000	
持田製薬	2,200	4,150.00	9,130,000	

参天製薬	29,800	1,710.00	50,958,000	
扶桑薬品工業	600	2,904.00	1,742,400	
日本ケミファ	200	2,537.00	507,400	
ツムラ	5,000	3,370.00	16,850,000	
日医工	4,500	1,020.00	4,590,000	
キッセイ薬品工業	2,800	2,103.00	5,888,400	
生化学工業	3,100	1,015.00	3,146,500	
栄研化学	2,800	1,940.00	5,432,000	
日水製薬	700	1,008.00	705,600	
鳥居薬品	1,000	3,255.00	3,255,000	
JCRファーマ	4,500	2,785.00	12,532,500	
東和薬品	2,000	1,952.00	3,904,000	
富士製薬工業	1,100	1,246.00	1,370,600	
沢井製薬	3,300	4,785.00	15,790,500	
ゼリア新薬工業	2,900	1,938.00	5,620,200	
第一三共	137,400	3,505.00	481,587,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,500	1,885.00	6,597,500	
大幸薬品	2,000	1,762.00	3,524,000	
ダイト	1,000	3,860.00	3,860,000	
大塚ホールディングス	33,300	4,233.00	140,958,900	
大正製薬ホールディングス	3,400	6,560.00	22,304,000	
ペプチドリーム	8,100	5,100.00	41,310,000	
日本コークス工業	13,300	70.00	931,000	
ニチレキ	1,900	1,783.00	3,387,700	
ユシロ化学工業	900	1,360.00	1,224,000	
ビービー・カストロール	600	1,293.00	775,800	
富士石油	4,200	194.00	814,800	
MORESCO	600	1,019.00	611,400	
出光興産	17,800	2,205.00	39,249,000	
ENEOSホールディングス	240,800	370.20	89,144,160	
コスモエネルギーホールディングス	4,600	1,757.00	8,082,200	
横浜ゴム	9,300	1,679.00	15,614,700	
TOYO TIRE	8,400	1,760.00	14,784,000	
ブリヂストン	42,600	3,597.00	153,232,200	
住友ゴム工業	14,400	1,039.00	14,961,600	
藤倉コンポジット	1,400	354.00	495,600	

オカモト	1,000	4,205.00	4,205,000	
フコク	700	731.00	511,700	
ニッタ	1,800	2,244.00	4,039,200	
住友理工	3,100	548.00	1,698,800	
三ツ星ベルト	2,100	1,729.00	3,630,900	
バンドー化学	2,800	578.00	1,618,400	
日東紡績	2,400	4,125.00	9,900,000	
A G C	14,700	3,550.00	52,185,000	
日本板硝子	7,700	421.00	3,241,700	
石塚硝子	300	1,929.00	578,700	
日本山村硝子	700	861.00	602,700	
日本電気硝子	5,900	2,234.00	13,180,600	
オハラ	600	1,234.00	740,400	
住友大阪セメント	3,000	3,340.00	10,020,000	
太平洋セメント	10,100	2,954.00	29,835,400	
日本ヒューム	1,600	800.00	1,280,000	
日本コンクリート工業	3,400	315.00	1,071,000	
三谷セキサン	700	4,610.00	3,227,000	
アジアパイルホールディングス	2,300	464.00	1,067,200	
東海カーボン	15,700	1,216.00	19,091,200	
日本カーボン	900	3,745.00	3,370,500	
東洋炭素	900	1,742.00	1,567,800	
ノリタケカンパニーリミテド	900	3,005.00	2,704,500	
T O T O	11,400	5,780.00	65,892,000	
日本碍子	19,200	1,699.00	32,620,800	
日本特殊陶業	12,200	1,830.00	22,326,000	
ダントーホールディングス	1,200	489.00	586,800	
M A R U W A	600	10,520.00	6,312,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,256.00	902,400	
黒崎播磨	300	2,900.00	870,000	
ヨータイ	1,300	789.00	1,025,700	
イソライト工業	800	451.00	360,800	
東京窯業	2,000	344.00	688,000	
ニッカトー	700	699.00	489,300	
フジミインコーポレーテッド	1,400	3,470.00	4,858,000	
クニミネ工業	600	1,112.00	667,200	



エーアンドエーマテリアル	300	1,112.00	333,600	
ニチアス	4,400	2,301.00	10,124,400	
ニチハ	2,200	3,135.00	6,897,000	
日本製鉄	70,800	1,215.00	86,022,000	
神戸製鋼所	29,000	498.00	14,442,000	
中山製鋼所	2,200	389.00	855,800	
合同製鐵	900	1,870.00	1,683,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	42,800	901.00	38,562,800	
東京製鐵	7,700	682.00	5,251,400	
共英製鋼	1,800	1,358.00	2,444,400	
大和工業	3,400	2,536.00	8,622,400	
東京鐵鋼	700	2,022.00	1,415,400	
大阪製鐵	800	1,144.00	915,200	
淀川製鋼所	2,100	2,075.00	4,357,500	
丸一鋼管	5,100	2,411.00	12,296,100	
モリ工業	500	2,538.00	1,269,000	
大同特殊鋼	2,600	4,260.00	11,076,000	
日本高周波鋼業	600	346.00	207,600	
日本冶金工業	1,300	1,555.00	2,021,500	
山陽特殊製鋼	1,100	1,100.00	1,210,000	
愛知製鋼	900	2,708.00	2,437,200	
日立金属	17,100	1,438.00	24,589,800	
日本金属	400	649.00	259,600	
大平洋金属	1,100	1,817.00	1,998,700	
新日本電工	10,200	224.00	2,284,800	
栗本鐵工所	800	1,794.00	1,435,200	
虹技	200	1,276.00	255,200	
日本鑄鉄管	200	1,273.00	254,600	
三菱製鋼	1,200	538.00	645,600	
日亜鋼業	2,300	310.00	713,000	
日本精線	300	3,485.00	1,045,500	
エンビプロ・ホールディングス	700	544.00	380,800	
シンニッタン	2,400	193.00	463,200	
新家工業	400	1,160.00	464,000	
大紀アルミニウム工業所	2,600	679.00	1,765,400	
日本輕金属ホールディングス	4,000	1,790.00	7,160,000	

三井金属鉱業	4,300	3,020.00	12,986,000
東邦亜鉛	800	2,048.00	1,638,400
三菱マテリアル	10,500	2,030.00	21,315,000
住友金属鉱山	20,200	3,752.00	75,790,400
D O W Aホールディングス	4,000	3,630.00	14,520,000
古河機械金属	2,800	1,132.00	3,169,600
エス・サイエンス	6,900	44.00	303,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	879.00	1,406,400
東邦チタニウム	2,800	713.00	1,996,400
U A C J	2,400	1,724.00	4,137,600
C Kサンエツ	300	3,740.00	1,122,000
古河電気工業	4,900	2,489.00	12,196,100
住友電気工業	59,200	1,334.50	79,002,400
フジクラ	19,100	402.00	7,678,200
昭和電線ホールディングス	1,800	1,450.00	2,610,000
東京特殊電線	200	2,382.00	476,400
タツタ電線	3,100	586.00	1,816,600
カナレ電気	300	1,767.00	530,100
平河ビューテック	800	1,100.00	880,000
リョービ	1,900	1,215.00	2,308,500
アーレスティ	2,100	329.00	690,900
アサヒホールディングス	2,800	3,500.00	9,800,000
稲葉製作所	900	1,399.00	1,259,100
宮地エンジニアリンググループ	500	2,196.00	1,098,000
トーカロ	4,400	1,149.00	5,055,600
アルファC o	600	980.00	588,000
S U M C O	20,300	1,718.00	34,875,400
川田テクノロジーズ	300	4,345.00	1,303,500
R S Technologies	500	3,480.00	1,740,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,640.00	364,000
信和	900	715.00	643,500
東洋製罐グループホールディングス	10,100	1,102.00	11,130,200
ホッカンホールディングス	900	1,455.00	1,309,500
コロナ	900	945.00	850,500
横河ブリッジホールディングス	2,900	1,960.00	5,684,000
駒井ハルテック	300	1,646.00	493,800

高田機工	100	2,529.00	252,900	
三和ホールディングス	14,900	1,279.00	19,057,100	
文化シャッター	4,700	926.00	4,352,200	
三協立山	2,000	867.00	1,734,000	
アルインコ	1,200	903.00	1,083,600	
東洋シャッター	400	726.00	290,400	
LIXILグループ	23,400	2,405.00	56,277,000	
日本フィルコン	1,100	565.00	621,500	
ノーリツ	3,300	1,713.00	5,652,900	
長府製作所	1,600	2,113.00	3,380,800	
リンナイ	3,100	11,760.00	36,456,000	
ダイニチ工業	900	896.00	806,400	
日東精工	2,000	456.00	912,000	
三洋工業	200	1,987.00	397,400	
岡部	3,200	835.00	2,672,000	
ジーテクト	2,000	1,386.00	2,772,000	
東プレ	3,000	1,229.00	3,687,000	
高周波熱錬	3,000	477.00	1,431,000	
東京製綱	1,100	564.00	620,400	
サンコール	1,200	453.00	543,600	
モリテック スチール	1,200	309.00	370,800	
パイオラックス	2,300	1,706.00	3,923,800	
エイチワン	1,600	663.00	1,060,800	
日本発條	17,000	652.00	11,084,000	
中央発條	200	2,960.00	592,000	
アドバネクス	200	1,243.00	248,600	
立川ブラインド工業	700	1,297.00	907,900	
三益半導体工業	1,200	2,586.00	3,103,200	
日本ドライケミカル	400	1,526.00	610,400	
日本製鋼所	4,800	2,651.00	12,724,800	
三浦工業	6,800	5,360.00	36,448,000	
タクマ	5,400	1,816.00	9,806,400	
ツガミ	3,300	1,598.00	5,273,400	
オークマ	1,800	5,910.00	10,638,000	
芝浦機械	1,800	2,113.00	3,803,400	
アマダ	19,600	1,023.00	20,050,800	

アイダエンジニアリング	4,100	897.00	3,677,700	
滝澤鉄工所	500	996.00	498,000	
F U J I	6,800	2,394.00	16,279,200	
牧野フライス製作所	1,900	4,240.00	8,056,000	
オーエスジー	7,800	1,810.00	14,118,000	
ダイジェット工業	200	1,440.00	288,000	
旭ダイヤモンド工業	4,200	453.00	1,902,600	
D M G 森精機	10,000	1,545.00	15,450,000	
ソディック	3,400	851.00	2,893,400	
ディスコ	2,100	30,450.00	63,945,000	
日東工器	900	1,700.00	1,530,000	
日進工具	600	2,496.00	1,497,600	
パンチ工業	1,400	425.00	595,000	
富士ダイス	700	660.00	462,000	
豊和工業	900	824.00	741,600	
O K K	600	389.00	233,400	
石川製作所	400	1,748.00	699,200	
東洋機械金属	1,100	408.00	448,800	
津田駒工業	300	912.00	273,600	
エンシュウ	400	944.00	377,600	
島精機製作所	2,500	1,826.00	4,565,000	
オプトラン	2,000	2,116.00	4,232,000	
N C ホールディングス	500	606.00	303,000	
イワキポンプ	1,000	803.00	803,000	
フリーー	1,500	1,075.00	1,612,500	
ヤマシンフィルタ	3,400	990.00	3,366,000	
日阪製作所	2,000	892.00	1,784,000	
やまびこ	3,100	1,365.00	4,231,500	
平田機工	700	6,900.00	4,830,000	
ベガサスミシン製造	1,600	285.00	456,000	
マルマエ	600	914.00	548,400	
タツモ	700	1,550.00	1,085,000	
ナプテスコ	9,300	3,985.00	37,060,500	
三井海洋開発	1,700	1,690.00	2,873,000	
レオン自動機	1,600	1,185.00	1,896,000	
S M C	5,000	60,000.00	300,000,000	

ホソカワミクロン	600	5,900.00	3,540,000	
ユニオンツール	600	3,185.00	1,911,000	
オイレス工業	2,000	1,589.00	3,178,000	
日精エー・エス・ビー機械	500	5,300.00	2,650,000	
サトーホールディングス	2,300	2,121.00	4,878,300	
技研製作所	1,400	3,965.00	5,551,000	
日本エアージェット	500	1,686.00	843,000	
カワタ	500	841.00	420,500	
日精樹脂工業	1,300	903.00	1,173,900	
オカダアイヨン	500	961.00	480,500	
ワイエイシイホールディングス	700	702.00	491,400	
小松製作所	72,500	2,547.00	184,657,500	
住友重機械工業	9,200	2,394.00	22,024,800	
日立建機	6,400	2,849.00	18,233,600	
日工	2,200	677.00	1,489,400	
巴工業	600	1,987.00	1,192,200	
井関農機	1,600	1,381.00	2,209,600	
T O W A	1,600	1,618.00	2,588,800	
丸山製作所	300	1,440.00	432,000	
北川鉄工所	700	1,380.00	966,000	
ローツェ	700	5,320.00	3,724,000	
タカキタ	600	669.00	401,400	
クボタ	84,900	2,118.00	179,818,200	
荏原実業	400	3,685.00	1,474,000	
三菱化工機	600	1,962.00	1,177,200	
月島機械	2,900	1,345.00	3,900,500	
帝国電機製作所	1,300	1,218.00	1,583,400	
東京機械製作所	600	278.00	166,800	
新東工業	3,800	714.00	2,713,200	
澁谷工業	1,400	3,550.00	4,970,000	
アイチ コーポレーション	2,800	913.00	2,556,400	
小森コーポレーション	4,100	725.00	2,972,500	
鶴見製作所	1,200	1,774.00	2,128,800	
住友精密工業	200	1,987.00	397,400	
日本ギア工業	600	308.00	184,800	
酒井重工業	300	2,399.00	719,700	

荏原製作所	6,600	3,065.00	20,229,000	
石井鐵工所	200	2,782.00	556,400	
西島製作所	1,600	802.00	1,283,200	
北越工業	1,600	1,134.00	1,814,400	
ダイキン工業	20,400	23,655.00	482,562,000	
オルガノ	600	5,480.00	3,288,000	
トーヨーカネツ	700	1,982.00	1,387,400	
栗田工業	8,700	3,555.00	30,928,500	
樺本チエイン	2,300	2,528.00	5,814,400	
大同工業	800	728.00	582,400	
木村化工機	1,300	458.00	595,400	
アネスト岩田	2,500	944.00	2,360,000	
ダイフク	8,200	11,430.00	93,726,000	
サムコ	400	2,951.00	1,180,400	
加藤製作所	900	1,081.00	972,900	
油研工業	300	1,512.00	453,600	
タダノ	7,700	835.00	6,429,500	
フジテック	5,800	2,164.00	12,551,200	
C K D	4,400	2,087.00	9,182,800	
キトー	1,200	1,575.00	1,890,000	
平和	4,500	1,604.00	7,218,000	
理想科学工業	1,400	1,227.00	1,717,800	
S A N K Y O	3,600	2,693.00	9,694,800	
日本金銭機械	1,800	565.00	1,017,000	
マースグループホールディングス	1,000	1,665.00	1,665,000	
フクシマガリレイ	1,000	4,440.00	4,440,000	
オーイズミ	700	383.00	268,100	
ダイコク電機	700	908.00	635,600	
竹内製作所	2,700	2,489.00	6,720,300	
アマノ	4,200	2,632.00	11,054,400	
J U K I	2,200	482.00	1,060,400	
サンデンホールディングス	2,100	379.00	795,900	
蛇の目マシン工業	1,500	711.00	1,066,500	
マックス	2,400	1,499.00	3,597,600	
グローリー	4,100	2,270.00	9,307,000	
新晃工業	1,500	1,619.00	2,428,500	

大和冷機工業	2,600	1,095.00	2,847,000
セガサミーホールディングス	15,900	1,541.00	24,501,900
日本ピストンリング	600	1,042.00	625,200
リケン	700	2,435.00	1,704,500
T P R	2,200	1,432.00	3,150,400
ツバキ・ナカシマ	3,100	931.00	2,886,100
ホシザキ	5,000	10,560.00	52,800,000
大豊工業	1,300	609.00	791,700
日本精工	30,100	916.00	27,571,600
N T N	37,000	233.00	8,621,000
ジェイテクト	15,400	895.00	13,783,000
不二越	1,500	4,455.00	6,682,500
日本トムソン	4,700	347.00	1,630,900
T H K	10,000	3,070.00	30,700,000
ユーシン精機	1,200	723.00	867,600
前澤給装工業	600	2,300.00	1,380,000
イーグル工業	2,000	900.00	1,800,000
前澤工業	1,100	466.00	512,600
日本ピラー工業	1,600	1,510.00	2,416,000
キッツ	6,500	570.00	3,705,000
マキタ	20,900	5,150.00	107,635,000
日立造船	12,700	427.00	5,422,900
三菱重工業	26,800	2,448.00	65,606,400
I H I	11,500	1,500.00	17,250,000
スター精密	2,500	1,525.00	3,812,500
日清紡ホールディングス	9,800	760.00	7,448,000
イビデン	9,800	4,440.00	43,512,000
コニカミノルタ	35,000	308.00	10,780,000
ブラザー工業	19,500	1,804.00	35,178,000
ミネベアミツミ	29,700	1,995.00	59,251,500
日立製作所	76,900	3,872.00	297,756,800
三菱電機	160,100	1,415.00	226,541,500
富士電機	9,600	3,490.00	33,504,000
東洋電機製造	600	1,106.00	663,600
安川電機	17,200	4,580.00	78,776,000
シンフォニアテクノロジー	2,100	1,259.00	2,643,900

明電舎	2,900	1,697.00	4,921,300	
オリジン	400	1,350.00	540,000	
山洋電気	800	4,855.00	3,884,000	
デンヨー	1,400	2,220.00	3,108,000	
東芝テック	2,000	4,230.00	8,460,000	
芝浦メカトロニクス	300	3,745.00	1,123,500	
マブチモーター	4,400	4,450.00	19,580,000	
日本電産	38,500	11,670.00	449,295,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	323.00	290,700	
トレックス・セミコンダクター	900	1,296.00	1,166,400	
東光高岳	900	1,189.00	1,070,100	
ダブル・スコープ	2,500	694.00	1,735,000	
宮越ホールディングス	600	709.00	425,400	
ダイヘン	1,800	4,200.00	7,560,000	
ヤーマン	2,600	1,842.00	4,789,200	
JVCケンウッド	13,000	158.00	2,054,000	
ミマキエンジニアリング	1,400	484.00	677,600	
I - P E X	700	1,952.00	1,366,400	
日新電機	3,800	1,181.00	4,487,800	
大崎電気工業	3,200	563.00	1,801,600	
オムロン	14,400	8,420.00	121,248,000	
日東工業	2,400	1,881.00	4,514,400	
I D E C	2,300	1,864.00	4,287,200	
正興電機製作所	400	1,799.00	719,600	
不二電機工業	300	1,310.00	393,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,300	2,198.00	11,649,400	
サクサホールディングス	400	1,457.00	582,800	
メルコホールディングス	600	2,910.00	1,746,000	
テクノメディカ	400	1,594.00	637,600	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	827.00	248,100	
日本電気	19,400	5,500.00	106,700,000	
富士通	15,400	13,245.00	203,973,000	
沖電気工業	6,500	927.00	6,025,500	
岩崎通信機	700	849.00	594,300	
電気興業	800	2,881.00	2,304,800	



サンケン電気	1,700	3,690.00	6,273,000	
ナカヨ	300	1,486.00	445,800	
アイホン	900	1,571.00	1,413,900	
ルネサスエレクトロニクス	68,500	950.00	65,075,000	
セイコーエプソン	19,900	1,403.00	27,919,700	
ワコム	10,800	754.00	8,143,200	
アルバック	2,900	4,145.00	12,020,500	
アクセル	700	815.00	570,500	
E I Z O	1,200	3,590.00	4,308,000	
ジャパンディスプレイ	46,300	51.00	2,361,300	
日本信号	4,100	923.00	3,784,300	
京三製作所	3,700	440.00	1,628,000	
能美防災	2,100	2,453.00	5,151,300	
ホーチキ	1,200	1,244.00	1,492,800	
星和電機	800	634.00	507,200	
エレコム	1,800	4,550.00	8,190,000	
パナソニック	182,900	1,100.00	201,190,000	
シャープ	18,500	1,183.00	21,885,500	
アンリツ	10,300	2,312.00	23,813,600	
富士通ゼネラル	4,300	3,215.00	13,824,500	
ソニー	100,300	9,491.00	951,947,300	
T D K	7,700	13,820.00	106,414,000	
帝国通信工業	700	1,178.00	824,600	
タムラ製作所	5,300	529.00	2,803,700	
アルプスアルパイン	14,200	1,465.00	20,803,000	
池上通信機	500	803.00	401,500	
日本電波工業	1,400	468.00	655,200	
鈴木	800	895.00	716,000	
日本トリム	200	3,685.00	737,000	
ローランド ディー . ジー .	900	1,611.00	1,449,900	
フォスター電機	1,700	1,168.00	1,985,600	
S M K	400	2,843.00	1,137,200	
ヨコオ	1,000	2,471.00	2,471,000	
ティアック	1,100	115.00	126,500	
ホシデン	4,400	880.00	3,872,000	
ヒロセ電機	2,500	14,380.00	35,950,000	

日本航空電子工業	3,700	1,459.00	5,398,300
TOA	1,700	930.00	1,581,000
マクセルホールディングス	3,400	1,167.00	3,967,800
古野電気	2,100	1,180.00	2,478,000
ユニデンホールディングス	400	2,340.00	936,000
スミダコーポレーション	1,400	996.00	1,394,400
アイコム	900	2,884.00	2,595,600
リオン	700	2,609.00	1,826,300
本多通信工業	1,400	479.00	670,600
船井電機	1,600	428.00	684,800
横河電機	14,700	1,867.00	27,444,900
新電元工業	600	2,431.00	1,458,600
アズビル	10,100	4,575.00	46,207,500
東亜ディーケーケー	800	866.00	692,800
日本光電工業	6,600	3,530.00	23,298,000
チノー	600	1,435.00	861,000
共和電業	1,700	430.00	731,000
日本電子材料	600	1,485.00	891,000
堀場製作所	3,200	5,940.00	19,008,000
アドバンテスト	11,900	7,230.00	86,037,000
小野測器	700	544.00	380,800
エスベック	1,400	1,800.00	2,520,000
キーエンス	14,500	53,060.00	769,370,000
日置電機	800	3,905.00	3,124,000
シスメックス	11,400	10,540.00	120,156,000
日本マイクロニクス	2,800	997.00	2,791,600
メガチップス	1,500	2,754.00	4,131,000
OBARA GROUP	900	3,300.00	2,970,000
澤藤電機	200	1,873.00	374,600
原田工業	800	876.00	700,800
コーセル	2,100	1,060.00	2,226,000
イリソ電子工業	1,300	4,800.00	6,240,000
オブテックスグループ	2,600	1,759.00	4,573,400
千代田インテグレ	700	1,542.00	1,079,400
アイ・オー・データ機器	500	984.00	492,000
レーザーテック	7,000	10,110.00	70,770,000

スタンレー電気	11,200	3,020.00	33,824,000	
岩崎電気	600	1,349.00	809,400	
ウシオ電機	8,800	1,332.00	11,721,600	
岡谷電機産業	1,200	358.00	429,600	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,500	309.00	463,500	
エノモト	500	1,247.00	623,500	
日本セラミック	1,600	2,994.00	4,790,400	
遠藤照明	800	576.00	460,800	
古河電池	1,100	1,319.00	1,450,900	
双信電機	800	417.00	333,600	
山一電機	1,200	1,395.00	1,674,000	
図研	1,000	2,739.00	2,739,000	
日本電子	3,200	3,745.00	11,984,000	
カシオ計算機	14,200	1,980.00	28,116,000	
ファナック	15,100	24,155.00	364,740,500	
日本シイエムケイ	3,800	451.00	1,713,800	
エンプラス	800	2,197.00	1,757,600	
大真空	600	2,064.00	1,238,400	
ローム	6,700	8,630.00	57,821,000	
浜松ホトニクス	11,500	5,650.00	64,975,000	
三井ハイテック	1,800	2,369.00	4,264,200	
新光電気工業	5,400	1,990.00	10,746,000	
京セラ	22,500	6,134.00	138,015,000	
太陽誘電	7,100	4,135.00	29,358,500	
村田製作所	47,000	8,134.00	382,298,000	
双葉電子工業	2,500	869.00	2,172,500	
北陸電気工業	600	906.00	543,600	
ニチコン	5,400	994.00	5,367,600	
日本ケミコン	1,200	1,472.00	1,766,400	
K O A	2,400	1,396.00	3,350,400	
市光工業	2,400	479.00	1,149,600	
小糸製作所	9,600	5,860.00	56,256,000	
ミツバ	2,900	490.00	1,421,000	
S C R E E Nホールディングス	2,800	6,310.00	17,668,000	
キヤノン電子	1,500	1,455.00	2,182,500	
キヤノン	79,500	1,911.00	151,924,500	

リコー	40,700	670.00	27,269,000	
象印マホービン	4,300	2,010.00	8,643,000	
MUTOHホールディングス	200	1,481.00	296,200	
東京エレクトロン	10,200	32,570.00	332,214,000	
トヨタ紡織	4,700	1,535.00	7,214,500	
芦森工業	300	913.00	273,900	
ユニプレス	3,100	917.00	2,842,700	
豊田自動織機	13,000	7,380.00	95,940,000	
モリタホールディングス	2,800	1,926.00	5,392,800	
三櫻工業	2,000	644.00	1,288,000	
デンソー	35,200	5,267.00	185,398,400	
東海理化電機製作所	4,200	1,727.00	7,253,400	
三井E & Sホールディングス	5,800	387.00	2,244,600	
川崎重工業	12,500	1,576.00	19,700,000	
名村造船所	5,100	150.00	765,000	
サノヤスホールディングス	1,900	155.00	294,500	
日本車輛製造	600	2,462.00	1,477,200	
三菱ロジスネクスト	2,100	987.00	2,072,700	
近畿車輛	200	1,302.00	260,400	
日産自動車	188,800	469.00	88,547,200	
いすゞ自動車	46,400	985.00	45,704,000	
トヨタ自動車	178,600	7,474.00	1,334,856,400	
日野自動車	20,000	945.00	18,900,000	
三菱自動車工業	59,300	202.00	11,978,600	
エフテック	1,100	598.00	657,800	
レシップホールディングス	600	562.00	337,200	
GMB	300	608.00	182,400	
ファルテック	300	596.00	178,800	
武蔵精密工業	3,600	1,473.00	5,302,800	
日産車体	3,100	956.00	2,963,600	
新明和工業	4,300	850.00	3,655,000	
極東開発工業	3,000	1,415.00	4,245,000	
トピー工業	1,300	1,142.00	1,484,600	
ティラド	600	1,336.00	801,600	
曙ブレーキ工業	8,700	146.00	1,270,200	
タチエス	2,600	1,165.00	3,029,000	

N O K	8,600	1,298.00	11,162,800	
フタバ産業	4,500	497.00	2,236,500	
K Y B	1,800	2,528.00	4,550,400	
大同メタル工業	3,100	520.00	1,612,000	
プレス工業	7,900	290.00	2,291,000	
ミクニ	2,000	299.00	598,000	
太平洋工業	3,400	1,068.00	3,631,200	
河西工業	2,200	360.00	792,000	
アイシン精機	13,200	3,325.00	43,890,000	
マツダ	47,100	658.00	30,991,800	
今仙電機製作所	1,500	841.00	1,261,500	
本田技研工業	126,000	3,055.00	384,930,000	
スズキ	31,700	5,398.00	171,116,600	
S U B A R U	49,700	2,184.00	108,544,800	
安永	800	1,113.00	890,400	
ヤマハ発動機	22,600	1,995.00	45,087,000	
T B K	1,900	461.00	875,900	
エクセディ	2,200	1,324.00	2,912,800	
豊田合成	5,200	2,926.00	15,215,200	
愛三工業	2,500	486.00	1,215,000	
盟和産業	200	871.00	174,200	
日本プラスト	1,300	460.00	598,000	
ヨロズ	1,500	1,275.00	1,912,500	
エフ・シー・シー	2,600	2,140.00	5,564,000	
シマノ	6,000	23,105.00	138,630,000	
テイ・エス テック	3,700	3,120.00	11,544,000	
ジャムコ	800	674.00	539,200	
テルモ	45,300	4,465.00	202,264,500	
クリエートメディック	500	1,019.00	509,500	
日機装	5,200	1,010.00	5,252,000	
日本エム・ディ・エム	900	2,205.00	1,984,500	
島津製作所	19,100	3,585.00	68,473,500	
J M S	1,400	826.00	1,156,400	
クボテック	400	334.00	133,600	
長野計器	1,200	811.00	973,200	
ブイ・テクノロジー	700	5,660.00	3,962,000	

東京計器	1,000	923.00	923,000	
愛知時計電機	200	4,520.00	904,000	
インターアクション	900	1,766.00	1,589,400	
オーバル	1,400	230.00	322,000	
東京精密	2,900	4,435.00	12,861,500	
マニー	6,400	2,782.00	17,804,800	
ニコン	24,400	731.00	17,836,400	
トプコン	8,100	1,323.00	10,716,300	
オリンパス	88,600	2,204.00	195,274,400	
理研計器	1,400	3,050.00	4,270,000	
タムロン	1,300	1,614.00	2,098,200	
HOYA	31,800	12,715.00	404,337,000	
シード	700	638.00	446,600	
ノーリツ鋼機	1,100	2,255.00	2,480,500	
エー・アンド・デイ	1,500	803.00	1,204,500	
朝日インテック	18,100	3,325.00	60,182,500	
シチズン時計	18,700	293.00	5,479,100	
リズム	500	655.00	327,500	
大研医器	1,100	535.00	588,500	
メニコン	2,300	7,500.00	17,250,000	
シンシア	200	405.00	81,000	
松風	700	1,578.00	1,104,600	
セイコーホールディングス	2,300	1,447.00	3,328,100	
ニプロ	11,100	1,165.00	12,931,500	
中本パックス	400	1,549.00	619,600	
スノーピーク	900	1,801.00	1,620,900	
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,435.00	7,539,500	
トランザクション	900	950.00	855,000	
粧美堂	500	388.00	194,000	
ニホンフラッシュ	1,500	1,337.00	2,005,500	
前田工織	1,800	2,907.00	5,232,600	
永大産業	2,100	291.00	611,100	
アートネイチャー	1,700	673.00	1,144,100	
バンダイナムコホールディングス	16,500	8,766.00	144,639,000	
アイフィスジャパン	400	738.00	295,200	
共立印刷	2,600	125.00	325,000	

S H O E I	1,400	3,560.00	4,984,000
フランスベッドホールディングス	2,300	906.00	2,083,800
パイロットコーポレーション	2,800	3,070.00	8,596,000
萩原工業	900	1,594.00	1,434,600
トッパン・フォームズ	3,400	1,028.00	3,495,200
フジシールインターナショナル	3,600	2,046.00	7,365,600
タカラトミー	7,200	952.00	6,854,400
廣濟堂	1,100	666.00	732,600
エステールホールディングス	400	608.00	243,200
タカノ	600	612.00	367,200
プロネクサス	1,400	1,146.00	1,604,400
ホクシン	900	116.00	104,400
ウッドワン	500	1,203.00	601,500
大建工業	1,100	2,031.00	2,234,100
凸版印刷	22,600	1,459.00	32,973,400
大日本印刷	20,900	2,004.00	41,883,600
共同印刷	500	2,920.00	1,460,000
N I S S H A	3,300	1,326.00	4,375,800
光村印刷	100	1,700.00	170,000
T A K A R A & C O M P A N Y	800	2,031.00	1,624,800
アシックス	14,200	1,756.00	24,935,200
ツツミ	500	2,295.00	1,147,500
小松ウオール工業	500	1,731.00	865,500
ヤマハ	9,500	5,880.00	55,860,000
河合楽器製作所	500	2,722.00	1,361,000
クリナップ	1,500	456.00	684,000
ピジョン	10,300	4,750.00	48,925,000
オリバー	300	2,431.00	729,300
兼松サステック	100	1,610.00	161,000
キングジム	1,300	917.00	1,192,100
リンテック	3,800	2,287.00	8,690,600
イトーキ	3,200	337.00	1,078,400
任天堂	9,800	53,440.00	523,712,000
三菱鉛筆	2,600	1,532.00	3,983,200
タカラスタANDARD	3,300	1,499.00	4,946,700
コクヨ	7,700	1,392.00	10,718,400

ナカバヤシ	1,600	620.00	992,000	
グローブライド	700	4,075.00	2,852,500	
オカムラ	5,600	883.00	4,944,800	
美津濃	1,500	1,906.00	2,859,000	
東京電力ホールディングス	127,800	297.00	37,956,600	
中部電力	49,000	1,268.50	62,156,500	
関西電力	60,700	997.80	60,566,460	
中国電力	23,100	1,394.00	32,201,400	
北陸電力	14,600	798.00	11,650,800	
東北電力	40,000	947.00	37,880,000	
四国電力	14,400	798.00	11,491,200	
九州電力	33,000	928.00	30,624,000	
北海道電力	15,000	419.00	6,285,000	
沖縄電力	3,100	1,593.00	4,938,300	
電源開発	12,700	1,513.00	19,215,100	
エフオン	900	952.00	856,800	
イーレックス	2,300	1,443.00	3,318,900	
レノバ	2,700	2,336.00	6,307,200	
東京瓦斯	30,800	2,595.00	79,926,000	
大阪瓦斯	31,100	2,191.00	68,140,100	
東邦瓦斯	7,900	6,330.00	50,007,000	
北海道瓦斯	900	1,579.00	1,421,100	
広島ガス	3,300	391.00	1,290,300	
西部瓦斯	1,800	3,130.00	5,634,000	
静岡ガス	4,500	989.00	4,450,500	
メタウォーター	1,500	2,420.00	3,630,000	
SBSホールディングス	1,200	2,419.00	2,902,800	
東武鉄道	16,700	3,465.00	57,865,500	
相鉄ホールディングス	5,100	2,756.00	14,055,600	
東急	40,400	1,379.00	55,711,600	
京浜急行電鉄	20,600	1,756.00	36,173,600	
小田急電鉄	23,800	3,040.00	72,352,000	
京王電鉄	8,300	7,570.00	62,831,000	
京成電鉄	11,100	3,720.00	41,292,000	
富士急行	2,200	4,980.00	10,956,000	
新京成電鉄	400	2,250.00	900,000	



東日本旅客鉄道	28,200	6,260.00	176,532,000	
西日本旅客鉄道	14,100	4,928.00	69,484,800	
東海旅客鉄道	13,300	14,150.00	188,195,000	
西武ホールディングス	20,900	1,202.00	25,121,800	
鴻池運輸	2,500	1,095.00	2,737,500	
西日本鉄道	4,400	3,130.00	13,772,000	
ハマキョウレックス	1,200	3,100.00	3,720,000	
サカイ引越センター	800	5,220.00	4,176,000	
近鉄グループホールディングス	15,200	4,705.00	71,516,000	
阪急阪神ホールディングス	20,200	3,665.00	74,033,000	
南海電気鉄道	7,200	2,698.00	19,425,600	
京阪ホールディングス	6,800	4,585.00	31,178,000	
神戸電鉄	400	3,765.00	1,506,000	
名古屋鉄道	12,500	3,085.00	38,562,500	
山陽電気鉄道	1,100	2,211.00	2,432,100	
日本通運	5,200	7,250.00	37,700,000	
ヤマトホールディングス	26,600	2,564.00	68,202,400	
山九	4,200	4,030.00	16,926,000	
丸運	900	265.00	238,500	
丸全昭和運輸	1,200	3,215.00	3,858,000	
センコーグループホールディングス	8,400	997.00	8,374,800	
トナミホールディングス	400	6,250.00	2,500,000	
ニッコンホールディングス	5,400	2,026.00	10,940,400	
日本石油輸送	200	2,620.00	524,000	
福山通運	1,900	4,840.00	9,196,000	
セイノーホールディングス	11,400	1,500.00	17,100,000	
エスライン	500	985.00	492,500	
神奈川中央交通	400	3,960.00	1,584,000	
日立物流	2,800	3,410.00	9,548,000	
丸和運輸機関	1,600	4,380.00	7,008,000	
C & F ロジホールディングス	1,500	1,859.00	2,788,500	
九州旅客鉄道	13,300	2,331.00	31,002,300	
S Gホールディングス	31,800	2,569.00	81,694,200	
日本郵船	12,700	2,138.00	27,152,600	
商船三井	9,600	2,650.00	25,440,000	
川崎汽船	4,700	1,578.00	7,416,600	

N S ユナイテッド海運	800	1,374.00	1,099,200
明治海運	1,600	434.00	694,400
飯野海運	7,200	390.00	2,808,000
共栄タンカー	300	775.00	232,500
乾汽船	900	957.00	861,300
日本航空	26,800	1,938.00	51,938,400
A N A ホールディングス	27,700	2,545.50	70,510,350
パスコ	300	1,290.00	387,000
ランコム	400	8,180.00	3,272,000
日新	1,300	1,433.00	1,862,900
三菱倉庫	4,800	3,130.00	15,024,000
三井倉庫ホールディングス	1,700	1,974.00	3,355,800
住友倉庫	5,500	1,371.00	7,540,500
澁澤倉庫	800	2,349.00	1,879,200
東陽倉庫	2,700	349.00	942,300
日本トランスシティ	3,300	590.00	1,947,000
ケイヒン	300	1,398.00	419,400
中央倉庫	900	1,215.00	1,093,500
川西倉庫	300	1,104.00	331,200
安田倉庫	1,200	976.00	1,171,200
ファイズホールディングス	300	1,040.00	312,000
東洋埠頭	500	1,468.00	734,000
宇徳	1,300	499.00	648,700
上組	8,500	1,875.00	15,937,500
サンリツ	400	670.00	268,000
キムラユニティー	400	1,061.00	424,400
キューソー流通システム	400	1,762.00	704,800
近鉄エクスプレス	3,200	2,242.00	7,174,400
東海運	800	306.00	244,800
エーアイティー	1,100	1,011.00	1,112,100
内外トランスライン	500	1,232.00	616,000
日本コンセプト	500	1,776.00	888,000
N E C ネットズエスアイ	4,500	1,881.00	8,464,500
クロスキャット	400	1,354.00	541,600
システナ	5,600	2,074.00	11,614,400
デジタルアーツ	800	9,230.00	7,384,000

日鉄ソリューションズ	2,400	3,120.00	7,488,000	
キューブシステム	800	1,457.00	1,165,600	
エイジア	300	2,074.00	622,200	
コア	700	1,379.00	965,300	
ラクーンホールディングス	800	2,111.00	1,688,800	
ソリトンシステムズ	800	2,120.00	1,696,000	
ソフトクリエイティブホールディングス	700	3,575.00	2,502,500	
T I S	15,700	2,056.00	32,279,200	
J N Sホールディングス	600	629.00	377,400	
電算システム	600	3,215.00	1,929,000	
グリー	9,600	571.00	5,481,600	
コーエーテクモホールディングス	3,200	5,080.00	16,256,000	
三菱総合研究所	700	4,350.00	3,045,000	
ボルテージ	400	563.00	225,200	
電算	200	2,391.00	478,200	
A G S	900	917.00	825,300	
ファインデックス	1,300	1,273.00	1,654,900	
ブレインパッド	400	4,075.00	1,630,000	
K L a b	2,900	985.00	2,856,500	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,900	936.00	1,778,400	
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,824.00	564,800	
ネクソン	39,600	2,530.00	100,188,000	
アイスタイル	4,400	476.00	2,094,400	
エムアップホールディングス	500	2,495.00	1,247,500	
エイチーム	1,100	926.00	1,018,600	
エニグモ	1,500	1,290.00	1,935,000	
テクノスジャパン	1,200	741.00	889,200	
e n i s h	800	524.00	419,200	
コロプラ	5,200	931.00	4,841,200	
オルトプラス	1,000	445.00	445,000	
ブロードリーフ	7,800	620.00	4,836,000	
クロス・マーケティンググループ	700	376.00	263,200	
デジタルハーツホールディングス	800	1,108.00	886,400	
システム情報	1,200	1,168.00	1,401,600	
メディアドゥ	500	6,910.00	3,455,000	

じげん	3,900	338.00	1,318,200	
ブイキューブ	800	2,591.00	2,072,800	
エンカレッジ・テクノロジー	300	821.00	246,300	
サイバーリンクス	300	4,950.00	1,485,000	
ディー・エル・イー	1,300	354.00	460,200	
フィックスターズ	1,700	1,015.00	1,725,500	
CARTA HOLDINGS	600	1,345.00	807,000	
オブティム	800	3,060.00	2,448,000	
セレス	500	2,036.00	1,018,000	
SHIFT	700	14,180.00	9,926,000	
ティーガイア	1,400	1,831.00	2,563,400	
セック	200	3,010.00	602,000	
日本アジアグループ	1,600	649.00	1,038,400	
テクマトリックス	2,200	1,935.00	4,257,000	
プロシップ	500	1,549.00	774,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,454.00	9,325,200	
GMOペイメントゲートウェイ	3,300	12,800.00	42,240,000	
ザッパラス	700	466.00	326,200	
システムリサーチ	400	1,589.00	635,600	
インターネットイニシアティブ	2,300	5,100.00	11,730,000	
さくらインターネット	1,700	749.00	1,273,300	
ヴィンクス	400	1,227.00	490,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	10,210.00	3,063,000	
SRAホールディングス	800	2,447.00	1,957,600	
システムインテグレータ	500	710.00	355,000	
朝日ネット	1,100	912.00	1,003,200	
eBASE	1,900	989.00	1,879,100	
アバント	1,500	1,056.00	1,584,000	
アドソル日進	600	2,757.00	1,654,200	
フリービット	800	903.00	722,400	
コムチュア	1,800	2,983.00	5,369,400	
サイバーコム	300	1,777.00	533,100	
アステリア	1,000	964.00	964,000	
アイル	900	1,383.00	1,244,700	
マークライنز	700	2,346.00	1,642,200	
メディカル・データ・ビジョン	1,800	2,564.00	4,615,200	

g u m i	2,000	838.00	1,676,000	
ショーケース	300	846.00	253,800	
モバイルファクトリー	400	1,008.00	403,200	
テラスカイ	600	4,720.00	2,832,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,401.00	840,600	
P C Iホールディングス	600	1,307.00	784,200	
パイブドHD	200	1,673.00	334,600	
アイビーシー	300	1,073.00	321,900	
ネオジャパン	300	2,449.00	734,700	
P R T I M E S	300	3,295.00	988,500	
ランドコンピュータ	200	1,121.00	224,200	
ダブルスタンダード	200	4,565.00	913,000	
オープンドア	800	1,167.00	933,600	
マイネット	500	1,009.00	504,500	
アカツキ	600	4,765.00	2,859,000	
ベネフィットジャパン	100	2,269.00	226,900	
U b i c o mホールディングス	400	3,270.00	1,308,000	
L I N E	3,600	5,370.00	19,332,000	
カナミックネットワーク	1,400	788.00	1,103,200	
ノムラシステムコーポレーション	700	420.00	294,000	
チェンジ	1,100	9,640.00	10,604,000	
シンクロ・フード	700	307.00	214,900	
オークネット	800	1,382.00	1,105,600	
セグエグループ	400	1,393.00	557,200	
エイトレッド	300	2,693.00	807,900	
A O I T Y O H o l d i n g s	1,600	420.00	672,000	
マクロミル	3,200	662.00	2,118,400	
ビーグリー	300	1,759.00	527,700	
オロ	500	3,280.00	1,640,000	
ユーザーローカル	200	4,025.00	805,000	
テモナ	300	1,385.00	415,500	
ニーズウェル	300	932.00	279,600	
サインポスト	300	973.00	291,900	
ソルクシーズ	600	1,084.00	650,400	
フェイス	500	789.00	394,500	

プロトコーポレーション	1,400	1,079.00	1,510,600	
ハイマックス	400	1,156.00	462,400	
野村総合研究所	22,300	3,430.00	76,489,000	
サイバネットシステム	1,100	857.00	942,700	
C Eホールディングス	800	679.00	543,200	
日本システム技術	300	1,548.00	464,400	
インテージホールディングス	2,000	1,072.00	2,144,000	
東邦システムサイエンス	400	920.00	368,000	
ソースネクスト	7,400	323.00	2,390,200	
インフォコム	1,700	3,565.00	6,060,500	
HEROZ	200	2,989.00	597,800	
ラクスル	1,300	5,430.00	7,059,000	
F I G	1,700	272.00	462,400	
システムサポート	400	1,559.00	623,600	
イーソル	900	1,493.00	1,343,700	
アルテリア・ネットワークス	1,700	1,605.00	2,728,500	
東海ソフト	100	1,110.00	111,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,484.00	445,200	
東名	100	1,296.00	129,600	
ヴィッツ	100	2,859.00	285,900	
トピラシステムズ	200	1,651.00	330,200	
L i n k - U	100	1,656.00	165,600	
フォーカスシステムズ	1,000	930.00	930,000	
クレスコ	1,000	1,263.00	1,263,000	
フジ・メディア・ホールディングス	15,100	1,069.00	16,141,900	
オービック	5,400	20,410.00	110,214,000	
ジャストシステム	2,600	7,300.00	18,980,000	
T D Cソフト	1,400	1,054.00	1,475,600	
Zホールディングス	215,700	584.90	126,162,930	
トレンドマイクロ	8,400	5,600.00	47,040,000	
I Dホールディングス	600	1,257.00	754,200	
日本オラクル	3,200	11,250.00	36,000,000	
アルファシステムズ	500	3,400.00	1,700,000	
フューチャー	1,900	1,704.00	3,237,600	
C A C Holdings	1,000	1,422.00	1,422,000	

S Bテクノロジー	600	3,580.00	2,148,000	
トーセ	400	886.00	354,400	
オービックビジネスコンサルタント	1,600	6,530.00	10,448,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,200	3,685.00	26,532,000	
アイティフォー	1,900	904.00	1,717,600	
東計電算	200	4,335.00	867,000	
エクスネット	200	998.00	199,600	
大塚商会	8,500	4,855.00	41,267,500	
サイボウズ	1,800	2,878.00	5,180,400	
ソフトブレーン	1,200	867.00	1,040,400	
電通国際情報サービス	1,000	6,070.00	6,070,000	
A C C E S S	1,500	795.00	1,192,500	
デジタルガレージ	2,800	4,190.00	11,732,000	
E Mシステムズ	2,200	805.00	1,771,000	
ウェザーニューズ	500	5,910.00	2,955,000	
C I J	1,100	996.00	1,095,600	
ビジネスエンジニアリング	200	3,580.00	716,000	
日本エンタープライズ	1,600	225.00	360,000	
WOWOW	800	2,854.00	2,283,200	
スカラ	1,000	920.00	920,000	
インテリジェント ウェイブ	900	710.00	639,000	
I M A G I C A G R O U P	1,300	423.00	549,900	
ネットワンシステムズ	6,000	3,430.00	20,580,000	
システムソフト	3,300	92.00	303,600	
アルゴグラフィックス	1,300	3,295.00	4,283,500	
マーベラス	2,400	875.00	2,100,000	
エイベックス	2,700	1,010.00	2,727,000	
日本ユニシス	4,900	3,655.00	17,909,500	
兼松エレクトロニクス	900	4,445.00	4,000,500	
都築電気	500	1,602.00	801,000	
T B S ホールディングス	9,600	1,808.00	17,356,800	
日本テレビホールディングス	13,100	1,201.00	15,733,100	
朝日放送グループホールディングス	1,600	709.00	1,134,400	
テレビ朝日ホールディングス	4,300	1,751.00	7,529,300	
スカパーJ S A Tホールディングス	10,300	489.00	5,036,700	
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,499.00	3,248,700	

日本BS放送	500	1,081.00	540,500
ビジョン	1,900	1,095.00	2,080,500
スマートバリュー	400	1,017.00	406,800
USEN-NEXT HOLDINGS	600	1,289.00	773,400
ワイヤレスゲート	600	642.00	385,200
コネクシオ	900	1,216.00	1,094,400
日本通信	12,200	208.00	2,537,600
クロップス	300	818.00	245,400
日本電信電話	210,000	2,482.50	521,325,000
KDDI	114,500	3,150.00	360,675,000
ソフトバンク	142,800	1,265.50	180,713,400
光通信	1,600	25,820.00	41,312,000
NTTドコモ	112,300	3,894.00	437,296,200
エムティーアイ	1,500	815.00	1,222,500
GMOインターネット	5,600	2,785.00	15,596,000
ファイバーゲート	500	2,088.00	1,044,000
アйдママーケティングコミュニケーション	500	393.00	196,500
KADOKAWA	4,200	3,240.00	13,608,000
学研ホールディングス	2,100	1,556.00	3,267,600
ゼンリン	3,100	1,286.00	3,986,600
昭文社ホールディングス	700	494.00	345,800
インプレスホールディングス	1,200	174.00	208,800
アイネット	800	1,518.00	1,214,400
松竹	1,000	13,520.00	13,520,000
東宝	9,300	4,450.00	41,385,000
東映	600	17,030.00	10,218,000
エヌ・ティ・ティ・データ	41,800	1,382.00	57,767,600
ピー・シー・エー	300	4,665.00	1,399,500
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,429.00	714,500
DTS	3,500	2,294.00	8,029,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,700	5,490.00	36,783,000
シーイーシー	1,700	1,527.00	2,595,900
カプコン	7,400	5,150.00	38,110,000
アイ・エス・ピー	400	2,642.00	1,056,800
ジャステック	1,000	1,507.00	1,507,000
SSK	3,600	6,060.00	21,816,000



日本システムウエア	500	2,130.00	1,065,000	
アイネス	1,500	1,486.00	2,229,000	
T K C	1,300	6,770.00	8,801,000	
富士ソフト	1,700	5,540.00	9,418,000	
N S D	5,000	1,988.00	9,940,000	
コナミホールディングス	5,700	5,230.00	29,811,000	
福井コンピュータホールディングス	600	3,545.00	2,127,000	
J B C Cホールディングス	1,100	1,492.00	1,641,200	
ミロク情報サービス	1,400	2,164.00	3,029,600	
ソフトバンクグループ	124,600	6,789.00	845,909,400	
ハウスイ	100	1,006.00	100,600	
高千穂交易	600	977.00	586,200	
カワニシホールディングス	200	1,392.00	278,400	
伊藤忠食品	400	5,440.00	2,176,000	
エレマテック	1,500	983.00	1,474,500	
J A L U X	400	1,381.00	552,400	
あらた	1,300	4,895.00	6,363,500	
トーメンデバイス	200	3,690.00	738,000	
東京エレクトロン デバイス	600	3,170.00	1,902,000	
フィールズ	1,200	365.00	438,000	
双日	87,100	238.00	20,729,800	
アルフレッサ ホールディングス	17,500	2,079.00	36,382,500	
横浜冷凍	4,100	903.00	3,702,300	
神栄	200	665.00	133,000	
ラサ商事	800	905.00	724,000	
アルコニックス	1,700	1,392.00	2,366,400	
神戸物産	10,900	3,185.00	34,716,500	
ハイパー	200	574.00	114,800	
あい ホールディングス	2,300	2,009.00	4,620,700	
ディーブイエックス	600	1,074.00	644,400	
ダイワボウホールディングス	1,300	6,330.00	8,229,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,800	2,021.00	7,679,800	
ラクト・ジャパン	700	3,005.00	2,103,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,000	919.00	2,757,000	
八洲電機	1,200	938.00	1,125,600	
メディアスホールディングス	900	910.00	819,000	

レスターホールディングス	1,600	2,291.00	3,665,600	
ジュテックホールディングス	400	1,013.00	405,200	
大光	700	714.00	499,800	
OCHIホールディングス	500	1,327.00	663,500	
TOKAIホールディングス	8,300	1,072.00	8,897,600	
黒谷	400	595.00	238,000	
Cominix	300	720.00	216,000	
三洋貿易	1,600	980.00	1,568,000	
ビューティガレージ	300	2,906.00	871,800	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,173.00	1,290,300	
ミタチ産業	500	640.00	320,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,500	5,220.00	13,050,000	
明治電機工業	500	1,382.00	691,000	
デリカフーズホールディングス	600	609.00	365,400	
スターティアホールディングス	400	756.00	302,400	
コメダホールディングス	3,400	1,867.00	6,347,800	
ピーバンドットコム	200	908.00	181,600	
アセンテック	300	2,013.00	603,900	
富士興産	500	878.00	439,000	
協栄産業	200	1,316.00	263,200	
小野建	1,400	1,290.00	1,806,000	
南陽	300	1,769.00	530,700	
佐島電機	1,100	836.00	919,600	
エコートレーディング	400	609.00	243,600	
伯東	1,000	1,087.00	1,087,000	
コンドーテック	1,200	1,056.00	1,267,200	
中山福	900	514.00	462,600	
ナガイレーベン	2,100	2,780.00	5,838,000	
三菱食品	1,700	2,871.00	4,880,700	
松田産業	1,100	1,661.00	1,827,100	
第一興商	2,300	3,490.00	8,027,000	
メディバルホールディングス	17,000	1,961.00	33,337,000	
SPK	700	1,306.00	914,200	
萩原電気ホールディングス	600	2,474.00	1,484,400	
アズワン	1,000	14,790.00	14,790,000	
スズデン	500	1,200.00	600,000	

尾家産業	500	1,460.00	730,000
シモジマ	1,000	1,430.00	1,430,000
ドウシシャ	1,500	1,924.00	2,886,000
小津産業	300	1,884.00	565,200
高速	900	1,592.00	1,432,800
たけびし	600	1,475.00	885,000
リックス	400	1,641.00	656,400
丸文	1,400	490.00	686,000
ハビネット	1,300	1,470.00	1,911,000
橋本総業ホールディングス	300	2,398.00	719,400
日本ライフライン	4,700	1,399.00	6,575,300
タカショー	1,000	724.00	724,000
マルカ	500	2,235.00	1,117,500
I D O M	4,200	619.00	2,599,800
進和	900	2,041.00	1,836,900
エスケイジャパン	300	470.00	141,000
ダイトロン	700	1,401.00	980,700
シークス	2,000	1,495.00	2,990,000
田中商事	500	712.00	356,000
オーハシテクニカ	800	1,459.00	1,167,200
白銅	600	1,365.00	819,000
ダイコー通産	100	1,421.00	142,100
伊藤忠商事	110,300	2,709.50	298,857,850
丸紅	164,100	610.40	100,166,640
高島	200	1,726.00	345,200
長瀬産業	8,900	1,418.00	12,620,200
蝶理	1,000	1,633.00	1,633,000
豊田通商	17,600	3,455.00	60,808,000
三共生興	2,400	424.00	1,017,600
兼松	5,900	1,283.00	7,569,700
ツカモトコーポレーション	300	1,326.00	397,800
三井物産	136,500	1,832.00	250,068,000
日本紙パルプ商事	900	3,860.00	3,474,000
カメイ	2,100	1,188.00	2,494,800
東都水産	200	4,540.00	908,000
O U Gホールディングス	200	2,889.00	577,800

スターゼン	600	4,315.00	2,589,000	
山善	6,200	1,060.00	6,572,000	
椿本興業	300	3,600.00	1,080,000	
住友商事	99,500	1,309.00	130,245,500	
内田洋行	600	5,290.00	3,174,000	
三菱商事	103,400	2,496.00	258,086,400	
第一実業	800	3,980.00	3,184,000	
キャノンマーケティングジャパン	3,900	2,294.00	8,946,600	
西華産業	900	1,285.00	1,156,500	
佐藤商事	1,300	1,050.00	1,365,000	
菱洋エレクトロ	1,600	3,000.00	4,800,000	
東京産業	1,400	548.00	767,200	
ユアサ商事	1,500	3,085.00	4,627,500	
神鋼商事	400	1,921.00	768,400	
トルク	900	298.00	268,200	
阪和興業	2,900	2,402.00	6,965,800	
正栄食品工業	1,000	3,875.00	3,875,000	
カナデン	1,300	1,293.00	1,680,900	
菱電商事	1,100	1,547.00	1,701,700	
フルサト工業	900	1,335.00	1,201,500	
岩谷産業	3,700	5,120.00	18,944,000	
ナイス	700	1,490.00	1,043,000	
昭光通商	500	598.00	299,000	
ニチモウ	200	1,944.00	388,800	
極東貿易	500	1,459.00	729,500	
イワキ	2,100	539.00	1,131,900	
三愛石油	3,900	1,182.00	4,609,800	
稲畑産業	3,500	1,393.00	4,875,500	
G S Iクレオス	400	1,837.00	734,800	
明和産業	1,500	399.00	598,500	
クワザワホールディングス	600	563.00	337,800	
ヤマエ久野	1,100	1,259.00	1,384,900	
ワキタ	3,400	1,180.00	4,012,000	
東邦ホールディングス	5,100	2,019.00	10,296,900	
サンゲツ	4,300	1,574.00	6,768,200	
ミツウロコグループホールディングス	2,300	1,327.00	3,052,100	

シナネンホールディングス	600	3,115.00	1,869,000	
伊藤忠エネクス	3,500	981.00	3,433,500	
サンリオ	4,400	1,752.00	7,708,800	
サンワテクノス	1,100	914.00	1,005,400	
リョーサン	1,700	2,015.00	3,425,500	
新光商事	2,400	878.00	2,107,200	
トーヨー	700	2,015.00	1,410,500	
三信電気	800	2,177.00	1,741,600	
東陽テクニカ	1,700	1,109.00	1,885,300	
モスフードサービス	2,100	2,795.00	5,869,500	
加賀電子	1,600	2,057.00	3,291,200	
ソーダニッカ	1,600	571.00	913,600	
立花エレテック	1,200	1,779.00	2,134,800	
フォーバル	700	951.00	665,700	
PALTA C	2,500	5,650.00	14,125,000	
三谷産業	2,100	437.00	917,700	
太平洋興発	600	641.00	384,600	
西本Wismettacホールディングス	400	2,201.00	880,400	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,447.00	144,700	
コア商事ホールディングス	300	1,660.00	498,000	
国際紙パルプ商事	3,700	245.00	906,500	
ヤマタネ	800	1,384.00	1,107,200	
丸紅建材リース	200	1,742.00	348,400	
日鉄物産	1,100	3,205.00	3,525,500	
泉州電業	400	2,897.00	1,158,800	
トラスコ中山	3,600	2,801.00	10,083,600	
オートバックスセブン	5,800	1,340.00	7,772,000	
モリト	1,100	613.00	674,300	
加藤産業	2,300	3,705.00	8,521,500	
北恵	400	995.00	398,000	
イノテック	800	924.00	739,200	
イエローハット	3,000	1,655.00	4,965,000	
J Kホールディングス	1,400	830.00	1,162,000	
日伝	1,400	2,401.00	3,361,400	
北沢産業	1,200	281.00	337,200	
杉本商事	800	2,280.00	1,824,000	

因幡電機産業	4,500	2,578.00	11,601,000	
東テク	500	2,560.00	1,280,000	
ミスミグループ本社	19,800	3,360.00	66,528,000	
アルテック	1,100	305.00	335,500	
タキヒヨー	500	1,898.00	949,000	
蔵王産業	300	1,380.00	414,000	
スズケン	6,700	3,875.00	25,962,500	
ジェコス	1,100	995.00	1,094,500	
グローセル	1,600	416.00	665,600	
ローソン	4,000	5,110.00	20,440,000	
サンエー	1,300	4,270.00	5,551,000	
カワチ薬品	1,200	3,260.00	3,912,000	
エービーシー・マート	2,500	6,110.00	15,275,000	
ハードオフコーポレーション	600	670.00	402,000	
アスクル	1,600	4,000.00	6,400,000	
ゲオホールディングス	2,800	1,395.00	3,906,000	
アダストリア	2,200	1,811.00	3,984,200	
ジーフット	1,000	448.00	448,000	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	439.00	87,800	
くら寿司	900	6,090.00	5,481,000	
キャンドウ	800	1,971.00	1,576,800	
パルグループホールディングス	1,600	1,223.00	1,956,800	
エディオン	7,200	1,005.00	7,236,000	
サーラコーポレーション	3,200	602.00	1,926,400	
ワッツ	700	802.00	561,400	
ハローズ	600	3,545.00	2,127,000	
フジオフードグループ本社	1,300	1,414.00	1,838,200	
あみやき亭	300	2,950.00	885,000	
ひらまつ	2,900	200.00	580,000	
大黒天物産	400	5,760.00	2,304,000	
ハニーズホールディングス	1,400	996.00	1,394,400	
ファーマライズホールディングス	400	801.00	320,400	
アルペン	1,200	2,507.00	3,008,400	
ハブ	400	608.00	243,200	
クオールホールディングス	2,300	1,132.00	2,603,600	
ジーンズホールディングス	800	7,390.00	5,912,000	

ビックカメラ	9,400	1,171.00	11,007,400	
D C Mホールディングス	9,600	1,240.00	11,904,000	
ペッパーフードサービス	1,500	268.00	402,000	
M o n o t a R O	11,200	5,510.00	61,712,000	
東京一番フーズ	400	581.00	232,400	
D Dホールディングス	600	681.00	408,600	
きちりホールディングス	400	689.00	275,600	
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,056.00	2,672,800	
J . フロント リテイリング	18,800	878.00	16,506,400	
ドトール・日レスホールディングス	2,300	1,535.00	3,530,500	
マツモトキヨシホールディングス	6,500	4,765.00	30,972,500	
ブロンコピリー	800	2,403.00	1,922,400	
Z O Z O	10,800	2,695.00	29,106,000	
トレジャー・ファクトリー	500	716.00	358,000	
物語コーポレーション	400	13,380.00	5,352,000	
ココカラファイン	1,600	7,330.00	11,728,000	
三越伊勢丹ホールディングス	27,600	599.00	16,532,400	
H a m e e	600	1,693.00	1,015,800	
ウエルシアホールディングス	9,400	4,305.00	40,467,000	
クリエイトS Dホールディングス	2,700	3,685.00	9,949,500	
丸善C H Iホールディングス	1,800	376.00	676,800	
ミサワ	300	788.00	236,400	
ティーライフ	200	1,205.00	241,000	
エー・ピーホールディングス	300	420.00	126,000	
チムニー	500	1,326.00	663,000	
シュッピン	1,100	856.00	941,600	
オイシックス・ラ・大地	1,600	3,155.00	5,048,000	
ネクステージ	2,600	1,326.00	3,447,600	
ジョイフル本田	4,600	1,540.00	7,084,000	
鳥貴族	500	1,431.00	715,500	
麒麟堂ホールディングス	600	3,485.00	2,091,000	
ホットランド	1,200	1,269.00	1,522,800	
すかいらーくホールディングス	17,700	1,648.00	29,169,600	
S F Pホールディングス	900	1,323.00	1,190,700	
綿半ホールディングス	1,200	1,459.00	1,750,800	
ヨシックス	300	1,750.00	525,000	

ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,600	1,130.00	5,198,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	1,099.00	879,200
B E E N O S	700	2,462.00	1,723,400
あさひ	1,200	1,585.00	1,902,000
日本調剤	1,000	1,690.00	1,690,000
コスモス薬品	1,400	17,760.00	24,864,000
トーエル	800	810.00	648,000
オンリー	300	483.00	144,900
セブン&アイ・ホールディングス	61,700	3,357.00	207,126,900
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,500	597.00	5,074,500
ツルハホールディングス	3,400	15,390.00	52,326,000
サンマルクホールディングス	1,200	1,516.00	1,819,200
フェリシモ	300	1,314.00	394,200
トリドールホールディングス	3,900	1,432.00	5,584,800
T O K Y O B A S E	1,400	479.00	670,600
ウイルプラスホールディングス	200	647.00	129,400
J Mホールディングス	1,200	2,311.00	2,773,200
サツドラホールディングス	200	2,049.00	409,800
アレンザホールディングス	800	1,402.00	1,121,600
串カツ田中ホールディングス	400	1,705.00	682,000
パロックジャパンリミテッド	1,100	658.00	723,800
クスリのアオキホールディングス	1,400	8,840.00	12,376,000
力の源ホールディングス	700	596.00	417,200
スシローグローバルホールディングス	8,700	3,430.00	29,841,000
メディカルシステムネットワーク	1,500	700.00	1,050,000
はるやまホールディングス	700	705.00	493,500
ノジマ	2,800	3,000.00	8,400,000
カッパ・クリエイト	2,200	1,487.00	3,271,400
ライトオン	1,200	691.00	829,200
ジーンズメイト	500	283.00	141,500
良品計画	20,900	2,306.00	48,195,400
三城ホールディングス	1,700	279.00	474,300
アドヴァン	2,400	1,440.00	3,456,000
アルピス	600	2,533.00	1,519,800
コナカ	1,800	227.00	408,600



ハウス オブ ローゼ	200	1,675.00	335,000	
G - 7ホールディングス	900	2,232.00	2,008,800	
イオン北海道	2,100	910.00	1,911,000	
コジマ	2,700	735.00	1,984,500	
ヒマラヤ	600	938.00	562,800	
コーナン商事	2,200	3,445.00	7,579,000	
エコス	600	2,352.00	1,411,200	
ワタミ	1,900	1,019.00	1,936,100	
マルシェ	400	548.00	219,200	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	34,700	2,508.00	87,027,600	
西松屋チェーン	3,500	1,718.00	6,013,000	
ゼンショーホールディングス	7,600	2,806.00	21,325,600	
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,879.00	1,879,000	
ハークスレイ	300	920.00	276,000	
サイゼリヤ	2,300	1,879.00	4,321,700	
V Tホールディングス	6,500	381.00	2,476,500	
魚力	400	1,681.00	672,400	
ポブラ	400	418.00	167,200	
フジ・コーポレーション	400	2,331.00	932,400	
ユナイテッドアローズ	1,700	1,508.00	2,563,600	
ハイデイ日高	2,300	1,769.00	4,068,700	
京都きもの友禅	1,000	234.00	234,000	
コロワイド	5,200	1,643.00	8,543,600	
ピーシーデポコーポレーション	2,100	622.00	1,306,200	
壺番屋	1,100	5,410.00	5,951,000	
トップカルチャー	600	353.00	211,800	
P L A N T	400	793.00	317,200	
スギホールディングス	3,100	7,040.00	21,824,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,538.00	1,776,600	
ヴィア・ホールディングス	1,900	265.00	503,500	
スクロール	2,400	737.00	1,768,800	
ヨンドシーホールディングス	1,600	1,946.00	3,113,600	
木曽路	2,100	2,535.00	5,323,500	
S R Sホールディングス	1,900	902.00	1,713,800	
千趣会	2,800	326.00	912,800	

タカキュー	1,200	139.00	166,800	
リテールパートナーズ	2,100	1,464.00	3,074,400	
ケーヨー	3,200	765.00	2,448,000	
上新電機	1,900	2,625.00	4,987,500	
日本瓦斯	2,500	5,270.00	13,175,000	
ロイヤルホールディングス	2,800	1,890.00	5,292,000	
東天紅	100	957.00	95,700	
いなげや	2,000	1,965.00	3,930,000	
島忠	2,900	5,490.00	15,921,000	
チヨダ	1,700	955.00	1,623,500	
ライフコーポレーション	1,200	3,500.00	4,200,000	
リンガーハット	1,900	2,306.00	4,381,400	
MrMaxHD	2,200	826.00	1,817,200	
テンアライド	1,400	365.00	511,000	
AOKIホールディングス	3,200	465.00	1,488,000	
オークワ	2,500	1,417.00	3,542,500	
コメリ	2,400	2,916.00	6,998,400	
青山商事	3,300	516.00	1,702,800	
しまむら	1,800	11,320.00	20,376,000	
はせがわ	800	290.00	232,000	
高島屋	11,500	870.00	10,005,000	
松屋	3,200	768.00	2,457,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,500	678.00	5,085,000	
近鉄百貨店	600	3,445.00	2,067,000	
丸井グループ	14,500	2,072.00	30,044,000	
アクシアル リテイリング	1,300	4,755.00	6,181,500	
井筒屋	800	186.00	148,800	
イオン	60,700	3,003.00	182,282,100	
イズミ	3,200	3,700.00	11,840,000	
平和堂	3,200	2,136.00	6,835,200	
フジ	1,900	1,972.00	3,746,800	
ヤオコー	1,800	7,250.00	13,050,000	
ゼビオホールディングス	1,900	785.00	1,491,500	
ケーズホールディングス	15,200	1,337.00	20,322,400	
Olympicグループ	800	976.00	780,800	
日産東京販売ホールディングス	2,300	255.00	586,500	

シルバーライフ	200	2,030.00	406,000	
一家ダイニングプロジェクト	200	535.00	107,000	
Genky DrugStores	700	4,330.00	3,031,000	
ナルミヤ・インターナショナル	400	828.00	331,200	
ブックオフグループホールディングス	900	877.00	789,300	
ギフト	100	1,830.00	183,000	
アインホールディングス	1,900	7,930.00	15,067,000	
元気寿司	400	2,417.00	966,800	
ヤマダホールディングス	48,000	508.00	24,384,000	
アークランドサカモト	2,500	1,834.00	4,585,000	
ニトリホールディングス	6,800	21,200.00	144,160,000	
グルメ杵屋	1,100	1,015.00	1,116,500	
愛眼	1,200	230.00	276,000	
ケーユーホールディングス	800	810.00	648,000	
吉野家ホールディングス	5,200	2,043.00	10,623,600	
松屋フーズホールディングス	800	3,565.00	2,852,000	
サガミホールディングス	2,100	1,316.00	2,763,600	
関西スーパーマーケット	1,300	1,285.00	1,670,500	
王将フードサービス	1,200	6,080.00	7,296,000	
プレナス	1,800	1,719.00	3,094,200	
ミニストップ	1,200	1,427.00	1,712,400	
アークス	3,200	2,239.00	7,164,800	
パローホールディングス	3,500	2,576.00	9,016,000	
藤久	300	968.00	290,400	
ベルク	800	6,330.00	5,064,000	
大庄	800	1,096.00	876,800	
ファーストリテイリング	2,100	85,970.00	180,537,000	
サンドラッグ	5,900	4,240.00	25,016,000	
サクスパー ホールディングス	1,300	556.00	722,800	
ヤマザワ	400	1,760.00	704,000	
やまや	300	2,209.00	662,700	
ベルーナ	3,400	894.00	3,039,600	
島根銀行	400	649.00	259,600	
じもとホールディングス	1,100	1,070.00	1,177,000	
めぶきフィナンシャルグループ	82,000	234.00	19,188,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,201.00	2,522,100	

九州フィナンシャルグループ	34,500	541.00	18,664,500	
ゆうちょ銀行	44,700	928.00	41,481,600	
富山第一銀行	3,700	300.00	1,110,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	90,200	395.00	35,629,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,500	711.00	7,465,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	9,100	539.00	4,904,900	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,353.00	2,029,500	
第四北越フィナンシャルグループ	2,700	2,155.00	5,818,500	
ひろぎんホールディングス	23,300	601.00	14,003,300	
新生銀行	11,600	1,365.00	15,834,000	
あおぞら銀行	9,400	1,850.00	17,390,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,080,000	461.10	497,988,000	
りそなホールディングス	169,200	378.70	64,076,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	29,800	3,145.00	93,721,000	
三井住友フィナンシャルグループ	109,200	3,158.00	344,853,600	
千葉銀行	52,700	609.00	32,094,300	
群馬銀行	30,300	357.00	10,817,100	
武蔵野銀行	2,400	1,625.00	3,900,000	
千葉興業銀行	4,300	260.00	1,118,000	
筑波銀行	6,500	195.00	1,267,500	
七十七銀行	5,300	1,605.00	8,506,500	
青森銀行	1,200	2,454.00	2,944,800	
秋田銀行	1,000	1,502.00	1,502,000	
山形銀行	1,800	1,335.00	2,403,000	
岩手銀行	1,000	2,421.00	2,421,000	
東邦銀行	14,100	236.00	3,327,600	
東北銀行	800	1,066.00	852,800	
みちのく銀行	1,000	1,233.00	1,233,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,300	1,951.00	25,948,300	
静岡銀行	38,500	767.00	29,529,500	
十六銀行	2,000	2,059.00	4,118,000	
スルガ銀行	16,200	360.00	5,832,000	
八十二銀行	38,100	400.00	15,240,000	
山梨中央銀行	1,800	832.00	1,497,600	
大垣共立銀行	3,100	2,497.00	7,740,700	
福井銀行	1,300	1,942.00	2,524,600	

北國銀行	1,600	2,976.00	4,761,600	
清水銀行	700	1,851.00	1,295,700	
富山銀行	300	3,210.00	963,000	
滋賀銀行	3,200	2,439.00	7,804,800	
南都銀行	2,600	1,957.00	5,088,200	
百五銀行	14,200	340.00	4,828,000	
京都銀行	5,700	5,210.00	29,697,000	
紀陽銀行	5,600	1,683.00	9,424,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,500	1,049.00	11,014,500	
山陰合同銀行	9,400	564.00	5,301,600	
中国銀行	13,600	983.00	13,368,800	
鳥取銀行	500	1,198.00	599,000	
伊予銀行	22,500	713.00	16,042,500	
百十四銀行	1,700	1,702.00	2,893,400	
四国銀行	2,400	754.00	1,809,600	
阿波銀行	2,600	2,745.00	7,137,000	
大分銀行	900	2,555.00	2,299,500	
宮崎銀行	1,100	2,462.00	2,708,200	
佐賀銀行	1,000	1,417.00	1,417,000	
沖縄銀行	1,400	3,195.00	4,473,000	
琉球銀行	3,600	896.00	3,225,600	
セブン銀行	52,800	240.00	12,672,000	
みずほフィナンシャルグループ	214,500	1,409.50	302,337,750	
高知銀行	600	797.00	478,200	
山口フィナンシャルグループ	19,700	747.00	14,715,900	
長野銀行	500	1,418.00	709,000	
名古屋銀行	1,200	2,905.00	3,486,000	
北洋銀行	23,800	241.00	5,735,800	
愛知銀行	600	3,250.00	1,950,000	
中京銀行	600	2,211.00	1,326,600	
大光銀行	500	1,350.00	675,000	
愛媛銀行	2,200	1,144.00	2,516,800	
トマト銀行	600	1,085.00	651,000	
京葉銀行	6,700	496.00	3,323,200	
栃木銀行	7,600	185.00	1,406,000	
北日本銀行	500	2,059.00	1,029,500	

東和銀行	2,800	702.00	1,965,600	
福島銀行	1,500	231.00	346,500	
大東銀行	800	627.00	501,600	
トモニホールディングス	12,200	347.00	4,233,400	
フィデアホールディングス	15,300	113.00	1,728,900	
池田泉州ホールディングス	18,200	158.00	2,875,600	
F P G	4,900	499.00	2,445,100	
マーキュリアインベストメント	600	658.00	394,800	
S B Iホールディングス	18,100	2,683.00	48,562,300	
日本アジア投資	1,300	222.00	288,600	
ジャフコ グループ	2,400	4,700.00	11,280,000	
大和証券グループ本社	126,700	460.80	58,383,360	
野村ホールディングス	277,800	515.50	143,205,900	
岡三証券グループ	13,500	359.00	4,846,500	
丸三証券	4,700	482.00	2,265,400	
東洋証券	5,600	128.00	716,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,100	292.00	5,285,200	
光世証券	400	711.00	284,400	
水戸証券	4,500	227.00	1,021,500	
いちよし証券	3,000	436.00	1,308,000	
松井証券	9,000	880.00	7,920,000	
マネックスグループ	11,600	273.00	3,166,800	
極東証券	2,100	728.00	1,528,800	
岩井コスモホールディングス	1,500	1,271.00	1,906,500	
藍澤證券	2,800	717.00	2,007,600	
マネーパートナーズグループ	1,700	201.00	341,700	
スパークス・グループ	7,300	243.00	1,773,900	
小林洋行	400	270.00	108,000	
かんぽ生命保険	5,600	1,800.00	10,080,000	
S O M P Oホールディングス	29,700	4,130.00	122,661,000	
アニコム ホールディングス	5,200	1,072.00	5,574,400	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	41,300	3,149.00	130,053,700	
第一生命ホールディングス	89,300	1,701.50	151,943,950	
東京海上ホールディングス	55,800	5,276.00	294,400,800	
T & Dホールディングス	47,200	1,199.00	56,592,800	

アドバンスクリエイト	300	1,982.00	594,600	
全国保証	4,400	4,825.00	21,230,000	
ジェイリース	400	807.00	322,800	
イントラスト	600	868.00	520,800	
日本モーゲージサービス	700	1,103.00	772,100	
C a s a	600	1,283.00	769,800	
アルヒ	2,500	2,150.00	5,375,000	
プレミアグループ	900	2,065.00	1,858,500	
クレディセゾン	11,100	1,248.00	13,852,800	
芙蓉総合リース	1,700	6,340.00	10,778,000	
みずほリース	2,400	2,701.00	6,482,400	
東京センチュリー	3,200	6,500.00	20,800,000	
日本証券金融	7,000	512.00	3,584,000	
アイフル	24,100	269.00	6,482,900	
リコーリース	1,200	2,982.00	3,578,400	
イオンフィナンシャルサービス	9,700	1,170.00	11,349,000	
アコム	31,700	489.00	15,501,300	
ジャックス	1,700	1,842.00	3,131,400	
オリエントコーポレーション	42,700	119.00	5,081,300	
日立キャピタル	3,700	2,371.00	8,772,700	
オリックス	98,000	1,524.50	149,401,000	
三菱UFJリース	40,100	477.00	19,127,700	
九州リースサービス	800	616.00	492,800	
日本取引所グループ	45,300	2,394.50	108,470,850	
イー・ギャランティ	1,800	2,163.00	3,893,400	
アサックス	800	747.00	597,600	
NECキャピタルソリューション	600	1,843.00	1,105,800	
いちご	20,100	330.00	6,633,000	
日本駐車場開発	15,600	127.00	1,981,200	
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,531.00	1,224,800	
ADワークスグループ	2,900	155.00	449,500	
ヒューリック	33,500	1,044.00	34,974,000	
三栄建築設計	600	1,779.00	1,067,400	
野村不動産ホールディングス	9,600	1,984.00	19,046,400	
三重交通グループホールディングス	3,200	516.00	1,651,200	
サムティ	2,200	1,762.00	3,876,400	

ディア・ライフ	2,200	421.00	926,200	
コーセーアールイー	500	584.00	292,000	
日本商業開発	1,000	1,756.00	1,756,000	
プレサンスコーポレーション	2,600	1,750.00	4,550,000	
THEグローバル社	700	237.00	165,900	
ハウスコム	300	1,300.00	390,000	
日本管理センター	900	1,330.00	1,197,000	
サンセイランディック	500	756.00	378,000	
エストラスト	200	764.00	152,800	
フージャースホールディングス	3,100	696.00	2,157,600	
オープンハウス	5,000	4,025.00	20,125,000	
東急不動産ホールディングス	42,900	490.00	21,021,000	
飯田グループホールディングス	13,200	2,111.00	27,865,200	
イーランド	300	777.00	233,100	
ムゲンエステート	1,000	512.00	512,000	
ビーロット	700	807.00	564,900	
ファーストブラザーズ	300	981.00	294,300	
ハウストゥ	800	1,271.00	1,016,800	
シーアールイー	400	1,409.00	563,600	
プロパティエージェント	300	1,355.00	406,500	
ケイアイスター不動産	500	2,365.00	1,182,500	
アグレ都市デザイン	300	645.00	193,500	
グッドコムアセット	800	1,476.00	1,180,800	
ジェイ・エス・ビー	300	2,858.00	857,400	
テンポイノベーション	400	914.00	365,600	
グローバル・リンク・マネジメント	300	764.00	229,200	
パーク24	8,500	1,532.00	13,022,000	
パラカ	400	1,757.00	702,800	
三井不動産	76,700	2,129.50	163,332,650	
三菱地所	110,600	1,762.00	194,877,200	
平和不動産	2,900	3,210.00	9,309,000	
東京建物	15,600	1,340.00	20,904,000	
ダイビル	4,100	1,265.00	5,186,500	
京阪神ビルディング	2,500	2,130.00	5,325,000	
住友不動産	35,500	3,300.00	117,150,000	
テオーシー	3,100	639.00	1,980,900	



東京楽天地	300	4,300.00	1,290,000	
レオパレス21	20,700	168.00	3,477,600	
スターツコーポレーション	2,100	2,753.00	5,781,300	
フジ住宅	1,800	623.00	1,121,400	
空港施設	1,600	489.00	782,400	
明和地所	900	535.00	481,500	
ゴールドクレスト	1,200	1,388.00	1,665,600	
エスリード	600	1,357.00	814,200	
日神グループホールディングス	2,300	399.00	917,700	
日本エスコン	2,900	886.00	2,569,400	
タカラレーベン	7,200	298.00	2,145,600	
A V A N T I A	900	894.00	804,600	
イオンモール	7,900	1,782.00	14,077,800	
毎日コムネット	400	728.00	291,200	
ファースト住建	700	1,015.00	710,500	
ランド	84,700	9.00	762,300	
カチタス	3,900	3,130.00	12,207,000	
トーセイ	2,200	1,098.00	2,415,600	
穴吹興産	300	1,673.00	501,900	
サンフロンティア不動産	2,200	963.00	2,118,600	
エフ・ジェー・ネクスト	1,400	1,002.00	1,402,800	
インテリックス	400	550.00	220,000	
ランドビジネス	500	375.00	187,500	
サンネクスタグループ	500	984.00	492,000	
グランディハウス	1,200	375.00	450,000	
日本空港ビルデング	5,000	5,800.00	29,000,000	
明豊ファシリティワークス	700	611.00	427,700	
日本工営	1,000	2,909.00	2,909,000	
L I F U L L	5,300	395.00	2,093,500	
ミクシィ	2,900	2,908.00	8,433,200	
ジェイエシーリクルートメント	1,000	1,605.00	1,605,000	
日本M&Aセンター	11,700	6,170.00	72,189,000	
メンバーズ	500	2,121.00	1,060,500	
中広	200	492.00	98,400	
UTグループ	2,400	3,280.00	7,872,000	
アイティメディア	600	2,337.00	1,402,200	

タケエイ	1,700	1,120.00	1,904,000	
E・Jホールディングス	300	2,188.00	656,400	
ビーネックスグループ	1,900	1,061.00	2,015,900	
コシダカホールディングス	3,700	409.00	1,513,300	
アルトナー	400	924.00	369,600	
パソナグループ	1,700	1,800.00	3,060,000	
C D S	400	1,289.00	515,600	
リンクアンドモチベーション	2,800	539.00	1,509,200	
G C A	2,000	740.00	1,480,000	
エス・エム・エス	4,800	3,490.00	16,752,000	
サニーサイドアップグループ	500	678.00	339,000	
パーソルホールディングス	15,300	1,766.00	27,019,800	
リニカル	700	743.00	520,100	
クックパッド	4,800	322.00	1,545,600	
エスクリ	500	322.00	161,000	
アイ・ケイ・ケイ	700	652.00	456,400	
学情	500	1,031.00	515,500	
スタジオアリス	800	2,032.00	1,625,600	
シミックホールディングス	800	1,403.00	1,122,400	
エプコ	400	1,027.00	410,800	
N J S	400	1,922.00	768,800	
総合警備保障	6,100	5,400.00	32,940,000	
カカクコム	11,300	3,150.00	35,595,000	
アイロムグループ	500	1,889.00	944,500	
セントケア・ホールディング	1,000	805.00	805,000	
サイネックス	300	773.00	231,900	
ルネサンス	900	852.00	766,800	
ディップ	2,100	2,501.00	5,252,100	
デジタルホールディングス	1,100	1,574.00	1,731,400	
新日本科学	1,700	698.00	1,186,600	
ツクイホールディングス	3,600	620.00	2,232,000	
キャリアデザインセンター	400	1,044.00	417,600	
ベネフィット・ワン	5,600	2,925.00	16,380,000	
エムスリー	33,700	8,082.00	272,363,400	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	273.00	327,600	
プラス	200	410.00	82,000	

アウトソーシング	8,800	1,450.00	12,760,000	
ウェルネット	1,500	528.00	792,000	
ワールドホールディングス	500	2,032.00	1,016,000	
ディー・エヌ・エー	6,500	1,911.00	12,421,500	
博報堂D Yホールディングス	21,300	1,445.00	30,778,500	
ぐるなび	2,700	543.00	1,466,100	
タカミヤ	1,600	515.00	824,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	935.00	1,122,000	
ファンコミュニケーションズ	4,200	457.00	1,919,400	
ライク	500	2,291.00	1,145,500	
ビジネス・ブレークスルー	600	410.00	246,000	
エスプール	3,900	727.00	2,835,300	
WDBホールディングス	700	3,295.00	2,306,500	
手間いらず	100	5,450.00	545,000	
ティア	900	417.00	375,300	
C D G	200	1,459.00	291,800	
バリューコマース	1,000	3,190.00	3,190,000	
インフォーマート	15,500	1,095.00	16,972,500	
J Pホールディングス	4,800	292.00	1,401,600	
エコナックホールディングス	2,700	92.00	248,400	
E P Sホールディングス	2,100	988.00	2,074,800	
レッグス	400	1,553.00	621,200	
プレステージ・インターナショナル	5,700	927.00	5,283,900	
アミューズ	800	2,537.00	2,029,600	
ドリームインキュベータ	500	1,505.00	752,500	
クイック	900	1,127.00	1,014,300	
T A C	900	220.00	198,000	
ケネディクス	13,200	564.00	7,444,800	
電通グループ	17,200	3,265.00	56,158,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	575.00	345,000	
ぴあ	400	2,856.00	1,142,400	
イオンファンタジー	600	2,219.00	1,331,400	
シーティーエス	1,700	952.00	1,618,400	
ネクシィーズグループ	500	891.00	445,500	
H . U . グループホールディングス	4,300	2,845.00	12,233,500	
アルプス技研	1,400	2,012.00	2,816,800	

サニックス	2,700	251.00	677,700
ダイオーズ	300	979.00	293,700
日本空調サービス	1,600	775.00	1,240,000
オリエンタルランド	16,300	17,160.00	279,708,000
ダスキン	3,800	2,987.00	11,350,600
明光ネットワークジャパン	1,900	605.00	1,149,500
ファルコホールディングス	800	1,601.00	1,280,800
秀英予備校	300	417.00	125,100
田谷	300	550.00	165,000
ラウンドワン	4,300	833.00	3,581,900
リゾートトラスト	7,000	1,658.00	11,606,000
ビー・エム・エル	2,000	3,300.00	6,600,000
ワタベウェディング	200	274.00	54,800
りらいあコミュニケーションズ	2,700	1,198.00	3,234,600
リソー教育	7,000	329.00	2,303,000
早稲田アカデミー	700	978.00	684,600
ユー・エス・エス	17,100	2,203.00	37,671,300
東京個別指導学院	500	600.00	300,000
サイバーエージェント	9,400	6,200.00	58,280,000
楽天	71,300	1,107.00	78,929,100
クリーク・アンド・リバー社	800	1,057.00	845,600
テー・オー・ダブリュー	2,400	289.00	693,600
山田コンサルティンググループ	1,000	1,011.00	1,011,000
セントラルスポーツ	600	2,228.00	1,336,800
フルキャストホールディングス	1,300	1,637.00	2,128,100
エン・ジャパン	2,700	3,205.00	8,653,500
リソルホールディングス	200	3,800.00	760,000
テクノプロ・ホールディングス	3,100	7,530.00	23,343,000
アトラ	300	274.00	82,200
インターワークス	300	329.00	98,700
アイ・アールジャパンホールディングス	600	13,200.00	7,920,000
KeepPer 技研	1,100	1,751.00	1,926,100
ファーストロジック	300	824.00	247,200
三機サービス	300	984.00	295,200
Gunosy	1,000	768.00	768,000
デザインワン・ジャパン	400	233.00	93,200

イー・ガーディアン	700	3,195.00	2,236,500	
リブセンス	800	266.00	212,800	
ジャパンマテリアル	4,700	1,395.00	6,556,500	
ベクトル	1,900	827.00	1,571,300	
ウチヤマホールディングス	700	306.00	214,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,131.00	1,470,300	
キャリアリンク	500	1,567.00	783,500	
I B J	1,300	896.00	1,164,800	
アサンテ	600	1,587.00	952,200	
N・フィールド	1,100	805.00	885,500	
バリューHR	600	1,583.00	949,800	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	5,970.00	7,164,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	2,108.00	1,264,800	
E R Iホールディングス	400	700.00	280,000	
アピスト	200	2,900.00	580,000	
シグマクシス	1,000	1,538.00	1,538,000	
ウィルグループ	1,000	878.00	878,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,200	321.00	706,200	
メドピア	700	5,310.00	3,717,000	
リクルートホールディングス	109,600	4,690.00	514,024,000	
エラン	1,100	2,886.00	3,174,600	
土木管理総合試験所	700	375.00	262,500	
ネットマーケティング	600	628.00	376,800	
日本郵政	125,400	830.30	104,119,620	
ベルシステム24ホールディングス	2,600	1,643.00	4,271,800	
鎌倉新書	1,200	1,185.00	1,422,000	
S M N	300	783.00	234,900	
一蔵	200	372.00	74,400	
L I T A L I C O	500	3,555.00	1,777,500	
グローバルキッズCOMPANY	300	863.00	258,900	
エアトリ	800	1,283.00	1,026,400	
ハイアス・アンド・カンパニー	900	164.00	147,600	
アトラエ	500	2,520.00	1,260,000	
ストライク	600	5,810.00	3,486,000	
ソラスト	4,200	1,602.00	6,728,400	
セラク	500	2,099.00	1,049,500	

インソース	600	3,170.00	1,902,000	
バイカレント・コンサルティング	900	16,910.00	15,219,000	
Orchestra Holdings	300	2,395.00	718,500	
アイモバイル	500	1,367.00	683,500	
キャリアインデックス	600	608.00	364,800	
MS - Japan	500	801.00	400,500	
船場	300	903.00	270,900	
グレイステクノロジー	700	6,490.00	4,543,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,800	4,500.00	8,100,000	
フルテック	200	1,438.00	287,600	
グリーンズ	400	491.00	196,400	
ツナググループ・ホールディングス	300	401.00	120,300	
GameWith	500	575.00	287,500	
ソウルダアウト	400	1,513.00	605,200	
MS&Consulting	300	612.00	183,600	
エル・ティー・エス	100	5,140.00	514,000	
ミダック	200	3,440.00	688,000	
日総工産	1,000	807.00	807,000	
キュービーネットホールディングス	600	1,611.00	966,600	
RPAホールディングス	1,200	705.00	846,000	
スプリックス	400	876.00	350,400	
マネジメントソリューションズ	700	1,535.00	1,074,500	
プロレド・パートナーズ	200	5,070.00	1,014,000	
and factory	100	844.00	84,400	
フロンティア・マネジメント	100	5,310.00	531,000	
ピアラ	100	2,334.00	233,400	
コプロ・ホールディングス	100	3,020.00	302,000	
ギークス	200	1,234.00	246,800	
カーブスホールディングス	4,200	695.00	2,919,000	
フォーラムエンジニアリング	800	871.00	696,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	800	690.00	552,000	
リログループ	8,400	2,780.00	23,352,000	
東祥	1,000	1,438.00	1,438,000	
エイチ・アイ・エス	2,400	1,544.00	3,705,600	
ラックランド	400	2,318.00	927,200	

共立メンテナンス	2,500	3,535.00	8,837,500	
イチネンホールディングス	1,700	1,284.00	2,182,800	
建設技術研究所	1,000	2,180.00	2,180,000	
スペース	1,000	818.00	818,000	
長大	600	1,360.00	816,000	
燦ホールディングス	700	1,196.00	837,200	
スバル興業	100	8,040.00	804,000	
東京テアトル	600	1,304.00	782,400	
タナベ経営	300	1,401.00	420,300	
ナガワ	500	8,920.00	4,460,000	
よみうりランド	300	6,080.00	1,824,000	
東京都競馬	1,000	4,950.00	4,950,000	
常磐興産	600	1,503.00	901,800	
カナモト	2,700	2,294.00	6,193,800	
東京ドーム	6,200	930.00	5,766,000	
西尾レントオール	1,400	2,194.00	3,071,600	
アゴラ・ホスピタリティ・グループ	8,300	26.00	215,800	
トランス・コスモス	1,500	2,910.00	4,365,000	
乃村工藝社	6,600	767.00	5,062,200	
藤田観光	600	1,519.00	911,400	
KNT-CTホールディングス	1,000	870.00	870,000	
日本管財	1,600	2,142.00	3,427,200	
トーカイ	1,500	2,050.00	3,075,000	
白洋舎	200	2,504.00	500,800	
セコム	16,200	10,035.00	162,567,000	
セントラル警備保障	700	3,500.00	2,450,000	
丹青社	2,900	768.00	2,227,200	
メイテック	1,900	4,965.00	9,433,500	
応用地質	1,800	1,274.00	2,293,200	
船井総研ホールディングス	3,200	2,556.00	8,179,200	
進学会ホールディングス	600	428.00	256,800	
オオバ	1,100	784.00	862,400	
いであ	400	1,747.00	698,800	
学究社	400	1,217.00	486,800	
ベネッセホールディングス	5,100	2,398.00	12,229,800	
イオンディライト	1,900	2,742.00	5,209,800	

ナック	800	953.00	762,400	
ダイセキ	2,600	2,978.00	7,742,800	
ステップ	600	1,610.00	966,000	
合計	17,050,600		38,796,698,380	

## (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11月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,469,412,437
コール・ローン	87,374,187
株式	58,618,046,671
投資証券	1,395,267,901
派生商品評価勘定	737,027,809
未収入金	107,284
未収配当金	62,662,370
差入委託証拠金	2,480,437,451
流動資産合計	72,850,336,110
資産合計	72,850,336,110
負債の部	
流動負債	
未払解約金	420,027,000
未払利息	236
流動負債合計	420,027,236
負債合計	420,027,236
純資産の部	
元本等	
元本	49,548,212,831



2020年11月16日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	22,882,096,043
元本等合計	72,430,308,874
純資産合計	72,430,308,874
負債純資産合計	72,850,336,110

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	36,925,059,284円

期中追加設定元本額	52,718,953,213円
期中一部解約元本額	40,095,799,666円
期末元本額	49,548,212,831円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,098,361,074円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,010,179,029円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,582,934,217円
DCりそな グローバルバランス	36,530,648円
つみたてバランスファンド	1,397,493,220円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	817,251,797円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	405,024,395円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	236,609,481円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	20,098,631円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	14,268,457円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,624,256円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	11,476,591円
リスクコントロール・オープン	35,079,732円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	230,925,832円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	159,642,131円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	20,794,361,501円
Smart-i 先進国株式インデックス	3,749,159,261円
Smart-i 8資産バランス 安定型	135,717,442円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	299,017,505円
Smart-i 8資産バランス 成長型	316,071,689円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,824,698,288円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,439,311,592円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	827,641,687円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	537,255,429円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,606,188,102円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	264,901,957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)	6,220,531円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	396,245,920円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,248,473,807円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	41,448,629円
2. 計算日における受益権の総数	49,548,212,831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	1.4618円
(10,000口当たり純資産額)	(14,618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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		3,668,196,098
投資証券		57,918,947
合計		3,610,277,151

（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11月16日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,658,799,253	-	12,394,937,189	736,137,936
合計		11,658,799,253	-	12,394,937,189	736,137,936

（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11月16日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	334,334,013	-	333,444,140	889,873
	米ドル	305,176,860	-	304,304,760	872,100
	ユーロ	10,538,385	-	10,534,900	3,485

	スイスフラン	10,791,858	-	10,788,380	3,478
	デンマーククローネ	7,826,910	-	7,816,100	10,810
	合計	334,334,013	-	333,444,140	889,873

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	17.87	128,395.95	
	CABOT OIL & GAS CORP	5,423	17.62	95,553.26	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	52.07	130,903.98	
	CHEVRON CORP	24,268	83.03	2,014,972.04	
	CONCHO RESOURCES INC	2,677	51.22	137,115.94	
	CONOCOPHILLIPS	14,168	35.36	500,980.48	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	33.60	55,675.20	
	EOG RESOURCES INC	7,783	42.67	332,100.61	
	EXXON MOBIL CORP	54,942	36.08	1,982,307.36	
	HALLIBURTON CO	11,937	14.33	171,057.21	
	HESS CORP	3,020	43.42	131,128.40	
	KINDER MORGAN INC	27,151	13.13	356,492.63	

MARATHON PETROLEUM CORP	8,739	37.56	328,236.84
NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	10.98	33,521.94
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,822	11.80	115,899.60
ONEOK INC	4,830	31.66	152,917.80
PHILLIPS 66	5,838	58.76	343,040.88
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,821	90.67	165,110.07
SCHLUMBERGER LTD	18,563	18.00	334,134.00
VALERO ENERGY CORP	5,488	50.92	279,448.96
WILLIAMS COS INC	16,239	20.04	325,429.56
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,908	263.87	767,333.96
ALBEMARLE CORP	1,183	122.48	144,893.84
AMCOR PLC	17,805	11.79	209,920.95
AVERY DENNISON CORP	928	149.58	138,810.24
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	27.82	46,904.52
BALL CORP	4,409	94.65	417,311.85
CELANESE CORP	1,332	128.41	171,042.12
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	30.89	91,341.73
CORTEVA INC	10,203	36.01	367,410.03
CROWN HOLDINGS INC	1,510	95.11	143,616.10
DOW INC	9,910	51.97	515,022.70
DUPONT DE NEMOURS INC	9,759	61.63	601,447.17
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	94.00	176,626.00
ECOLAB INC	3,374	208.43	703,242.82
FMC CORP	1,444	108.60	156,818.40
FREEPORT-MCMORAN INC	19,809	20.14	398,953.26
INTERNATIONAL PAPER CO	4,150	47.89	198,743.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,182	112.17	132,584.94
LINDE PLC	6,850	257.06	1,760,861.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,676	76.64	281,728.64
MARTIN MARIETTA MATERIALS	693	264.14	183,049.02
MOSAIC CO/THE	3,288	18.02	59,249.76
NEWMONT CORP	10,613	65.71	697,380.23
NUCOR CORP	3,362	51.66	173,680.92
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	129.95	170,494.40
PPG INDUSTRIES INC	3,178	142.82	453,881.96

RPM INTERNATIONAL INC	1,446	90.04	130,197.84
SEALED AIR CORP	1,397	43.09	60,196.73
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,079	726.28	783,656.12
STEEL DYNAMICS INC	2,352	34.62	81,426.24
VULCAN MATERIALS CO	1,832	137.98	252,779.36
WESTROCK CO	2,274	40.45	91,983.30
3M CO	7,509	169.79	1,274,953.11
AERCAP HOLDINGS NV	853	36.28	30,946.84
ALLEGION PLC	1,026	114.00	116,964.00
AMETEK INC	3,087	117.27	362,012.49
BOEING CO/THE	6,999	187.11	1,309,582.89
CARRIER GLOBAL CORP	11,040	38.29	422,721.60
CATERPILLAR INC	7,081	171.71	1,215,878.51
CUMMINS INC	1,966	236.55	465,057.30
DEERE & CO	3,900	251.79	981,981.00
DOVER CORP	1,600	122.28	195,648.00
EATON CORP PLC	5,290	114.45	605,440.50
EMERSON ELECTRIC CO	7,898	75.81	598,747.38
FASTENAL CO	7,657	47.53	363,937.21
FORTIVE CORP	4,092	70.95	290,327.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	83.80	157,711.60
GENERAL DYNAMICS CORP	3,232	151.15	488,516.80
GENERAL ELECTRIC CO	114,945	9.25	1,063,241.25
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	44.81	68,290.44
HEICO CORP	242	130.07	31,476.94
HEICO CORP-CLASS A	819	118.26	96,854.94
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,145	201.54	1,843,083.30
HOWMET AEROSPACE INC	3,134	22.36	70,076.24
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	164.01	47,398.89
IDEX CORP	845	193.17	163,228.65
ILLINOIS TOOL WORKS	4,145	211.47	876,543.15
INGERSOLL-RAND INC	3,920	42.76	167,619.20
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	103.27	183,304.25
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	51.00	142,800.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	23.90	54,970.00

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,914	44.65	442,660.10
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,858	194.30	555,309.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	298.82	140,445.40
LOCKHEED MARTIN CORP	3,293	375.14	1,235,336.02
MASCO CORP	3,079	55.15	169,806.85
NORDSON CORP	746	201.92	150,632.32
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,082	311.71	648,980.22
OTIS WORLDWIDE CORP	5,512	65.57	361,421.84
OWENS CORNING	860	71.16	61,197.60
PACCAR INC	4,610	89.91	414,485.10
PARKER HANNIFIN CORP	1,716	258.99	444,426.84
PENTAIR PLC	1,289	52.66	67,878.74
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	19,760	66.15	1,307,124.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,550	239.78	371,659.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,378	396.39	546,225.42
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	46.30	77,876.60
SMITH (A.O.) CORP	1,507	55.07	82,990.49
SNAP-ON INC	437	171.32	74,866.84
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,069	181.40	375,316.60
SUNRUN INC	1,550	55.40	85,870.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	406	379.31	153,999.86
TEXTRON INC	3,103	43.53	135,073.59
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,195	147.99	472,828.05
TRANSDIGM GROUP INC	689	566.78	390,511.42
UNITED RENTALS INC	983	207.27	203,746.41
WABTEC CORP	2,019	69.59	140,502.21
WW GRAINGER INC	506	403.31	204,074.86
XYLEM INC	1,998	94.99	189,790.02
CINTAS CORP	1,181	356.00	420,436.00
COPART INC	2,853	117.71	335,826.63
COSTAR GROUP INC	524	917.08	480,549.92
EQUIFAX INC	1,644	165.09	271,407.96
IHS MARKIT LTD	5,054	91.67	463,300.18
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	15.75	43,044.75
REPUBLIC SERVICES INC	3,015	101.06	304,695.90



ROBERT HALF INTL INC	1,565	63.19	98,892.35
ROLLINS INC	2,014	58.83	118,483.62
TRANSUNION	2,592	92.97	240,978.24
VERISK ANALYTICS INC	2,060	203.70	419,622.00
WASTE CONNECTIONS INC	3,522	108.63	382,594.86
WASTE MANAGEMENT INC	5,564	121.92	678,362.88
AMERCO	106	401.87	42,598.22
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	91.97	136,667.42
CSX CORP	10,096	90.60	914,697.60
DELTA AIR LINES INC	1,316	36.46	47,981.36
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,870	89.19	166,785.30
FEDEX CORP	3,279	271.91	891,592.89
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	129.15	150,588.90
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	187.07	245,622.91
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	40.91	42,710.04
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,384	239.26	809,655.84
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,297	202.75	262,966.75
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	43.88	39,843.04
UBER TECHNOLOGIES INC	12,797	47.61	609,265.17
UNION PACIFIC CORP	8,850	203.44	1,800,444.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,197	163.67	1,505,272.99
XPO LOGISTICS INC	977	104.63	102,223.51
APTIV PLC	3,602	109.91	395,895.82
AUTOLIV INC	743	87.37	64,915.91
BORGWARNER INC	2,199	37.66	82,814.34
FORD MOTOR CO	52,187	8.54	445,676.98
GENERAL MOTORS CO	17,042	41.19	701,959.98
LEAR CORP	775	137.98	106,934.50
TESLA INC	9,615	408.50	3,927,727.50
DR HORTON INC	4,656	73.27	341,145.12
GARMIN LTD	1,968	115.63	227,559.84
HASBRO INC	1,788	87.72	156,843.36
LENNAR CORP-A	3,733	75.60	282,214.80
LULULEMON ATHLETICA INC	1,638	325.45	533,087.10
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	123.14	69,450.96

NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	19.73	109,185.82
NIKE INC -CL B	16,152	128.28	2,071,978.56
NVR INC	40	4,247.94	169,917.60
PELOTON INTERACTIVE INC-A	2,689	100.79	271,024.31
PULTEGROUP INC	3,683	42.93	158,111.19
RALPH LAUREN CORP	478	77.61	37,097.58
VF CORP	4,481	79.51	356,284.31
WHIRLPOOL CORP	714	188.73	134,753.22
ARAMARK	2,216	34.19	75,765.04
CARNIVAL CORP	6,635	16.01	106,226.35
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	355	1,251.43	444,257.65
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	107.59	193,231.64
DOMINO'S PIZZA INC	438	389.60	170,644.80
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,758	105.80	397,596.40
LAS VEGAS SANDS CORP	3,893	58.28	226,884.04
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,715	120.00	445,800.00
MCDONALD'S CORP	9,683	213.28	2,065,190.24
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	18.06	65,016.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	25.90	118,829.20
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,461	70.61	173,771.21
STARBUCKS CORP	15,283	95.56	1,460,443.48
VAIL RESORTS INC	557	275.07	153,213.99
WYNN RESORTS LTD	1,017	92.19	93,757.23
YUM! BRANDS INC	4,053	102.87	416,932.11
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,224	77.55	792,871.20
ALPHABET INC-CL A	3,892	1,772.26	6,897,635.92
ALPHABET INC-CL C	3,924	1,777.02	6,973,026.48
ALTICE USA INC- A	2,974	30.65	91,153.10
CABLE ONE INC	68	1,983.47	134,875.96
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,904	647.19	1,232,249.76
COMCAST CORP-CLASS A	59,369	49.00	2,909,081.00
DISCOVERY INC - A	1,722	23.12	39,812.64
DISCOVERY INC-C	3,336	20.90	69,722.40
DISH NETWORK CORP-A	2,183	31.54	68,851.82
ELECTRONIC ARTS INC	3,889	120.80	469,791.20

FACEBOOK INC-A	31,154	276.95	8,628,100.30
FOX CORP - CLASS A	3,877	26.63	103,263.89
FOX CORP- CLASS B	1,836	26.21	48,121.56
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	135.36	152,415.36
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	21.16	78,059.24
LIBERTY BROADBAND-A	223	152.25	33,951.75
LIBERTY BROADBAND-C	1,523	152.63	232,455.49
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	41.61	89,586.33
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	41.51	72,933.07
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	41.28	39,050.88
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	66.08	103,349.12
MATCH GROUP INC	3,380	131.60	444,808.00
NETFLIX INC	5,727	482.84	2,765,224.68
NEWS CORP - CLASS A	2,810	16.98	47,713.80
OMNICOM GROUP	2,439	58.36	142,340.04
PINTEREST INC- CLASS A	5,740	62.32	357,716.80
ROKU INC	1,447	228.10	330,060.70
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.27	65,126.49
SNAP INC - A	12,546	40.43	507,234.78
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,602	161.83	259,251.66
TWITTER INC	10,694	43.48	464,975.12
VIACOMCBS INC - CLASS B	8,010	30.20	241,902.00
WALT DISNEY CO/THE	23,512	138.36	3,253,120.32
ZILLOW GROUP INC - C	1,987	106.03	210,681.61
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	154.00	144,298.00
AMAZON.COM INC	5,483	3,128.81	17,155,265.23
AUTOZONE INC	311	1,155.80	359,453.80
BEST BUY CO INC	3,104	114.30	354,787.20
BOOKING HOLDINGS INC	535	2,052.87	1,098,285.45
BURLINGTON STORES INC	893	225.41	201,291.13
CARMAX INC	1,819	95.48	173,678.12
DOLLAR GENERAL CORP	3,308	213.90	707,581.20
DOLLAR TREE INC	3,180	94.95	301,941.00
EBAY INC	8,607	48.67	418,902.69
EXPEDIA GROUP INC	1,497	123.45	184,804.65

GENUINE PARTS CO	1,957	99.03	193,801.71
HOME DEPOT INC	13,939	277.17	3,863,472.63
LKQ CORP	2,845	36.04	102,533.80
LOWE'S COS INC	9,824	159.23	1,564,275.52
MERCADOLIBRE INC	587	1,301.66	764,074.42
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	983	461.65	453,801.95
ROSS STORES INC	4,714	108.13	509,724.82
TARGET CORP	6,536	162.88	1,064,583.68
TIFFANY & CO	1,214	131.37	159,483.18
TJX COMPANIES INC	15,687	59.63	935,415.81
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,305	131.98	172,233.90
ULTA BEAUTY INC	726	262.35	190,466.10
WAYFAIR INC- CLASS A	864	235.84	203,765.76
COSTCO WHOLESALE CORP	5,743	378.84	2,175,678.12
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	4.76	476.00
KROGER CO	10,508	32.14	337,727.12
SYSCO CORP	6,442	71.54	460,860.68
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,956	42.71	425,220.76
WALMART INC	18,404	150.54	2,770,538.16
ALTRIA GROUP INC	24,223	40.33	976,913.59
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,379	49.86	367,916.94
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,118	79.58	327,710.44
BUNGE LTD	1,423	59.17	84,198.91
CAMPBELL SOUP CO	1,995	49.19	98,134.05
COCA-COLA CO/THE	52,919	53.45	2,828,520.55
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,797	39.50	110,481.50
CONAGRA BRANDS INC	6,526	36.03	235,131.78
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,218	202.01	448,058.18
GENERAL MILLS INC	7,972	60.97	486,052.84
HERSHEY CO/THE	1,965	154.00	302,610.00
HORMEL FOODS CORP	3,241	52.15	169,018.15
INGREDION INC	744	73.41	54,617.04
JM SMUCKER CO/THE	1,257	119.09	149,696.13
KELLOGG CO	3,449	65.76	226,806.24
KEURIG DR PEPPER INC	4,730	29.30	138,589.00

KRAFT HEINZ CO/THE	8,943	31.61	282,688.23
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	71.93	93,509.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,642	184.62	303,146.04
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	44.14	64,576.82
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	18,603	58.06	1,080,090.18
MONSTER BEVERAGE CORP	5,211	84.02	437,828.22
PEPSICO INC	17,997	144.71	2,604,345.87
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	20,237	75.89	1,535,785.93
TYSON FOODS INC-CL A	3,944	62.35	245,908.40
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	87.38	281,625.74
CLOROX COMPANY	1,647	207.38	341,554.86
COLGATE-PALMOLIVE CO	10,572	85.36	902,425.92
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,925	255.11	746,196.75
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	140.34	621,565.86
PROCTER & GAMBLE CO/THE	32,028	144.28	4,620,999.84
ABBOTT LABORATORIES	22,970	112.60	2,586,422.00
ABIOMED INC	494	272.10	134,417.40
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,007	457.26	460,460.82
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,693	108.12	183,047.16
ANTHEM INC	3,302	332.96	1,099,433.92
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,716	82.36	553,129.76
BECTON DICKINSON AND CO	3,794	242.81	921,221.14
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,762	37.98	712,580.76
CARDINAL HEALTH INC	3,200	57.43	183,776.00
CENTENE CORP	7,685	69.05	530,649.25
CERNER CORP	4,098	75.46	309,235.08
CIGNA CORP	4,837	219.69	1,062,640.53
COOPER COS INC/THE	727	341.35	248,161.45
CVS HEALTH CORP	17,084	71.00	1,212,964.00
DANAHER CORP	8,300	234.68	1,947,844.00
DAVITA INC	653	110.55	72,189.15
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	51.36	105,185.28
DEXCOM INC	1,222	336.40	411,080.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,153	81.78	666,752.34
HCA HEALTHCARE INC	3,581	149.75	536,254.75

HENRY SCHEIN INC	1,305	65.65	85,673.25
HOLOGIC INC	2,888	69.74	201,409.12
HUMANA INC	1,738	433.40	753,249.20
IDEXX LABORATORIES INC	1,129	453.64	512,159.56
INSULET CORP	689	256.00	176,384.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,524	753.38	1,148,151.12
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,325	199.59	264,456.75
MASIMO CORP	701	245.54	172,123.54
MCKESSON CORP	2,170	182.99	397,088.30
MEDTRONIC PLC	17,446	112.50	1,962,675.00
MOLINA HEALTHCARE INC	807	219.74	177,330.18
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,464	121.52	177,905.28
RESMED INC	1,937	214.74	415,951.38
STERIS PLC	1,157	192.79	223,058.03
STRYKER CORP	4,428	231.94	1,027,030.32
TELADOC HEALTH INC	1,474	183.07	269,845.18
TELEFLEX INC	632	364.40	230,300.80
UNITEDHEALTH GROUP INC	12,296	355.67	4,373,318.32
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	133.20	140,925.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	994	173.84	172,796.96
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,787	264.92	473,412.04
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	995	290.97	289,515.15
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,759	151.36	417,602.24
ABBVIE INC	22,952	99.04	2,273,166.08
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,121	110.17	454,010.57
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,965	127.76	378,808.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,233	135.51	167,083.83
AMGEN INC	7,649	237.36	1,815,566.64
AVANTOR INC	6,265	26.74	167,526.10
BEIGENE LTD-ADR	500	278.05	139,025.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	602.36	148,180.56
BIOGEN INC	2,151	248.59	534,717.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,957	77.52	151,706.64
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	29,433	63.62	1,872,527.46
CATALENT INC	2,108	104.61	220,517.88

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	30.15	163,654.20
ELI LILLY & CO	11,211	142.38	1,596,222.18
EXACT SCIENCES CORP	1,627	122.71	199,649.17
GILEAD SCIENCES INC	16,392	60.58	993,109.32
ILLUMINA INC	1,933	308.86	597,026.38
INCYTE CORP	2,513	82.53	207,397.89
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,802	51.57	92,929.14
IQVIA HOLDINGS INC	2,542	173.93	442,130.06
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	147.11	110,773.83
JOHNSON & JOHNSON	34,128	149.90	5,115,787.20
MERCK & CO. INC.	32,760	81.09	2,656,508.40
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	321	1,181.38	379,222.98
MODERNA INC	3,691	89.39	329,938.49
MYLAN NV	4,542	15.55	70,628.10
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	91.98	88,668.72
PERKINELMER INC	1,224	132.12	161,714.88
PERRIGO CO PLC	1,855	49.06	91,006.30
PFIZER INC	72,105	38.62	2,784,695.10
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,323	566.43	749,386.89
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	141.40	114,958.20
SEAGEN INC	1,643	175.91	289,020.13
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	9.49	121,652.31
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,133	488.59	2,507,932.47
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,394	225.52	765,414.88
WATERS CORP	843	232.65	196,123.95
ZOETIS INC	6,212	165.78	1,029,825.36
BANK OF AMERICA CORP	101,165	27.00	2,731,455.00
CITIGROUP INC	27,032	48.66	1,315,377.12
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	31.75	180,181.25
COMERICA INC	1,325	50.48	66,886.00
EAST WEST BANCORP INC	1,540	43.17	66,481.80
FIFTH THIRD BANCORP	7,761	25.39	197,051.79
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,273	133.97	304,513.81
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	11.59	104,217.28
JPMORGAN CHASE & CO	39,445	114.08	4,499,885.60

KEYCORP	12,976	14.87	192,953.12
M & T BANK CORP	1,428	118.83	169,689.24
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	12.68	43,403.64
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,541	122.78	680,323.98
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	14.90	190,228.30
SIGNATURE BANK	590	102.65	60,563.50
SVB FINANCIAL GROUP	685	345.91	236,948.35
TRUIST FINANCIAL CORP	17,581	47.19	829,647.39
US BANCORP	17,697	43.31	766,457.07
WELLS FARGO & CO	50,605	24.07	1,218,062.35
ZIONS BANCORPORATION	1,197	37.48	44,863.56
ALLY FINANCIAL INC	3,571	29.91	106,808.61
AMERICAN EXPRESS CO	8,992	114.99	1,033,990.08
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	184.88	309,858.88
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	44.24	68,793.20
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	10,702	38.71	414,274.42
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	18,044	227.42	4,103,566.48
BLACKROCK INC	1,996	669.77	1,336,860.92
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	8,940	56.16	502,070.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,102	86.70	529,043.40
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	27.80	34,750.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	87.65	108,598.35
CME GROUP INC	4,720	165.96	783,331.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,228	76.61	323,907.08
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	24.61	137,766.78
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	328.26	171,679.98
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	20.51	56,156.38
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,294	219.08	940,729.52
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,216	99.35	716,909.60
INVESCO LTD	2,612	15.53	40,564.36
KKR & CO INC	6,932	37.51	260,019.32
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	522.93	271,923.60
MOODY'S CORP	2,233	275.41	614,990.53
MORGAN STANLEY	18,743	56.61	1,061,041.23
MSCI INC	1,140	388.42	442,798.80



NASDAQ INC	1,296	125.82	163,062.72
NORTHERN TRUST CORP	2,230	90.80	202,484.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	85.25	145,180.75
S&P GLOBAL INC	3,155	341.92	1,078,757.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	18,680	46.00	859,280.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	55.12	95,688.32
STATE STREET CORP	4,767	68.52	326,634.84
SYNCHRONY FINANCIAL	6,195	30.02	185,973.90
T ROWE PRICE GROUP INC	3,050	140.43	428,311.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	60.26	44,230.84
VOYA FINANCIAL INC	1,741	55.34	96,346.94
AFLAC INC	9,192	41.52	381,651.84
ALLEGHANY CORP	197	615.80	121,312.60
ALLSTATE CORP	4,209	96.71	407,052.39
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	86.27	66,945.52
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	11,606	37.32	433,135.92
AON PLC	3,057	204.44	624,973.08
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,552	34.15	155,450.80
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,584	115.71	298,994.64
ASSURANT INC	506	133.51	67,556.06
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	41.87	53,174.90
BROWN & BROWN INC	2,686	47.16	126,671.76
CHUBB LTD	5,944	149.26	887,201.44
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	78.78	136,604.52
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	236.88	34,584.48
EVEREST RE GROUP LTD	550	232.31	127,770.50
FNF GROUP	3,124	34.56	107,965.44
GLOBE LIFE INC	921	92.04	84,768.84
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,020	45.21	181,744.20
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	41.68	85,860.80
LOEWS CORP	2,906	42.30	122,923.80
MARKEL CORP	155	1,042.06	161,519.30
MARSH & MCLENNAN COS	6,717	113.31	761,103.27
METLIFE INC	10,331	44.74	462,208.94
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	46.30	174,273.20

PROGRESSIVE CORP	7,716	95.66	738,112.56
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,308	73.13	388,174.04
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	114.26	53,702.20
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	178.21	100,154.02
TRAVELERS COS INC/THE	3,388	134.63	456,126.44
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,732	206.81	358,194.92
WR BERKLEY CORP	1,291	68.87	88,911.17
CBRE GROUP INC - A	4,736	57.83	273,882.88
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.16	83,616.00
JONES LANG LASALLE INC	468	132.45	61,986.60
ACCENTURE PLC-CL A	8,268	241.78	1,999,037.04
ADOBE INC	6,244	469.34	2,930,558.96
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	101.53	220,421.63
ANSYS INC	1,132	328.21	371,533.72
AUTODESK INC	2,868	251.00	719,868.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,614	171.63	963,530.82
AVALARA INC	1,064	151.60	161,302.40
BLACK KNIGHT INC	1,644	94.52	155,390.88
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	87.58	134,960.78
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,262	146.69	185,122.78
CADENCE DESIGN SYS INC	3,685	115.82	426,796.70
CDK GLOBAL INC	1,236	47.99	59,315.64
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	118.67	197,466.88
CITRIX SYSTEMS INC	1,273	118.26	150,544.98
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,112	77.19	548,975.28
COUPA SOFTWARE INC	887	287.07	254,631.09
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1,914	132.18	252,992.52
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	105.96	75,443.52
DATADOG INC - CLASS A	1,771	85.82	151,987.22
DOCUSIGN INC	2,288	205.70	470,641.60
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	19.06	51,366.70
DYNATRACE INC	2,449	35.19	86,180.31
EPAM SYSTEMS INC	745	333.38	248,368.10
FAIR ISAAC CORP	389	473.25	184,094.25
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,041	144.72	1,163,693.52

FISERV INC	7,440	108.85	809,844.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	260.30	290,755.10
FORTINET INC	1,600	115.92	185,472.00
GARTNER INC	1,196	157.98	188,944.08
GLOBAL PAYMENTS INC	3,914	188.41	737,436.74
GODADDY INC - CLASS A	2,217	73.70	163,392.90
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	109.93	99,816.44
INTL BUSINESS MACHINES CORP	11,543	116.85	1,348,799.55
INTUIT INC	3,395	356.95	1,211,845.25
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	161.48	136,127.64
LEIDOS HOLDINGS INC	1,476	98.47	145,341.72
MASTERCARD INC-CLASS A	11,575	335.03	3,877,972.25
MICROSOFT CORP	93,149	216.51	20,167,689.99
MONGODB INC	644	246.86	158,977.84
NORTONLIFELOCK INC	6,268	19.80	124,106.40
OKTA INC	1,540	221.80	341,572.00
ORACLE CORP	26,641	56.91	1,516,139.31
PALO ALTO NETWORKS INC	1,280	258.70	331,136.00
PAYCHEX INC	4,283	91.87	393,479.21
PAYCOM SOFTWARE INC	550	381.72	209,946.00
PAYPAL HOLDINGS INC	14,458	188.62	2,727,067.96
PTC INC	1,110	97.21	107,903.10
RINGCENTRAL INC-CLASS A	975	297.08	289,653.00
SALESFORCE.COM INC	11,655	249.51	2,908,039.05
SERVICENOW INC	2,482	508.01	1,260,880.82
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,137	25.75	132,277.75
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	234.80	89,224.00
SPLUNK INC	2,092	193.25	404,279.00
SQUARE INC - A	4,746	177.19	840,943.74
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	64.83	200,843.34
SYNOPSYS INC	1,988	226.23	449,745.24
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	546	734.77	401,184.42
TWILIO INC - A	1,613	274.43	442,655.59
TYLER TECHNOLOGIES INC	433	416.15	180,192.95
VERISIGN INC	1,385	198.51	274,936.35

VISA INC-CLASS A SHARES	21,845	210.48	4,597,935.60
VMWARE INC-CLASS A	1,126	141.86	159,734.36
WESTERN UNION CO	5,513	21.24	117,096.12
WIX.COM LTD	747	244.26	182,462.22
WORKDAY INC-CLASS A	2,288	222.00	507,936.00
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,086	403.58	841,867.88
ZSCALER INC	963	131.92	127,038.96
AMPHENOL CORP-CL A	3,944	123.40	486,689.60
APPLE INC	224,180	119.26	26,735,706.80
ARISTA NETWORKS INC	777	273.86	212,789.22
ARROW ELECTRONICS INC	902	87.00	78,474.00
CDW CORP/DE	1,592	137.59	219,043.28
CISCO SYSTEMS INC	54,877	41.40	2,271,907.80
COGNEX CORP	1,928	71.18	137,235.04
CORNING INC	10,238	35.83	366,827.54
DELL TECHNOLOGIES -C	3,296	66.11	217,898.56
F5 NETWORKS INC	613	159.46	97,748.98
FLIR SYSTEMS INC	1,041	37.32	38,850.12
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	14,447	10.14	146,492.58
HP INC	19,172	19.61	375,962.92
IPG PHOTONICS CORP	259	201.00	52,059.00
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	21.85	99,046.05
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,546	116.10	295,590.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,283	170.50	389,251.50
NETAPP INC	2,471	49.83	123,129.93
SEAGATE TECHNOLOGY	3,159	54.71	172,828.89
TE CONNECTIVITY LTD	4,399	109.54	481,866.46
TRIMBLE INC	3,417	58.11	198,561.87
WESTERN DIGITAL CORP	4,100	41.47	170,027.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	603	345.86	208,553.58
AT&T INC	92,649	28.91	2,678,482.59
CENTURYLINK INC	12,971	9.85	127,764.35
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	21.62	28,235.72
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	21.02	73,633.06
T-MOBILE US INC	7,333	128.23	940,310.59

VERIZON COMMUNICATIONS INC	53,764	61.06	3,282,829.84
AES CORP	7,346	20.87	153,311.02
ALLIANT ENERGY CORP	2,711	56.20	152,358.20
AMEREN CORPORATION	3,331	82.12	273,541.72
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,546	89.87	588,289.02
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,418	161.31	390,047.58
ATMOS ENERGY CORP	1,353	102.16	138,222.48
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	24.25	165,385.00
CMS ENERGY CORP	3,883	65.07	252,666.81
CONSOLIDATED EDISON INC	4,473	81.63	365,130.99
DOMINION ENERGY INC	10,988	84.93	933,210.84
DTE ENERGY COMPANY	2,584	130.70	337,728.80
DUKE ENERGY CORP	9,636	94.98	915,227.28
EDISON INTERNATIONAL	5,098	64.06	326,577.88
ENERGY CORP	2,701	109.18	294,895.18
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	44.71	110,210.15
EVERGY INC	2,522	57.11	144,031.42
EVERSOURCE ENERGY	4,479	93.29	417,845.91
EXELON CORP	12,893	42.89	552,980.77
FIRSTENERGY CORP	5,919	29.51	174,669.69
NEXTERA ENERGY INC	25,460	77.19	1,965,257.40
NISOURCE INC	4,230	24.47	103,508.10
NRG ENERGY INC	3,312	32.14	106,447.68
OGE ENERGY CORP	1,432	33.96	48,630.72
P G & E CORP	14,486	11.40	165,140.40
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	89.46	136,515.96
PPL CORP	10,335	29.81	308,086.35
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,746	59.38	400,577.48
SEMPRA ENERGY	3,870	134.55	520,708.50
SOUTHERN CO/THE	13,859	63.90	885,590.10
UGI CORP	1,566	36.43	57,049.38
VISTRA CORP	4,854	19.73	95,769.42
WEC ENERGY GROUP INC	4,196	102.14	428,579.44
XCEL ENERGY INC	6,948	74.08	514,707.84
ADVANCED MICRO DEVICES	15,200	81.43	1,237,736.00

	ANALOG DEVICES INC	4,806	136.27	654,913.62	
	APPLIED MATERIALS INC	11,930	72.81	868,623.30	
	BROADCOM INC	5,183	373.50	1,935,850.50	
	INTEL CORP	54,829	45.46	2,492,526.34	
	KLA CORP	2,030	236.10	479,283.00	
	LAM RESEARCH CORP	1,892	426.31	806,578.52	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,745	43.26	378,308.70	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,911	81.18	236,314.98	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,220	126.15	406,203.00	
	MICRON TECHNOLOGY INC	14,492	57.93	839,521.56	
	NVIDIA CORP	7,959	531.88	4,233,232.92	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,648	146.49	534,395.52	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	28.05	152,198.37	
	QORVO INC	1,251	147.63	184,685.13	
	QUALCOMM INC	14,584	144.26	2,103,887.84	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,194	141.50	310,451.00	
	TERADYNE INC	1,812	102.29	185,349.48	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	11,899	156.65	1,863,978.35	
	XILINX INC	3,193	127.65	407,586.45	
	米ドル 小計	3,968,945		402,147,393.70 (42,100,810,646)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	12.66	31,194.24	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,284	26.35	429,083.40	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	5.61	57,990.57	
	ENBRIDGE INC	26,796	37.38	1,001,634.48	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	21.12	60,762.24	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	12.78	44,359.38	
	KEYERA CORP	2,259	20.05	45,292.95	
	PARKLAND CORP	1,790	39.50	70,705.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,181	29.66	183,328.46	
	SUNCOR ENERGY INC	20,962	18.27	382,975.74	
	TC ENERGY CORP	12,551	54.73	686,916.23	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	97.55	333,718.55	
	B2GOLD CORP	10,119	7.85	79,434.15	
	BARRICK GOLD CORP	23,822	34.01	810,186.22	

CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	58.37	97,653.01
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	16.12	148,513.56
FRANCO-NEVADA CORP	2,617	178.87	468,102.79
KINROSS GOLD CORP	19,092	10.52	200,847.84
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	59.30	186,261.30
LUNDIN MINING CORP	7,300	8.84	64,532.00
NUTRIEN LTD	7,998	55.11	440,769.78
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	43.36	88,888.00
SSR MINING INC	2,800	25.85	72,380.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	19.29	142,823.16
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,261	59.70	373,781.70
YAMANA GOLD INC	9,288	7.22	67,059.36
CAE INC	3,196	29.72	94,985.12
WSP GLOBAL INC	1,340	90.57	121,363.80
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,068	84.20	89,925.60
THOMSON REUTERS CORP	1,971	109.26	215,351.46
AIR CANADA	840	19.41	16,304.40
CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,415	142.46	1,341,260.90
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,833	436.90	800,837.70
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,272	78.28	256,132.16
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	31.37	56,466.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	76.40	315,226.40
QUEBECOR INC -CL B	1,274	33.08	42,143.92
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	22.85	130,953.35
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	160.55	80,275.00
DOLLARAMA INC	3,451	49.42	170,548.42
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,716	44.96	526,751.36
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	36.23	95,212.44
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	65.70	138,889.80
METRO INC	2,930	61.80	181,074.00
WESTON (GEORGE) LTD	817	100.07	81,757.19
SAPUTO INC	3,667	34.36	125,998.12
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	25.74	84,349.98
CANOPY GROWTH CORP	1,137	32.06	36,452.22
CRONOS GROUP INC	1,000	9.31	9,310.00

BANK OF MONTREAL	8,502	87.54	744,265.08	
BANK OF NOVA SCOTIA	16,021	60.80	974,076.80	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,942	106.38	632,109.96	
NATIONAL BANK OF CANADA	4,616	69.18	319,334.88	
ROYAL BANK OF CANADA	18,589	100.40	1,866,335.60	
TORONTO-DOMINION BANK	23,679	64.89	1,536,530.31	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,959	48.84	877,117.56	
CI FINANCIAL CORP	775	16.69	12,934.75	
IGM FINANCIAL INC	81	33.17	2,686.77	
ONEX CORPORATION	908	64.89	58,920.12	
TMX GROUP LTD	540	127.51	68,855.40	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	416.49	135,775.74	
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	29.21	126,420.88	
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	56.64	71,026.56	
INTACT FINANCIAL CORP	2,057	146.49	301,329.93	
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,548	20.80	552,198.40	
POWER CORP OF CANADA	8,338	28.16	234,798.08	
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,077	58.41	471,777.57	
BLACKBERRY LTD	1,407	6.72	9,455.04	
CGI INC	2,689	89.82	241,525.98	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	275	1,502.16	413,094.00	
OPEN TEXT CORP	3,074	55.55	170,760.70	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,406	1,205.13	1,694,412.78	
BCE INC	2,440	55.88	136,347.20	
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	59.98	310,276.54	
TELUS CORP	4,085	24.79	101,267.15	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	20.89	186,923.72	
ALTAGAS LTD	2,930	17.95	52,593.50	
ATCO LTD -CLASS I	863	38.10	32,880.30	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	31.29	30,883.23	
EMERA INC	2,818	55.64	156,793.52	
FORTIS INC	6,487	54.37	352,698.19	
HYDRO ONE LTD	4,991	29.20	145,737.20	
カナダドル 小計	488,387		24,602,906.89	(1,963,311,969)



ユーロ	ENI SPA	35,538	7.66	272,221.08
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.65	64,096.50
	NESTE OYJ	5,733	52.56	301,326.48
	OMV AG	1,475	26.36	38,881.00
	REPSOL SA	16,357	7.26	118,784.53
	TENARIS SA	5,062	5.72	28,985.01
	TOTAL SE	32,497	32.64	1,060,864.56
	VOPAK	762	44.75	34,099.50
	AIR LIQUIDE SA	6,272	139.00	871,808.00
	AKZO NOBEL	2,659	87.32	232,183.88
	ARCELORMITTAL	8,506	13.50	114,831.00
	ARKEMA	822	89.60	73,651.20
	BASF SE	12,212	56.10	685,093.20
	COVESTRO AG	2,528	43.98	111,181.44
	CRH PLC	10,365	33.41	346,294.65
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	22.92	41,095.56
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	48.32	2,705.92
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	58.58	126,767.12
	KONINKLIJKE DSM NV	2,331	143.15	333,682.65
	LANXESS AG	745	51.40	38,293.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	36.12	82,570.32
	SOLVAY SA	925	84.00	77,700.00
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	13.41	116,925.14
	SYMRISE AG	1,815	105.25	191,028.75
	THYSSENKRUPP AG	2,040	4.95	10,100.04
	UMICORE	2,388	34.89	83,317.32
	UPM-KYMMENE OYJ	6,116	26.40	161,462.40
	VOESTALPINE AG	712	25.62	18,241.44
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	25.26	72,622.50
	AIRBUS SE	7,861	85.56	672,587.16
	ALSTOM	2,236	42.00	93,912.00
	ANDRITZ AG	1,260	33.74	42,512.40
BOUYGUES SA	3,499	33.35	116,691.65	
BRENTAG AG	1,535	58.88	90,380.80	
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	8.53	138,883.89	

COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7,237	39.42	285,282.54
DASSAULT AVIATION SA	11	890.50	9,795.50
EIFFAGE	1,313	81.42	106,904.46
FERROVIAL SA	7,014	23.04	161,602.56
GEA GROUP AG	1,676	28.93	48,486.68
HOCHTIEF AG	17	75.90	1,290.30
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	79.75	163,487.50
KION GROUP AG	740	72.28	53,487.20
KNORR-BREMSE AG	691	104.42	72,154.22
KONE OYJ-B	4,561	71.46	325,929.06
LEGRAND SA	3,715	71.70	266,365.50
LEONARDO SPA	3,148	5.26	16,571.07
MTU AERO ENGINES AG	622	193.45	120,325.90
PRYSMIAN SPA	2,867	25.69	73,653.23
SAFRAN SA	4,327	113.50	491,114.50
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,324	117.45	860,203.80
SIEMENS AG-REG	10,012	113.34	1,134,760.08
SIEMENS ENERGY AG	5,006	22.72	113,736.32
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	27.42	62,901.48
THALES SA	1,244	75.14	93,474.16
VINCI SA	6,890	85.74	590,748.60
WARTSILA OYJ ABP	2,705	7.58	20,514.72
BUREAU VERITAS SA	4,564	21.31	97,258.84
RANDSTAD NV	825	50.20	41,415.00
TELEPERFORMANCE	832	277.30	230,713.60
WOLTERS KLUWER	3,691	73.48	271,214.68
ADP	314	107.30	33,692.20
AENA SME SA	754	141.60	106,766.40
ATLANTIA SPA	8,066	14.17	114,335.55
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	9.15	12,874.05
DEUTSCHE POST AG-REG	13,231	38.92	514,950.52
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	44.90	17,286.50
GETLINK	4,655	14.27	66,426.85
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,522	70.64	319,434.08
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	54.00	33,426.00

CONTINENTAL AG	1,275	106.85	136,233.75
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,398	52.27	595,773.46
FAURECIA	800	38.11	30,488.00
FERRARI NV	1,758	174.50	306,771.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,480	12.21	152,405.76
MICHELIN (CGDE)	2,383	102.60	244,495.80
PEUGEOT SA	8,853	18.29	161,965.63
PIRELLI & C SPA	1,734	4.18	7,248.12
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	54.78	97,234.50
RENAULT SA	1,817	29.02	52,729.34
VALEO SA	2,418	30.08	72,733.44
VOLKSWAGEN AG	462	158.00	72,996.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,502	150.00	375,300.00
ADIDAS AG	2,525	270.50	683,012.50
ESSILORLUXOTTICA	3,854	117.55	453,037.70
HERMES INTERNATIONAL	437	835.00	364,895.00
KERING	1,018	609.00	619,962.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,640	469.75	1,709,890.00
MONCLER SPA	2,414	39.81	96,101.34
PUMA SE	750	82.26	61,695.00
SEB SA	151	143.20	21,623.20
ACCOR SA	2,330	28.20	65,706.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,046	150.95	308,843.70
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	33.31	26,847.86
SODEXO	1,088	68.52	74,549.76
BOLLORE	3,240	3.38	10,964.16
JC DECAUX SA	60	19.78	1,186.80
PUBLICIS GROUPE	3,613	36.93	133,428.09
SCOUT24 AG	1,621	65.95	106,904.95
SES	2,232	8.10	18,092.59
TELENET GROUP HOLDING NV	192	33.94	6,516.48
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	79.72	87,293.40
VIVENDI	11,862	25.57	303,311.34
DELIVERY HERO SE	1,478	99.02	146,351.56
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,775	26.67	394,049.25

JUST EAT TAKEAWAY	1,360	93.60	127,296.00
PROSUS NV	6,414	88.80	569,563.20
ZALANDO SE	2,148	83.22	178,756.56
CARREFOUR SA	7,042	14.34	100,982.28
COLRUYT SA	290	49.27	14,288.30
JERONIMO MARTINS	2,258	14.18	32,018.44
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	14,664	23.19	340,058.16
METRO AG	1,970	8.46	16,674.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,177	55.55	565,332.35
DANONE	8,264	54.38	449,396.32
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	9.62	86,786.79
HEINEKEN HOLDING NV	1,282	79.75	102,239.50
HEINEKEN NV	3,455	90.42	312,401.10
KERRY GROUP PLC-A	2,069	117.70	243,521.30
PERNOD RICARD SA	2,853	158.75	452,913.75
REMY COINTREAU	264	155.00	40,920.00
BEIERSDORF AG	1,128	101.40	114,379.20
HENKEL AG & CO KGAA	966	80.75	78,004.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	90.86	217,700.56
L'OREAL	3,296	314.20	1,035,603.20
UNILEVER NV	18,967	52.58	997,284.86
BIOMERIEUX	402	123.40	49,606.80
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	117.20	28,714.00
DIASORIN SPA	256	173.80	44,492.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	72.02	212,891.12
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,777	37.46	216,406.42
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,089	44.87	542,493.87
ORPEA	501	106.50	53,356.50
SARTORIUS AG-VORZUG	502	376.40	188,952.80
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,463	39.29	136,078.58
ARGENX SE	674	224.00	150,976.00
BAYER AG-REG	12,953	47.80	619,153.40
EUROFINS SCIENTIFIC	153	711.80	108,905.40
GALAPAGOS NV	507	105.55	53,513.85
GRIFOLS SA	3,329	26.35	87,719.15

IPSEN	158	84.90	13,414.20
MERCK KGAA	1,798	132.05	237,425.90
ORION OYJ-CLASS B	739	39.75	29,375.25
QIAGEN N.V.	2,679	40.44	108,338.76
RECORDATI SPA	830	45.91	38,105.30
SANOFI	14,824	85.80	1,271,899.20
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	319.40	95,181.20
UCB SA	1,446	93.36	134,998.56
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.41	32,023.68
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	91,083	3.17	289,097.44
BANCO SANTANDER SA	221,323	2.38	528,076.67
BANKINTER SA	2,829	4.09	11,581.92
BNP PARIBAS	14,918	39.91	595,451.97
CAIXABANK S.A	52,513	2.04	107,336.57
COMMERZBANK AG	13,866	4.90	68,026.59
CREDIT AGRICOLE SA	16,523	8.63	142,593.49
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	22.28	87,359.88
FINECOBANK SPA	7,003	12.21	85,506.63
ING GROEP NV-CVA	51,310	7.41	380,617.58
INTESA SANPAOLO	223,051	1.81	405,462.10
KBC GROEP NV	3,531	55.78	196,959.18
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.13	48,945.26
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	15.05	18,300.80
SOCIETE GENERALE SA	9,028	15.62	141,089.58
UNICREDIT SPA	29,529	8.11	239,539.24
AMUNDI SA	618	67.45	41,684.10
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,465	9.00	247,212.46
DEUTSCHE BOERSE AG	2,564	137.70	353,062.80
EURAZEO	403	49.96	20,133.88
EXOR NV	1,318	54.56	71,910.08
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,384	79.48	110,000.32
NATIXIS	3,105	2.41	7,498.57
SOFINA	168	252.00	42,336.00
WENDEL	294	89.40	26,283.60
AEGON NV	16,557	2.88	47,800.05

AGEAS	2,765	38.96	107,724.40
ALLIANZ SE-REG	5,481	190.58	1,044,568.98
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	13.63	218,241.81
AXA SA	26,166	18.35	480,146.10
CNP ASSURANCES	1,015	11.91	12,088.65
HANNOVER RUECK SE	718	147.30	105,761.40
MAPFRE SA	942	1.57	1,486.47
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,879	234.40	440,437.60
NN GROUP NV	4,060	34.12	138,527.20
POSTE ITALIANE SPA	5,374	8.50	45,700.49
SAMPO OYJ-A SHS	6,490	36.24	235,197.60
SCOR SE	1,565	27.44	42,943.60
AROUNDTOWN SA	10,475	5.18	54,302.40
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,911	42.67	209,552.37
LEG IMMOBILIEN AG	1,031	119.18	122,874.58
VONOVIA SE	7,029	57.40	403,464.60
ADYEN NV	239	1,629.00	389,331.00
AMADEUS IT GROUP SA	6,112	56.98	348,261.76
ATOS SE	1,004	66.92	67,187.68
CAPGEMINI SA	2,213	114.55	253,499.15
DASSAULT SYSTEMES SA	1,805	152.00	274,360.00
EDENRED	2,756	46.34	127,713.04
NEMETSCHKE SE	536	64.10	34,357.60
NEXI SPA	3,732	14.71	54,897.72
SAP SE	13,579	102.00	1,385,058.00
TEAMVIEWER AG	1,207	39.29	47,423.03
WORLDFONE SA	3,094	74.16	229,451.04
NOKIA OYJ	76,089	3.19	242,952.17
ALTICE EUROPE NV	7,300	4.28	31,280.50
CELLNEX TELECOM SA	4,483	53.24	238,674.92
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	44,316	14.93	661,859.46
ELISA OYJ	2,152	45.27	97,421.04
ILIAD SA	98	172.80	16,934.40
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	10.16	25,115.52
KONINKLIJKE KPN NV	41,469	2.57	106,907.08

	ORANGE	28,127	10.33	290,692.54	
	PROXIMUS	918	17.37	15,945.66	
	TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.33	24,279.29	
	TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.34	24,796.27	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.38	30,089.16	
	TELEFONICA SA	69,076	3.36	232,647.96	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	32.39	24,810.74	
	E.ON SE	30,402	9.34	284,137.09	
	EDF	6,102	11.44	69,837.39	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,111	4.54	168,706.60	
	ELIA GROUP SA/NV	345	93.20	32,154.00	
	ENAGAS SA	2,667	19.57	52,193.19	
	ENDESA SA	4,803	24.15	115,992.45	
	ENEL SPA	107,833	8.02	864,820.66	
	ENGIE	25,193	12.30	309,873.90	
	FORTUM OYJ	6,395	17.25	110,313.75	
	IBERDROLA SA	78,288	11.41	893,657.52	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	19.68	42,224.32	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.41	80,548.40	
	RWE AG	8,723	34.99	305,217.77	
	SNAM SPA	23,547	4.53	106,856.28	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	16.20	36,369.00	
	TERNA SPA	16,305	6.30	102,754.11	
	UNIPER SE	2,857	28.10	80,281.70	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,127	18.56	113,717.12	
	VERBUND AG	797	54.20	43,197.40	
	ASML HOLDING NV	5,518	352.80	1,946,750.40	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	16,550	26.30	435,347.75	
	STMICROELECTRONICS NV	8,739	28.91	252,644.49	
	ユーロ 小計	2,382,227		52,029,573.44	(6,448,545,332)
英ポンド	BP PLC	266,429	2.36	631,170.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	54,107	11.65	630,779.40	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	49,043	11.15	546,829.45	
	ANGLO AMERICAN PLC	16,694	20.94	349,572.36	

ANTOFAGASTA PLC	4,320	11.26	48,643.20
BHP GROUP PLC	28,186	16.30	459,600.91
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,494	62.18	92,896.92
EVRAZ PLC	3,072	3.70	11,378.68
GLENCORE PLC	138,176	1.89	261,898.79
JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	24.90	44,894.70
MONDI PLC	5,627	16.98	95,574.59
RIO TINTO PLC	14,830	47.32	701,755.60
ASHTED GROUP PLC	6,287	31.95	200,869.65
BAE SYSTEMS PLC	43,957	4.71	207,125.38
BUNZL PLC	4,790	24.40	116,876.00
DCC PLC	1,401	59.00	82,659.00
FERGUSON PLC	3,075	79.92	245,754.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	1.48	66,219.13
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107,239	0.93	100,482.94
SMITHS GROUP PLC	3,824	15.03	57,474.72
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	115.50	97,944.00
EXPERIAN PLC	12,198	30.68	374,234.64
INTERTEK GROUP PLC	1,825	60.78	110,923.50
RELX PLC	25,710	17.71	455,452.65
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.42	113,280.24
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	6.19	75,077.47
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	46.75	70,031.50
BURBERRY GROUP PLC	5,808	16.12	93,624.96
PERSIMMON PLC	3,796	28.00	106,288.00
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.48	64,517.33
COMPASS GROUP PLC	24,300	13.73	333,760.50
GVC HOLDINGS PLC	6,950	9.99	69,486.10
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	44.77	112,462.24
WHITBREAD PLC	2,921	27.81	81,233.01
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.62	63,753.83
INFORMA PLC	17,619	5.61	98,877.82
PEARSON PLC	7,332	5.91	43,346.78
WPP PLC	14,514	7.24	105,168.44
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.09	40,156.16



KINGFISHER PLC	29,802	2.94	87,707.28
NEXT PLC	1,878	66.70	125,262.60
OCADO GROUP PLC	6,371	22.83	145,449.93
SAINSBURY (J) PLC	9,573	2.05	19,710.80
TESCO PLC	132,370	2.24	297,435.39
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.73	39,964.89
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	19.78	98,385.72
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	30,049	27.90	838,367.10
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	22.06	40,502.16
DIAGEO PLC	30,606	29.04	888,798.24
IMPERIAL BRANDS PLC	10,573	13.56	143,369.88
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,269	69.80	646,976.20
UNILEVER PLC	15,248	47.49	724,127.52
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	14.95	181,374.24
ASTRAZENECA PLC	17,106	86.33	1,476,760.98
GLAXOSMITHKLINE PLC	65,666	14.37	943,620.42
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	26.59	35,949.68
BARCLAYS PLC	231,567	1.34	310,670.28
HSBC HOLDINGS PLC	265,744	3.72	990,427.88
LLOYDS BANKING GROUP PLC	943,785	0.34	327,682.15
NATWEST GROUP PLC	42,392	1.47	62,528.20
STANDARD CHARTERED PLC	30,372	4.16	126,620.86
3I GROUP PLC	14,053	11.11	156,128.83
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	15.78	48,428.38
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,254	83.94	357,080.76
M&G PLC	21,579	1.83	39,565.09
SCHRODERS PLC	1,161	30.04	34,876.44
ST JAMES' S PLACE PLC	7,750	10.90	84,475.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	32,937	2.60	85,899.69
ADMIRAL GROUP PLC	2,745	29.02	79,659.90
AVIVA PLC	45,209	3.09	139,741.01
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	2.92	57,321.22
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,505	2.41	201,497.56
PRUDENTIAL PLC	34,888	12.49	435,751.12

	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	6.56	61,656.55	
	AVEVA GROUP PLC	700	41.05	28,735.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	6.76	102,664.12	
	HALMA PLC	4,416	24.32	107,397.12	
	BT GROUP PLC	129,623	1.23	159,436.29	
	VODAFONE GROUP PLC	360,190	1.19	430,499.08	
	NATIONAL GRID PLC	46,737	9.53	445,684.03	
	SEVERN TRENT PLC	2,734	25.01	68,377.34	
	SSE PLC	14,351	13.62	195,460.62	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	9.14	71,643.24	
	英ポンド 小計	3,797,440		19,405,745.68 (2,684,396,799)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	17.63	50,242.11	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	821.50	64,077.00	
	GIVAUDAN-REG	124	3,695.00	458,180.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	7,141	45.73	326,557.93	
	SIKA AG-REG	1,908	234.60	447,616.80	
	ABB LTD-REG	24,382	24.53	598,090.46	
	GEBERIT AG-REG	504	559.40	281,937.60	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	242.60	52,159.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	246.30	114,036.90	
	ADECCO SA-REG	1,516	52.60	79,741.60	
	SGS SA-REG	67	2,616.00	175,272.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	609	192.15	117,019.35	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6,992	74.60	521,603.20	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	226.70	92,947.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	44.12	11,074.12	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,014.00	84,588.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	15	7,910.00	118,650.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	84,200.00	84,200.00	
	NESTLE SA-REG	38,555	106.06	4,089,143.30	
	ALCON INC	6,601	59.84	395,003.84	
	SONOVA HOLDING AG-REG	614	233.80	143,553.20	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	1,060.00	122,960.00	
	LONZA GROUP AG-REG	985	604.40	595,334.00	

	NOVARTIS AG-REG	28,858	78.40	2,262,467.20	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,120	313.10	2,855,472.00	
	VIFOR PHARMA AG	638	123.50	78,793.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	97.30	26,562.90	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,933	10.73	353,535.75	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,587	48.54	125,572.98	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	259	922.40	238,901.60	
	UBS GROUP AG-REG	48,789	12.43	606,691.21	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	150.20	98,831.60	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	378.70	139,361.60	
	SWISS RE AG	4,010	78.18	313,501.80	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,988	349.70	695,203.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	83.75	93,548.75	
	TEMENOS GROUP AG-REG	737	111.90	82,470.30	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,319	75.06	174,064.14	
	SWISSCOM AG-REG	301	479.60	144,359.60	
	スイスフラン 小計	229,393		17,313,325.44 (1,987,050,360)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	203.10	223,206.90	
	BOLIDEN AB	4,039	269.10	1,086,894.90	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	6,034	131.70	794,677.80	
	ALFA LAVAL AB	4,566	199.20	909,547.20	
	ASSA ABLOY AB-B	13,841	215.80	2,986,887.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,124	435.70	3,975,326.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	5,552	380.30	2,111,425.60	
	EPIROC AB-A	9,564	144.25	1,379,607.00	
	EPIROC AB-B	4,649	135.00	627,615.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	231.40	338,769.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,084	240.30	741,085.20	
	SANDVIK AB	15,627	183.70	2,870,679.90	
	SKANSKA AB-B SHS	4,937	202.90	1,001,717.30	
	SKF AB-B SHARES	4,538	208.00	943,904.00	
	VOLVO AB-B SHS	20,302	194.00	3,938,588.00	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	145.10	556,168.30	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	205.50	314,826.00	

	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	90.30	256,181.10	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,877	649.40	1,218,923.80	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	168.45	1,615,603.95	
	ICA GRUPPEN AB	1,462	407.30	595,472.60	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	688.40	1,376,111.60	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,201	273.30	2,241,333.30	
	NORDEA BANK ABP	43,708	72.31	3,160,525.48	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,719	90.18	1,688,079.42	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,862	83.80	1,496,835.60	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,556	155.28	1,639,135.68	
	EQT AB	2,344	191.25	448,290.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	253.80	597,191.40	
	INVESTOR AB-B SHS	6,250	594.20	3,713,750.00	
	KINNEVIK AB - B	2,331	399.25	930,651.75	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	444.20	408,664.00	
	ERICSSON LM-B SHS	39,493	102.75	4,057,905.75	
	HEXAGON AB-B SHS	3,933	703.60	2,767,258.80	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	107.15	795,481.60	
	TELIA CO AB	31,100	36.10	1,122,710.00	
	スウェーデンクローナ 小計	326,745		54,931,033.13 (663,017,569)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	14,162	134.35	1,902,664.70	
	NORSK HYDRO ASA	8,106	32.77	265,633.62	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	368.60	1,021,759.20	
	ADEVINTA ASA	3,943	139.90	551,625.70	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	316.20	174,542.40	
	MOWI ASA	5,643	181.95	1,026,743.85	
	ORKLA ASA	11,182	88.06	984,686.92	
	DNB ASA	13,159	150.40	1,979,113.60	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	191.30	511,536.20	
	TELENOR ASA	9,278	154.35	1,432,059.30	
	ノルウェークローネ 小計	71,471		9,850,365.49 (112,786,684)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	651.40	793,405.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,451	374.90	918,879.90	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	1,172.50	3,172,785.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	10,430.00	406,770.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	74	11,360.00	840,640.00	
	DSV PANALPINA A S	2,852	1,015.00	2,894,780.00	
	PANDORA A/S	1,082	596.00	644,872.00	
	CARLSBERG AS-B	1,203	945.40	1,137,316.20	
	AMBU A/S-B	1,526	206.80	315,576.80	
	COLOPLAST-B	1,680	960.20	1,613,136.00	
	DEMANT A/S	550	222.10	122,155.00	
	GN STORE NORD A/S	1,892	475.10	898,889.20	
	GENMAB A/S	907	2,280.00	2,067,960.00	
	H LUNDBECK A/S	120	194.10	23,292.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	22,611	429.00	9,700,119.00	
	DANSKE BANK A/S	9,894	100.10	990,389.40	
	TRYG A/S	694	187.90	130,402.60	
	ORSTED A/S	2,606	1,110.00	2,892,660.00	
	デンマーククローネ 小計	54,105		29,564,028.30 (491,649,790)	
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	27.59	83,101.08	
	OIL SEARCH LTD	14,702	3.66	53,809.32	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.66	123,061.28	
	SANTOS LTD	26,550	5.76	152,928.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	27.65	9,871.05	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	20.61	280,481.49	
	BHP GROUP LTD	38,850	35.77	1,389,664.50	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	16.16	101,096.96	
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	5.99	96,678.60	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,433	16.59	388,753.47	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	38.38	255,457.28	
	NEWCREST MINING LTD	11,374	29.84	339,400.16	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	15.11	111,466.47	
	ORICA LTD	6,263	16.41	102,775.83	
	RIO TINTO LTD	5,096	96.09	489,674.64	
	SOUTH32 LTD	74,829	2.21	165,372.09	
CIMIC GROUP LTD	682	22.89	15,610.98		

BRAMBLES LTD	17,428	10.67	185,956.76
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.90	89,840.40
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	5.11	44,457.00
SYDNEY AIRPORT	12,027	6.72	80,821.44
TRANSURBAN GROUP	37,559	15.26	573,150.34
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,885	32.44	223,349.40
CROWN RESORTS LTD	773	9.38	7,250.74
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	4.06	86,205.98
REA GROUP LTD	563	138.17	77,789.71
SEEK LTD	3,309	24.90	82,394.10
WESFARMERS LTD	15,132	48.52	734,204.64
COLES GROUP LTD	18,622	17.76	330,726.72
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,961	38.06	645,535.66
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	12.66	65,439.54
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	9.18	64,719.00
COCHLEAR LTD	742	231.41	171,706.22
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	66.88	183,920.00
SONIC HEALTHCARE LTD	5,181	34.30	177,708.30
CSL LTD	5,952	309.46	1,841,905.92
AUST AND NZ BANKING GROUP	37,603	20.58	773,869.74
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	23,131	73.14	1,691,801.34
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	42,284	21.20	896,420.80
WESTPAC BANKING CORP	47,676	18.34	874,377.84
AMP LTD	36,656	1.74	63,781.44
ASX LTD	2,263	81.85	185,226.55
MACQUARIE GROUP LTD	4,578	141.17	646,276.26
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	60.51	94,214.07
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	5.23	184,571.93
MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.90	97,492.20
QBE INSURANCE GROUP LTD	17,256	9.73	167,900.88
SUNCORP GROUP LTD	19,255	9.16	176,375.80
LENDLEASE GROUP	8,292	14.28	118,409.76
AFTERPAY LTD	2,984	101.85	303,920.40
COMPUTERSHARE LTD	5,604	13.53	75,822.12
WISETECH GLOBAL LTD	1,600	32.03	51,248.00

	TELSTRA CORP LTD	50,525	3.13	158,143.25	
	TPG TELECOM LTD	287	7.72	2,215.64	
	AGL ENERGY LTD	7,599	12.87	97,799.13	
	APA GROUP	13,816	10.60	146,449.60	
	AUSNET SERVICES	1,437	2.00	2,874.00	
	オーストラリアドル 小計	883,978		16,635,475.82	(1,269,286,805)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.74	172,524.60	
	A2 MILK CO LTD	7,857	15.32	120,369.24	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	33.83	224,495.88	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	15.55	85,618.30	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.61	105,761.95	
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.00	43,200.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	6.30	144,641.70	
	ニュージーランドドル 小計	95,365		896,611.67	(64,511,209)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,000	54.20	2,113,800.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	16,500	101.60	1,676,400.00	
	MTR CORP	19,500	41.65	812,175.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	59.25	1,896,000.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	32.85	1,018,350.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	9.18	18,360.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	13.30	69,160.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	24.70	543,400.00	
	WH GROUP LTD	152,000	6.70	1,018,400.00	
	MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	29.85	358,200.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	15.60	56,160.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	24.00	1,056,000.00	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	129.30	1,163,700.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	16,200	371.00	6,010,200.00	
	AIA GROUP LTD	159,200	84.75	13,492,200.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	41.45	1,658,000.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	20.45	552,150.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	30.80	428,612.80	
KERRY PROPERTIES LTD	500	20.80	10,400.00		

	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	40.00	1,040,000.00	
	SINO LAND CO	18,000	9.70	174,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	104.20	2,052,740.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	43.25	181,650.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	24.30	121,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	37.05	852,150.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.10	333,300.00	
	PCCW LTD	4,000	4.75	19,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	39.40	173,360.00	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	73.65	1,767,600.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.85	243,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	156,874	12.04	1,888,762.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	41.30	743,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	84.65	135,440.00	
	香港ドル 小計	1,013,390		43,678,520.76 (589,660,030)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	4.87	92,530.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.74	44,880.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	0.92	1,387.50	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	3.83	100,729.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.74	60,196.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	19.83	1,983.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.27	107,604.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,500	23.88	585,060.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,800	9.58	438,764.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,600	21.47	356,402.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	9.11	104,765.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	2.84	141,432.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.25	21,750.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.02	14,742.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	19.00	77,900.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.30	283,130.00	
	シンガポールドル 小計	445,400		2,433,254.50 (189,234,202)	
イスラエルシュ	ICL GROUP LTD	4,122	13.47	55,523.34	



ケル	ELBIT SYSTEMS LTD	381	394.10	150,152.10	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	21.47	391,419.57	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	17.69	317,075.56	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	10.90	81,957.10	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	73.45	103,858.30	
	AZRIELI GROUP	234	192.30	44,998.20	
	NICE SYSTEMS LTD	731	801.80	586,115.80	
	イスラエルシュケル 小計	50,556		1,731,099.97	(53,785,276)
	合 計	13,807,402		58,618,046,671	(58,618,046,671)

(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	71,718.01	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	287,976.24	
		AMERICAN TOWER CORP	5,813	1,413,082.17	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	121,475.79	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	330,043.66	
		BOSTON PROPERTIES INC	1,674	153,371.88	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	111,143.48	
		CROWN CASTLE INTL CORP	5,513	926,239.13	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	521,029.30	
		DUKE REALTY CORP	4,194	169,144.02	
		EQUINIX INC	1,170	890,147.70	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	153,081.45	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,175	311,276.25	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	753	191,947.23	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,476	173,754.72	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	54,585.99	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	225,974.26	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	86,231.00			

	INVITATION HOMES INC	7,683	224,113.11	
	IRON MOUNTAIN INC	4,068	103,693.32	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	115,080.80	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,301	172,187.35	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	58,606.24	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	82,295.60	
	PROLOGIS INC	9,749	1,009,313.97	
	PUBLIC STORAGE	2,131	498,760.55	
	REALTY INCOME CORP	4,769	300,685.45	
	REGENCY CENTERS CORP	1,514	69,235.22	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	459,040.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	318,072.60	
	SUN COMMUNITIES INC	1,389	203,669.07	
	UDR INC	3,355	130,408.85	
	VENTAS INC	4,246	212,724.60	
	VEREIT INC	11,100	81,696.00	
	VICI PROPERTIES INC	5,335	137,696.35	
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	48,484.09	
	WELLTOWER INC	5,753	377,224.21	
	WEYERHAEUSER CO	10,330	301,016.20	
	WP CAREY INC	2,436	170,325.12	
	米ドル 小計	164,147	11,266,550.98	(1,179,495,222)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	48,507.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	27,963.71	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	24,939.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,288.96	
	カナダドル 小計	4,434	102,698.67	(8,195,353)
ユーロ	COVIVIO	522	34,295.40	
	GECINA SA	569	71,694.00	
	ICADE	30	1,828.50	
	KLEPIERRE	1,289	24,091.41	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	113,821.90	
	ユーロ 小計	4,691	245,731.21	(30,455,926)

英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	27,227.80	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	44,973.72	
	SEGRO PLC	13,859	128,112.59	
英ポンド 小計		26,244	200,314.11	(27,709,450)
オーストラリアドル	DEXUS	13,745	129,890.25	
	GOODMAN GROUP	23,275	448,043.75	
	GPT GROUP	15,542	72,581.14	
	MIRVAC GROUP	63,099	164,057.40	
	SCENTRE GROUP	83,252	219,785.28	
	STOCKLAND	29,890	131,516.00	
	VICINITY CENTRES	42,168	66,836.28	
オーストラリアドル 小計		270,971	1,232,710.10	(94,055,780)
香港ドル	LINK REIT	31,300	2,137,790.00	
香港ドル 小計		31,300	2,137,790.00	(28,860,165)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	125,552.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	40,360	80,720.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	46,000.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	75,845.00	
	SUNTEC REIT	8,500	12,580.00	
シンガポールドル 小計		151,660	340,697.00	(26,496,005)
合計			1,395,267,901	(1,395,267,901)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 591銘柄	97.3%		70.2%
	投資証券 39銘柄		2.7%	2.0%

カナダドル	株式	82銘柄	99.6%		3.3%
	投資証券	4銘柄		0.4%	0.0%
ユーロ	株式	239銘柄	99.5%		10.7%
	投資証券	5銘柄		0.5%	0.1%
英ポンド	株式	84銘柄	99.0%		4.5%
	投資証券	3銘柄		1.0%	0.0%
スイスフラン	株式	39銘柄	100.0%		3.3%
スウェーデンクローナ	株式	36銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	93.1%		2.1%
	投資証券	7銘柄		6.9%	0.2%
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	95.3%		1.0%
	投資証券	1銘柄		4.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	16銘柄	87.7%		0.3%
	投資証券	5銘柄		12.3%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年11月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	2,075,502,123

2020年11月16日現在

コール・ローン	44,042,611
株式	8,791,196,312
投資証券	5,632,183
派生商品評価勘定	210,603,826
未収配当金	6,096,660
差入委託証拠金	600,183,164
流動資産合計	11,733,256,879
資産合計	11,733,256,879
負債の部	
流動負債	
未払金	3,928,229
未払解約金	42,080,000
未払利息	119
流動負債合計	46,008,348
負債合計	46,008,348
純資産の部	
元本等	
元本	8,174,978,820
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,512,269,711
元本等合計	11,687,248,531
純資産合計	11,687,248,531
負債純資産合計	11,733,256,879

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	7,415,252,343円
期中追加設定元本額	7,599,025,997円
期中一部解約元本額	6,839,299,520円
期末元本額	8,174,978,820円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	553,509,502円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,083,880,097円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,074,426,875円
DCりそな グローバルバランス	9,907,354円
つみたてバランスファンド	346,457,860円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	283,921,938円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	144,001,701円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	84,657,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	7,220,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,108,065円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,077,412円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,153,569円
リスクコントロール・オープン	5,432,369円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	81,389,385円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	62,522,515円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,036,108,989円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,018,036,373円
Smart-i 8資産バランス 安定型	42,505,837円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	102,404,224円
Smart-i 8資産バランス 成長型	114,044,826円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	311,183,821円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	247,422,490円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	142,272,654円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	92,355,993円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	273,583,536円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	45,260,487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)	1,133,309円
2. 計算日における受益権の総数	8,174,978,820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	1.4296円
(10,000口当たり純資産額)	(14,296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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		804,820,918
投資証券		3,274,120
合計		801,546,798

(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11月16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	2,661,744,297	-	2,872,348,123	210,603,826
	合計	2,661,744,297	-	2,872,348,123	210,603,826

## （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11月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	13,085,000	-	13,085,000	-
	米ドル	13,085,000	-	13,085,000	-
	合計	13,085,000	-	13,085,000	-

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	72,632	4.57	332,509.29	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.64	5,248.00	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,076	62.48	317,148.48	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,144	158.00	180,752.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	13,717	5.34	73,331.08	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	4.56	67,195.28	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,978	38.70	115,248.60	

YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	4.57	8,683.00
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,090	11.36	23,742.40
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	6.83	21,514.50
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	7,919	26.34	208,586.46
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,840	25.36	46,662.40
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	12.82	30,075.72
POLYUS PJSC-REG S-GDR	875	105.80	92,575.00
SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	14.20	45,440.00
SOUTHERN COPPER CORP	1,085	54.39	59,013.15
51JOB INC-ADR	300	69.70	20,910.00
BEST INC - ADR	1,500	3.23	4,845.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	4,700	32.73	153,831.00
NIO INC - ADR	13,000	44.56	579,280.00
XPENG INC - ADR	1,300	41.99	54,587.00
GSX TECHEDU INC- ADR	1,000	70.10	70,100.00
HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,000	46.60	93,200.00
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,850	173.38	320,753.00
TAL EDUCATION GROUP- ADR	4,600	74.59	343,114.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	4,750	57.76	274,360.00
AUTOHOME INC-ADR	720	102.82	74,030.40
BAIDU INC - SPON ADR	3,250	145.08	471,510.00
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,500	48.90	73,350.00
HUYA INC-ADR	900	21.52	19,368.00
IQIYI INC-ADR	2,900	26.70	77,430.00
JOYY INC	720	94.12	67,766.40
MOMO INC-SPON ADR	1,950	15.87	30,946.50
NETEASE INC-ADR	4,910	88.27	433,405.70
SINA CORP	630	43.27	27,260.10
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,600	16.49	75,854.00
WEIBO CORP-SPON ADR	630	46.38	29,219.40
YANDEX NV-A	3,700	62.11	229,807.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	22,430	260.84	5,850,641.20
BAOZUN INC-SPN ADR	500	41.61	20,805.00
JD.COM INC-ADR	10,220	92.08	941,057.60
PINDUODUO INC-ADR	3,300	151.29	499,257.00

	TRIP.COM GROUP LTD	5,750	34.65	199,237.50	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	5,500	23.03	126,665.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,288	14.70	63,033.60	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,456	35.42	51,571.52	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	900	31.76	28,584.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	800	103.50	82,800.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	18,976	3.94	74,765.44	
	CREDICORP LTD	844	125.18	105,651.92	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	32,945	12.93	425,978.85	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.90	20,101.76	
	LUFAX HOLDING LTD	2,100	19.22	40,362.00	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	30.55	15,275.00	
	KE HOLDINGS INC	1,200	72.53	87,036.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.81	8,174.88	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,000	93.44	93,440.00	
	GLOBANT SA	440	187.48	82,491.20	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,500	8.29	45,595.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	6.96	6,055.20	
	米ドル 小計	355,973		14,021,232.53	
				(1,467,882,833)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	189,600	9.07	1,719,672.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	38,300	65.19	2,496,777.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	332.59	615,291.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	38.37	544,854.00	
	ALFA S.A.B. -A	34,600	15.39	532,494.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	45.17	153,578.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,100	200.26	1,021,326.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,070	309.32	640,292.40	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	160.13	440,357.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	26,000	33.41	868,660.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	68.40	150,480.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	64,400	55.72	3,588,368.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	96.41	462,768.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	49.14	260,442.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	5,600	91.90	514,640.00	

	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	23,700	139.67	3,310,179.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	222.21	634,409.55	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	20,400	43.49	887,196.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	32.57	537,405.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	31,700	101.41	3,214,697.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	30,800	19.04	586,432.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	405,600	14.27	5,787,912.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	74.58	462,396.00	
	メキシコペソ 小計	937,925		29,430,626.95	
				(151,567,728)	
ブラジルリアル	COSAN SA	2,000	78.44	156,880.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	44,700	23.18	1,036,146.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	57,200	22.63	1,294,436.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,600	20.65	156,940.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	24.70	56,810.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	19.29	140,817.00	
	GERDAU SA-PREF	11,500	20.93	240,695.00	
	KLABIN SA - UNIT	7,400	24.44	180,856.00	
	SUZANO SA	9,007	51.94	467,823.58	
	VALE SA	44,400	63.25	2,808,300.00	
	WEG SA	10,550	82.87	874,278.50	
	CCR SA	13,400	11.75	157,450.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	8,010	67.00	536,670.00	
	RUMO SA	17,100	19.30	330,030.00	
	COGNA EDUCACAO	18,400	4.76	87,584.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,800	75.27	210,756.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	11,200	24.05	269,360.00	
	LOJAS RENNER S.A.	9,800	45.67	447,566.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	35,600	25.10	893,560.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	9,600	21.59	207,264.00	
	VIA VAREJO SA	15,900	17.85	283,815.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	19.41	58,230.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	69.60	118,320.00	
	RAIA DROGASIL SA	14,000	27.03	378,420.00	
	AMBEV SA	57,300	15.11	865,803.00	

	BRF SA	5,900	19.79	116,761.00	
	JBS SA	13,600	21.18	288,048.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	9,600	51.03	489,888.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,400	73.29	175,896.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,000	74.50	447,000.00	
	HYPERA SA	4,000	29.66	118,640.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	13,720	21.74	298,272.80	
	BANCO BRADESCO SA-PREF	53,590	24.19	1,296,342.10	
	BANCO DO BRASIL S.A.	10,700	33.05	353,635.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	35.73	157,212.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	58,400	28.47	1,662,648.00	
	ITAUSA SA	54,000	10.65	575,100.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	25,200	53.70	1,353,240.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	80.70	209,820.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,300	27.14	198,122.00	
	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	12,600	6.71	84,546.00	
	PORTO SEGURO SA	700	48.85	34,195.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	3,100	41.70	129,270.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	22.45	49,390.00	
	CIELO SA	11,700	3.70	43,290.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	5,600	44.62	249,872.00	
	TIM SA	9,000	13.02	117,180.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	33.57	114,138.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,200	32.39	103,648.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,619	11.32	120,207.08	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	68.57	75,427.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,600	44.60	160,560.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	30.60	70,380.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	45.50	91,000.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	43.33	98,575.75	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,900	21.14	251,566.00	
	ブラジルリアル 小計	778,471		21,792,679.81	
				(417,547,745)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,205	6,289.00	26,445,245.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	1,650.00	24,457,950.00	

	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,512	33,222.00	50,231,664.00	
	FALABELLA SA	6,932	2,675.00	18,543,100.00	
	CENCOSUD SA	18,824	1,298.00	24,433,552.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,364.90	9,308,101.50	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,615.10	4,603,035.00	
	BANCO DE CHILE	601,649	71.44	42,981,804.56	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	594	26,980.00	16,026,120.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	716,617	34.44	24,680,289.48	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,223.00	6,365,715.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,858	4,750.00	8,825,500.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	196.00	3,529,176.00	
	COLBUN SA	83,944	129.89	10,903,486.16	
	ENEL AMERICAS SA	443,665	115.40	51,198,941.00	
	ENEL CHILE SA	369,172	55.18	20,370,910.96	
	チリペソ 小計	2,291,591		342,904,590.66	
				(46,772,186)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	49,667	2,000.00	99,334,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	26,330.00	66,930,860.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,980	26,620.00	159,187,600.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	21,730.00	56,237,240.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,890	22,520.00	110,122,800.00	
	コロンビアペソ 小計	65,667		491,812,500.00	
				(14,115,018)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	9.58	7,514.64	
	OPAP SA	2,135	8.49	18,126.15	
	JUMBO SA	1,515	14.10	21,361.50	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,534	12.16	30,813.44	
	ユーロ 小計	6,968		77,815.73	
				(9,644,481)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	3,050	16.99	51,834.75	
	英ポンド 小計	3,050		51,834.75	
				(7,170,300)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	88.70	155,668.50	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,119	11.10	178,920.90	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	18.35	145,148.50	

	KOC HOLDING AS	8,691	18.92	164,433.72	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	6.81	115,770.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	11.50	63,250.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	116.60	61,914.60	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,969	68.90	411,264.10	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	22.60	43,392.00	
	AKBANK T.A.S.	43,035	6.31	271,550.85	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	8.86	281,048.06	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	6.93	83,853.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.90	85,874.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	10.70	129,031.30	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,983	16.19	194,004.77	
	トルコリラ 小計	205,905		2,385,125.10	
				(32,700,065)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	554.00	414,946.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	59.10	416,359.50	
	CEZ AS	2,147	471.00	1,011,237.00	
	チェココルナ 小計	9,941		1,842,542.50	
				(8,641,524)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	1,895.00	10,287,955.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,497	6,590.00	9,865,230.00	
	OTP BANK PLC	2,819	12,000.00	33,828,000.00	
	ハンガリーフォリント 小計	9,745		53,981,185.00	
				(18,596,518)	
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	682	32.00	21,824.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,010	45.76	183,497.60	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	19,031	4.68	89,217.32	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,815	135.55	246,023.25	
	LPP SA	14	6,915.00	96,810.00	
	CD PROJEKT SA	857	363.40	311,433.80	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	26.86	85,737.12	
	ALLEGRO.EU SA	3,100	75.88	235,228.00	
	DINO POLSKA SA	528	265.20	140,025.60	
	BANK PEKAO SA	1,997	53.90	107,638.30	
	MBANK SA	165	160.70	26,515.50	

	PKO BANK POLSKI SA	11,255	25.15	283,063.25	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	171.30	45,394.50	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,829	24.42	191,184.18	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.55	30,778.45	
	PGE SA	9,929	6.09	60,467.61	
	ポーランドズロチ 小計	69,368		2,154,838.48	
				(59,451,993)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	5.39	64,680.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	302,000	3.52	1,063,040.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	43,000	14.32	615,760.00	
	CNOOC LTD	219,000	8.54	1,870,260.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.25	32,500.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	268,000	2.41	645,880.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	6.02	84,280.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	2.07	62,100.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	15,500	52.60	815,300.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	26,000	6.44	167,440.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	3.26	156,480.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	10.60	508,800.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	28,000	10.50	294,000.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	10.06	150,900.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	5.82	58,200.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	11.30	226,000.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	1.58	53,720.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	10.34	134,420.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	74,000	6.58	486,920.00	
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	4.23	109,980.00	
	BOC AVIATION LTD	2,200	63.25	139,150.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	60,000	4.33	259,800.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	4.61	129,080.00	
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	36.70	770,700.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	13.10	170,300.00	
	CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	23,500	5.58	131,130.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	3.92	172,480.00	
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	5.56	166,800.00	



CITIC LTD	77,000	6.19	476,630.00
CRRIC CORP LTD - H	51,000	3.26	166,260.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	34,500	10.94	377,430.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	21.90	175,200.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	2.30	46,000.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	11.64	46,560.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	3.19	55,825.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	19.32	154,560.00
WEICHAO POWER CO LTD-H	26,000	17.48	454,480.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	11.56	69,360.00
ZHUZHOU CRRIC TIMES ELECTRI-H	6,700	25.40	170,180.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	7.30	143,080.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	4,750	35.75	169,812.50
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	41,000	4.24	173,840.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	17,000	48.60	826,200.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	8.51	170,200.00
AIR CHINA LTD-H	18,000	5.83	104,940.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.84	116,800.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	3.45	48,300.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	9.90	178,200.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.59	119,340.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	39,000	6.22	242,580.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	5.36	96,480.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	8.89	106,680.00
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	7.56	30,240.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15,500	13.24	205,220.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	5.78	104,040.00
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	3.14	39,250.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.33	249,220.00
BYD CO LTD-H	8,000	181.90	1,455,200.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	7.63	244,160.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	37.20	193,440.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	72,000	20.70	1,490,400.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	13.36	467,600.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	40,000	8.50	340,000.00

ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	13,000	101.50	1,319,500.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	3.07	73,680.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	14,000	36.60	512,400.00
LI NING CO LTD	26,500	42.40	1,123,600.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	10,300	135.00	1,390,500.00
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	16.68	100,080.00
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	11,000	14.74	162,140.00
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.04	84,480.00
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10,000	55.50	555,000.00
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	27.10	67,750.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.03	144,200.00
CHINA LITERATURE LTD	4,200	60.55	254,310.00
TENCENT HOLDINGS LTD	68,500	602.00	41,237,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	0.94	130,660.00
MEITUAN	42,600	305.80	13,027,080.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	13.78	115,752.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	11.04	154,560.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	59.00	354,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	8.20	258,300.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	93.18	102,498.00
CHINA FEIHE LTD	16,000	17.26	276,160.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	34,000	41.25	1,402,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	18,000	53.60	964,800.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.91	149,755.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	13.70	356,200.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	66.75	400,500.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	7.23	108,450.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	5.19	275,070.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	95.20	571,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	7,000	56.50	395,500.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	21.55	86,200.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	17.40	69,600.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	38,000	20.30	771,400.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	6,300	103.30	650,790.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	15.90	508,800.00

SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	13.26	149,838.00
SINOPHARM GROUP CO-H	17,600	19.02	334,752.00
3SBIO INC	13,000	7.51	97,630.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	157.00	94,200.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	8.39	134,240.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.06	44,660.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.28	78,720.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	112,000	8.33	932,960.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	11.98	119,800.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	14,000	34.45	482,300.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	12,000	55.35	664,200.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	4.35	76,125.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	35.90	215,400.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	129,250	7.94	1,026,245.00
SSY GROUP LTD	10,000	4.32	43,200.00
WUXI APPTec CO LTD-H	3,624	132.60	480,542.40
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	12,500	244.60	3,057,500.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	340,000	2.85	969,000.00
BANK OF CHINA LTD-H	959,000	2.71	2,598,890.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	111,000	4.18	463,980.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	115,000	3.33	382,950.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,153,000	5.98	6,894,940.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.86	134,420.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	47,500	47.80	2,270,500.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	4.30	322,930.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.30	59,400.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	731,000	4.65	3,399,150.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	4.10	512,500.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.55	162,750.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	11.20	156,800.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	41,000	4.68	191,880.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.90	92,700.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,600	18.30	322,080.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,500	17.18	489,630.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.02	232,580.00

GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	11.30	176,280.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	10.80	82,080.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	30,400	6.72	204,288.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	12.14	211,236.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	90,000	17.50	1,575,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	34,400	26.25	903,000.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.81	44,550.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	17,800	12.38	220,364.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	10,700	30.95	331,165.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	92,000	2.39	219,880.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	86,000	5.78	497,080.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	71,500	86.00	6,149,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	5,200	39.30	204,360.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	11.80	212,400.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	8.33	116,620.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	16.98	407,520.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	74,000	4.13	305,620.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	47,500	20.75	985,625.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	5.22	78,300.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	40,000	36.35	1,454,000.00
CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	27.65	611,065.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	6.28	263,760.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	96,000	10.96	1,052,160.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	15,200	10.40	158,080.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	3.86	142,820.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	11.64	162,960.00
LOGAN GROUP CO LTD	19,000	12.60	239,400.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	22,500	49.55	1,114,875.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	58.00	69,600.00
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	6.79	162,960.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.49	59,760.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	16,000	31.30	500,800.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	1.65	37,950.00
SOHO CHINA LTD	12,000	2.45	29,400.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	32,000	31.85	1,019,200.00

WHARF HOLDINGS LTD	20,000	17.94	358,800.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	104,000	1.59	165,360.00	
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	14,000	3.14	43,960.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.89	58,680.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	29,000	25.50	739,500.00	
KINGSOFT CORP LTD	10,000	41.75	417,500.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	18.84	244,920.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,500	44.90	426,550.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	9,000	35.25	317,250.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	2.85	42,750.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	9,500	26.00	247,000.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	11.80	194,700.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	10.64	36,176.00	
LENOVO GROUP LTD	92,000	5.09	468,280.00	
SUNNY OPTICAL TECH	8,900	152.80	1,359,920.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	128,400	24.25	3,113,700.00	
ZTE CORP-H	8,800	20.75	182,600.00	
CHINA MOBILE LTD	74,000	50.00	3,700,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	168,000	2.49	418,320.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	548,000	1.30	712,400.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	78,000	4.98	388,440.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	25.55	153,300.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.11	180,380.00	
CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.69	185,900.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	33,000	27.60	910,800.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	38,000	6.34	240,920.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.58	93,220.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	37.20	446,400.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	8.38	217,880.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	9,900	102.60	1,015,740.00	
GUANGDONG INVESTMENT LTD	38,000	13.22	502,360.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	3.10	161,200.00	
KUNLUN ENERGY CO LTD	52,000	5.93	308,360.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	30.20	151,000.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	44,500	23.45	1,043,525.00	

	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	13.28	690,560.00	
	香港ドル 小計	10,772,424		154,833,123.90	
				(2,090,247,172)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	50,000	3.81	190,500.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	19.26	55,854.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	30,700	6.78	208,146.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	6.23	104,041.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.69	77,490.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.03	61,028.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.43	80,433.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.18	66,822.00	
	MISC BHD	17,600	7.20	126,720.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.12	28,016.00	
	GENTING BHD	23,100	3.79	87,549.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.43	79,218.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	23.28	23,280.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	31.98	67,158.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.99	29,970.00	
	IOI CORP BHD	32,500	4.55	147,875.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,700	23.14	108,758.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	700	139.70	97,790.00	
	PPB GROUP BERHAD	8,220	19.12	157,166.40	
	QL RESOURCES BHD	10,650	6.40	68,160.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	22,400	5.21	116,704.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	20,800	15.38	319,904.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.40	130,140.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	6.66	110,556.00	
	SUPERMAX CORP BHD	18,800	8.78	165,064.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	57,300	7.78	445,794.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	3.21	75,114.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	80,200	3.44	275,888.00		
HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	16.34	117,648.00		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	15.40	27,720.00		
MALAYAN BANKING BHD	48,400	7.93	383,812.00		
PUBLIC BANK BERHAD	35,400	17.76	628,704.00		

	RHB BANK BHD	18,100	4.94	89,414.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.35	101,840.00	
	DIGI.COM BHD	39,700	4.17	165,549.00	
	MAXIS BHD	30,200	5.20	157,040.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	4.40	35,640.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,400	16.20	168,480.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	29,400	11.32	332,808.00	
	YTL CORP BHD	20,026	0.74	14,819.24	
	マレーシアリングット 小計	860,596		5,728,612.64	
				(145,678,619)	
タイパーツ	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.56	352,512.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,000	90.25	1,353,750.00	
	PTT PCL-NVDR	140,400	37.50	5,265,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	44.75	590,700.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	27.50	453,750.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	25,000	50.75	1,268,750.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	9,600	361.00	3,465,600.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	54,600	65.50	3,576,300.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	9.15	818,925.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	10.20	1,076,100.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.10	255,020.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	35,100	23.20	814,320.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	32.50	670,312.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	64,600	15.00	969,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	34.50	569,250.00	
	CP ALL PCL-NVDR	71,400	62.25	4,444,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	41,700	27.50	1,146,750.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	37.25	242,125.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	15.20	367,840.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	119,000	21.40	2,546,600.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	106.50	639,000.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	118.50	924,300.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	21,300	94.25	2,007,525.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.10	252,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	82.00	811,800.00	

	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	1.02	219,300.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	21.00	384,300.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	43.25	354,650.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	57.00	433,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	53.50	481,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	51.50	1,514,100.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	7.40	713,360.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	14,800	174.50	2,582,600.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	54.50	1,558,700.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	9,700	33.50	324,950.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.12	265,512.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	48.50	460,750.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	193.00	772,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	45.00	805,500.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	68.75	501,875.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	32,200	35.75	1,151,150.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	53.50	599,200.00	
	タイパーツ 小計	1,743,025		48,005,026.50	
				(166,577,441)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	47.25	1,103,760.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	844.00	3,198,760.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	554.00	387,800.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,131	72.00	2,889,432.00	
	SM INVESTMENTS CORP	3,185	1,030.00	3,280,550.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	128.70	1,505,790.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	193.20	869,400.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	43.00	408,500.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,750	150.30	1,465,425.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	81.70	541,671.00	
	BDO UNIBANK INC	21,220	93.00	1,973,460.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	44.50	592,384.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.17	604,650.00	
	AYALA LAND INC	105,400	39.50	4,163,300.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	3.50	343,000.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	15.50	379,750.00	



	SM PRIME HOLDINGS INC	128,800	38.75	4,991,000.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	1,992.00	896,400.00	
	PLDT INC	980	1,394.00	1,366,120.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	27.10	433,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	303.00	951,420.00	
	フィリピンベソ 小計	670,048		32,346,172.00	
				(70,191,193)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,165.00	175,798,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	21,125.00	466,862,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	935.00	352,962,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	9,400.00	252,860,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	14,400.00	191,520,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	11,200.00	360,640,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	250,800	5,900.00	1,479,720,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,755.00	87,750,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	78,300	6,650.00	520,695,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	41,650.00	274,890,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,445.00	131,639,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	9,700.00	317,190,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	7,100.00	342,220,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	7,750.00	780,425,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,495.00	338,617,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	119,200	31,950.00	3,808,440,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	230,800	6,250.00	1,442,500,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	78,800	5,650.00	445,220,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	676,200	4,000.00	2,704,800,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	607,400	2,990.00	1,816,126,000.00	
XL AXIATA TBK PT	28,000	2,290.00	64,120,000.00		
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,180.00	155,170,000.00		
	インドネシアルピア 小計	3,379,700		16,510,166,500.00	
				(122,175,232)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	36,500.00	17,885,000.00	
	S-OIL CORP	483	63,800.00	30,815,400.00	
	SK INNOVATION CO LTD	677	156,000.00	105,612,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,199	49,200.00	58,990,800.00	

HYUNDAI STEEL CO	787	32,000.00	25,184,000.00	
KOREA ZINC CO LTD	93	385,000.00	35,805,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	138,500.00	30,193,000.00	
LG CHEM LTD	552	705,000.00	389,160,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	346,000.00	30,448,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	188	266,500.00	50,102,000.00	
POSCO	898	236,000.00	211,928,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	286	80,400.00	22,994,400.00	
CJ CORP	193	80,300.00	15,497,900.00	
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	313	81,100.00	25,384,300.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	24,200.00	12,438,800.00	
DOOSAN BOBCAT INC	580	32,050.00	18,589,000.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	30,400.00	25,505,600.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	32,500.00	28,210,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	251,000.00	27,610,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	23,700.00	23,700,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	393	92,300.00	36,273,900.00	
LG CORP	1,224	74,500.00	91,188,000.00	
LOTTE CORP	242	32,200.00	7,792,400.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	500	14,000.00	7,000,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,073	120,500.00	129,296,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	11,950.00	19,167,800.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,232	6,010.00	31,444,320.00	
SK HOLDINGS CO LTD	454	209,000.00	94,886,000.00	
S-1 CORPORATION	228	83,200.00	18,969,600.00	
CJ LOGISTICS	135	161,000.00	21,735,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	192,500.00	42,157,500.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	23,950.00	22,872,250.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	4,225.00	13,845,325.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	32,550.00	31,443,300.00	
HANON SYSTEMS	2,393	13,550.00	32,425,150.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	805	240,000.00	193,200,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,800	177,500.00	319,500,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	464	85,900.00	39,857,600.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	85,800.00	14,586,000.00	

KIA MOTORS CORP	3,201	59,200.00	189,499,200.00	
COWAY CO LTD	531	73,200.00	38,869,200.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	44,400.00	29,037,600.00	
HLB INC	571	93,200.00	53,217,200.00	
LG ELECTRONICS INC	1,352	85,600.00	115,731,200.00	
KANGWON LAND INC	1,387	22,400.00	31,068,800.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	499	21,250.00	10,603,750.00	
KAKAO CORP	682	365,500.00	249,271,000.00	
NAVER CORP	1,478	281,000.00	415,318,000.00	
NCSOFT CORP	199	808,000.00	160,792,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	126,000.00	34,146,000.00	
PEARL ABYSS CORP	70	200,200.00	14,014,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	133,500.00	15,085,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	80,400.00	32,722,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	96,700.00	7,736,000.00	
SHINSEGAE INC	54	230,000.00	12,420,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	136,500.00	7,780,500.00	
E-MART INC	257	164,000.00	42,148,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	33,700.00	6,571,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	366,500.00	32,252,000.00	
KT&G CORP	1,420	84,700.00	120,274,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	112,500.00	28,237,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	556,000.00	7,228,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	422	175,000.00	73,850,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	209	49,400.00	10,324,600.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	116	1,576,000.00	182,816,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	705,000.00	10,575,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	836	93,800.00	78,416,800.00	
ALTEOGEN INC	240	160,700.00	38,568,000.00	
CELLTRION INC	1,146	290,000.00	332,340,000.00	
CELLTRION PHARM INC	150	122,800.00	18,420,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	86	284,000.00	24,424,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	207	757,000.00	156,699,000.00	
SEEGENE INC	240	225,000.00	54,000,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	126,000.00	50,400,000.00	

	YUHAN CORP	514	63,800.00	32,793,200.00	
	BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	5,980.00	15,219,100.00	
	HANA FINANCIAL GROUP	3,664	34,650.00	126,957,600.00	
	INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	9,020.00	23,370,820.00	
	KB FINANCIAL GROUP INC	4,777	44,950.00	214,726,150.00	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,544	32,250.00	178,794,000.00	
	WOORI FINANCIAL GROUP INC	5,693	9,770.00	55,620,610.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	557	74,000.00	41,218,000.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,575.00	8,283,275.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	9,450.00	28,321,650.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	10,400.00	16,016,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	217	32,050.00	6,954,850.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	35,250.00	29,046,000.00	
	DB INSURANCE CO LTD	482	46,300.00	22,316,600.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	24,400.00	11,004,400.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	381	195,000.00	74,295,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	752	67,200.00	50,534,400.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	190	105,500.00	20,045,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	430	176,500.00	75,895,000.00	
	KMW CO LTD	357	66,700.00	23,811,900.00	
	LG DISPLAY CO LTD	2,534	14,750.00	37,376,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	153	155,500.00	23,791,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	724	150,500.00	108,962,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	57,181	63,200.00	3,613,839,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	9,959	57,400.00	571,646,600.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	664	501,000.00	332,664,000.00	
	LG UPLUS CORP	2,330	11,500.00	26,795,000.00	
	SK TELECOM	482	229,500.00	110,619,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,411	21,350.00	72,824,850.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	29,100.00	6,547,500.00	
	SK HYNIX INC	6,610	89,700.00	592,917,000.00	
	韓国ウォン 小計	171,503		11,591,757,700.00	
				(1,097,739,454)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	15,000	92.20	1,383,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	43.70	961,400.00	

CHINA STEEL CORP	150,000	21.60	3,240,000.00
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	45,000	76.90	3,460,500.00
FORMOSA PLASTICS CORP	47,000	87.00	4,089,000.00
NAN YA PLASTICS CORP	64,000	64.10	4,102,400.00
TAIWAN CEMENT	61,477	42.25	2,597,403.25
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	807.00	807,000.00
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	27.60	1,076,400.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,174	295.00	936,330.00
EVA AIRWAYS CORP	26,023	11.85	308,372.55
EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	20.10	634,155.00
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	31.30	688,600.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	22,000	39.95	878,900.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	418.50	845,370.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	4,080	187.00	762,960.00
FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	32.25	322,500.00
GIANT MANUFACTURING	3,000	278.00	834,000.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	338.00	676,000.00
POU CHEN	24,000	28.95	694,800.00
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	665.00	2,660,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	268.50	1,611,000.00
STANDARD FOODS CORP	3,120	63.80	199,056.00
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	60,000	68.40	4,104,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	53,616	17.90	959,726.40
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	218,000	19.60	4,272,800.00
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	140,906	26.10	3,677,646.60
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	130,627	21.50	2,808,480.50
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	107,416	18.30	1,965,712.80
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	135,000	29.35	3,962,250.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	102,995	11.20	1,153,544.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	118,769	13.20	1,567,750.80
TAIWAN BUSINESS BANK	44,672	9.83	439,125.76
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	118,374	20.20	2,391,154.80
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	39.90	1,396,500.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,997	159.00	2,543,523.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	125,920	18.50	2,329,520.00

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	99,000	40.55	4,014,450.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	129,000	8.64	1,114,560.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	20.35	567,744.65	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	84,000	45.30	3,805,200.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	111,835	8.53	953,952.55	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,600	43.40	286,440.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	40.70	385,836.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	229.50	1,606,500.00	
ACER INC	38,000	22.55	856,900.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	294.50	1,560,555.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	9,000	246.00	2,214,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	10.55	907,300.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	191.00	1,719,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	85.60	429,284.00	
COMPAL ELECTRONICS	46,000	19.10	878,600.00	
DELTA ELECTRONICS INC	24,000	200.50	4,812,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	51.00	357,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	151,800	81.40	12,356,520.00	
INNOLUX CORP	90,000	9.23	830,700.00	
INVENTEC CORP	28,000	22.90	641,200.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,360.00	3,360,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	27,000	47.05	1,270,350.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	117.00	819,000.00	
PEGATRON CORP	26,000	64.10	1,666,600.00	
QUANTA COMPUTER INC	37,000	71.50	2,645,500.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	42.35	719,950.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	187.00	561,000.00	
WISTRON CORP	29,951	30.30	907,515.30	
WIWYNN CORP	1,000	697.00	697,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	17,960	40.05	719,298.00	
YAGEO CORPORATION	4,198	397.00	1,666,606.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	123.00	738,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	47,000	110.00	5,170,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	61.00	1,037,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	21,000	99.10	2,081,100.00	

	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	70.50	2,890,500.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	423.50	1,270,500.00	
	MEDIATEK INC	18,000	675.00	12,150,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	62.20	746,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	291.50	2,040,500.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	321.00	321,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	89.80	898,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	362.50	2,175,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	2,170.00	2,170,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	294,000	462.00	135,828,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	146,000	31.30	4,569,800.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	96.10	1,153,200.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	318.50	1,274,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	17.40	382,800.00	
	新台湾ドル 小計	3,827,773		299,567,243.46	
				(1,099,411,783)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	8,598	412.85	3,549,684.30	
	COAL INDIA LTD	16,101	127.10	2,046,437.10	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	219.50	1,780,584.00	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	86.65	2,120,672.10	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	72.65	1,924,498.50	
	PETRONET LNG LTD	7,875	254.25	2,002,218.75	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	34,133	2,002.30	68,344,505.90	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	259.00	2,004,660.00	
	ASIAN PAINTS LTD	3,540	2,184.60	7,733,484.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	651.90	1,720,364.10	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	838.60	2,710,355.20	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	12,818	209.30	2,682,807.40	
	JSW STEEL LTD	9,306	341.95	3,182,186.70	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,597	1,580.95	2,524,777.15	
	SHREE CEMENT LTD	113	23,363.25	2,640,047.25	
	TATA STEEL LTD	3,946	492.20	1,942,221.20	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,426	4,908.20	6,999,093.20	
	UPL LTD	5,324	429.25	2,285,327.00	
	VEDANTA LTD	19,986	108.05	2,159,487.30	

HAVELLS INDIA LTD	2,780	827.00	2,299,060.00
LARSEN & TOUBRO LTD	6,199	1,059.20	6,565,980.80
SIEMENS LTD	766	1,369.25	1,048,845.50
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,672	366.10	2,442,619.20
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	412.70	644,637.40
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,614.95	2,097,820.05
BAJAJ AUTO LTD	881	3,041.90	2,679,913.90
BHARAT FORGE LTD	3,030	484.15	1,466,974.50
BOSCH LTD	73	11,849.60	865,020.80
EICHER MOTORS LTD	1,400	2,540.55	3,556,770.00
HERO MOTOCORP LTD	1,227	3,115.70	3,822,963.90
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	9,194	631.35	5,804,631.90
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,468	6,852.25	10,059,103.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	12,820	130.00	1,666,600.00
TATA MOTORS LTD	18,122	148.85	2,697,459.70
PAGE INDUSTRIES LTD	54	21,849.35	1,179,864.90
TITAN CO LTD	4,082	1,286.80	5,252,717.60
JUBILANT FOODWORKS LTD	681	2,475.70	1,685,951.70
INFO EDGE INDIA LTD	655	3,884.40	2,544,282.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	193.10	1,799,112.70
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,002	2,374.15	4,753,048.30
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	626	3,527.35	2,208,121.10
ITC LTD	35,192	188.60	6,637,211.20
NESTLE INDIA LTD	287	16,838.15	4,832,549.05
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	5,490	516.15	2,833,663.50
UNITED SPIRITS LTD	3,058	555.80	1,699,636.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,512.25	1,058,575.00
DABUR INDIA LTD	5,557	517.15	2,873,802.55
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	685.70	3,689,066.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,021	2,187.70	21,922,941.70
MARICO LTD	4,834	370.70	1,791,963.80
AUROBINDO PHARMA LTD	3,700	852.15	3,152,955.00
BIOCON LTD	2,750	434.35	1,194,462.50
CIPLA LTD	3,668	745.75	2,735,411.00
DIVI'S LABORATORIES LTD	854	3,444.95	2,941,987.30



DR. REDDY'S LABORATORIES	1,471	4,872.05	7,166,785.55	
LUPIN LTD	2,363	906.25	2,141,468.75	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,198	1,455.50	1,743,689.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,895	514.00	5,600,030.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,728.05	1,309,464.00	
AXIS BANK LTD	27,430	613.15	16,818,704.50	
BANDHAN BANK LTD	7,394	343.55	2,540,208.70	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	19,738	2,311.25	45,619,452.50	
ICICI BANK LTD	61,367	486.90	29,879,592.30	
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	315.25	733,586.75	
STATE BANK OF INDIA	22,200	229.65	5,098,230.00	
BAJAJ FINANCE LTD	2,285	4,374.80	9,996,418.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,451.65	1,740,671.50	
REC LTD	7,000	114.30	800,100.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	872.30	570,484.20	
BAJAJ FINSERV LTD	402	7,335.55	2,948,891.10	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,748	636.10	5,564,602.80	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,586	1,295.90	3,351,197.40	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	433.55	1,615,840.85	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,992	840.45	4,195,526.40	
DLF LTD	4,542	184.60	838,453.20	
HCL TECHNOLOGIES LTD	13,207	830.50	10,968,413.50	
INFOSYS LTD	40,855	1,133.45	46,307,099.75	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	10,828	2,670.35	28,914,549.80	
TECH MAHINDRA LTD	5,777	840.15	4,853,546.55	
WIPRO LTD	14,289	345.45	4,936,135.05	
BHARTI AIRTEL LTD	15,312	481.50	7,372,728.00	
BHARTI INFRA TEL LTD	2,400	181.35	435,240.00	
GAIL INDIA LTD	17,471	93.50	1,633,538.50	
INDRAPRASTHA GAS LTD	2,160	435.25	940,140.00	
NTPC LTD	25,698	90.90	2,335,948.20	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	23,917	188.00	4,496,396.00	
インドルピー 小計	728,274		508,326,267.95	
			(716,740,037)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	18.77	120,128.00

	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.08	101,525.40	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	10.01	239,369.13	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	4.35	94,656.00	
	MASRAF AL RAYAN	44,940	4.29	193,107.18	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	8.70	81,588.60	
	QATAR ISLAMIC BANK	12,416	16.51	204,988.16	
	QATAR NATIONAL BANK	55,167	18.81	1,037,691.27	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.44	85,194.85	
	OOREDOO QPSC	5,987	6.80	40,717.58	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,015	17.80	107,067.00	
	カタールリアル 小計	259,306		2,306,033.17	
				(65,791,126)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	126.31	353,668.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	677	1,123.84	760,839.68	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,057	372.51	1,883,783.07	
	GOLD FIELDS LTD	10,740	166.32	1,786,276.80	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	75.49	520,503.55	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	9,799	154.42	1,513,161.58	
	KUMBA IRON ORE LTD	703	507.92	357,067.76	
	NORTHAM PLATINUM LTD	3,813	160.28	611,147.64	
	SASOL LTD	7,017	105.00	736,785.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	27,980	51.83	1,450,203.40	
	BIDVEST GROUP LTD	2,876	155.00	445,780.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,613	126.74	584,651.62	
	MR PRICE GROUP LTD	2,802	160.94	450,953.88	
	NASPERS LTD-N SHS	5,210	3,178.00	16,557,380.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	14.00	139,314.00	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,960	39.75	515,160.00	
	BID CORP LTD	4,319	271.22	1,171,399.18	
	CLICKS GROUP LTD	2,589	253.57	656,492.73	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,519	144.33	940,887.27	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	185.89	472,346.49	
TIGER BRANDS LTD	2,099	209.23	439,173.77		
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	16.49	210,461.87		
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,174	125.85	651,147.90		

	ABSA GROUP LTD	7,463	102.39	764,136.57	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	766	1,400.00	1,072,400.00	
	NEDBANK GROUP LTD	3,923	132.93	521,484.39	
	STANDARD BANK GROUP LTD	15,779	126.28	1,992,572.12	
	FIRSTRAND LTD	59,593	47.07	2,805,042.51	
	REINET INVESTMENTS SCA	1,613	288.29	465,011.77	
	REMGRO LTD	7,030	99.00	695,970.00	
	DISCOVERY LTD	4,144	125.74	521,066.56	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	15.85	159,799.70	
	OLD MUTUAL LTD	59,174	12.44	736,124.56	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	32.72	327,658.08	
	SANLAM LTD	21,916	56.93	1,247,677.88	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,106	72.22	296,535.32	
	MTN GROUP LTD	20,781	70.16	1,457,994.96	
	VODACOM GROUP LTD	7,934	127.93	1,014,996.62	
	南アフリカランド 小計	384,215		47,287,056.23	
				(319,660,500)	
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	33,706	6.14	206,954.84	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	4.24	86,665.60	
	EMIRATES NBD PJSC	30,421	10.20	310,294.20	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	32,831	12.46	409,074.26	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	51,017	2.71	138,256.07	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.66	50,918.84	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	36,755	2.87	105,486.85	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,250	17.18	365,075.00	
	アラブディルハム 小計	257,094		1,672,725.66	
				(47,605,772)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	5.70	11,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.02	47,436.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	17.48	26,220.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.93	3,223.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.40	2,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.18	21,318.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	9.94	24,850.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.03	1,809.00	

SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.44	23,828.00
SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	520	5.03	2,615.60
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	29.79	26,811.00
YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.44	9,355.04
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.31	6,951.00
ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.87	2,238.60
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	54.98	153,944.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	6.35	50,800.00
BBMG CORPORATION-A	900	3.04	2,736.00
BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,800	39.44	70,992.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	17.23	49,967.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.35	29,580.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	11.73	5,865.00
GEM CO LTD-A	3,500	4.92	17,220.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	5.58	7,812.00
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	42.94	21,470.00
GUOCHENG MINING CO LTD-A	900	10.62	9,558.00
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	23.45	84,889.00
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	13.99	27,280.50
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.17	3,255.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	24.64	27,104.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	5.59	19,565.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.18	21,122.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.89	20,615.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	15.84	30,096.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	107.00	32,100.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	15.92	4,776.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	74.01	14,802.00
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.06	2,424.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	30.06	51,102.00
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.72	1,904.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.37	17,064.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	23.24	79,016.00
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	6.87	14,427.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,568	24.45	38,337.60

SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	34.30	48,020.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.71	27,100.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	39.65	31,720.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	14.95	32,890.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	114.90	34,470.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.60	17,280.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.36	2,016.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	15.86	17,446.00
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	24.58	4,916.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	18.76	28,140.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.42	3,630.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.55	7,215.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	87.90	202,170.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	72.82	29,128.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	14.83	17,796.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.72	23,133.60
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	107.10	64,260.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	49.94	12,984.40
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	6.94	15,962.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	14.12	5,648.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	9.43	3,772.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	7.64	135,228.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	19.24	19,240.00
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	38.34	53,676.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	2,500	26.50	66,250.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.52	31,560.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,100	52.63	57,893.00
AVICOPTER PLC-A	500	50.01	25,005.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	39.81	55,734.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	2.70	27,000.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	6.57	15,111.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	16.20	1,620.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	7.60	2,280.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.91	3,455.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	15.05	13,545.00

CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.74	2,870.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	7,400	8.36	61,864.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.48	50,416.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	10,300	4.22	43,466.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	32.01	3,201.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.25	156,450.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,900	253.21	481,099.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.73	4,095.00
CRRC CORP LTD-A	18,500	5.51	101,935.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	10.24	6,144.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	67.40	102,448.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.68	2,785.56
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	28.22	28,220.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	48.70	29,220.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	49.58	14,874.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	10.19	14,266.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	92.30	95,622.80
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	10.76	27,976.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.63	4,734.00
NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	900	20.02	18,018.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	23.60	83,520.40
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.87	15,480.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	28.16	174,592.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.02	16,912.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.14	4,112.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	5.71	1,713.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	81.83	57,281.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	13.80	17,940.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	29.64	38,532.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	10.47	4,188.00
TBEA CO LTD-A	400	8.12	3,248.00
WEICHAO POWER CO LTD-A	2,700	16.92	45,684.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	5.15	5,665.00
XIAMEN C & D INC-A	300	8.70	2,610.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.74	4,696.00

ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	31.30	62,600.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	100.73	42,306.60
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	25.60	76,544.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	19.50	25,350.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	17.60	3,520.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	7.46	47,744.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	8.64	22,464.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	26.65	37,310.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	83.70	66,960.00
AIR CHINA LTD-A	800	7.45	5,960.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	10,400	5.73	59,592.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.82	6,266.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.93	53,963.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	7.78	9,336.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.45	71,595.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	14.38	11,504.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	11.59	8,113.00
S F HOLDING CO LTD-A	1,800	80.83	145,494.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	75.93	75,930.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.45	4,450.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	8.45	16,055.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.53	9,060.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	47.15	4,715.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	18.49	21,633.30
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	7.05	22,560.00
BYD CO LTD -A	800	175.90	140,720.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	200.00	40,000.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	17.07	8,535.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	41.24	8,248.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	33.26	46,564.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	26.00	31,200.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	37.23	29,784.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	26.19	180,972.90
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	34.03	3,403.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	26.27	2,627.00

ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	7.26	14,520.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	2,700	66.26	178,902.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	28.40	161,880.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	43.31	4,331.00
JOYOUNG CO LTD -A	600	36.69	22,014.00
NAVINFO CO LTD-A	900	15.36	13,824.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	132.40	18,536.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	29.67	11,868.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	7.18	44,516.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	64.58	19,374.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	8.25	3,300.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	72.66	21,798.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	21.21	16,968.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	42.05	42,050.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	51.29	30,774.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.91	7,601.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	17.91	19,342.80
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	12.11	15,743.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	22.73	18,184.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	12.82	2,564.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.31	2,062.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	11.44	1,144.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	9.50	114,950.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	434.86	43,486.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	17.65	3,530.00
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.30	13,530.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	69.86	91,516.60
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	17.62	19,382.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.33	2,799.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	28.20	38,070.00
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	18.23	16,407.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	27.05	24,345.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	16.52	6,608.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	7.99	23,970.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,300	192.50	250,250.00



LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	23.20	4,640.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.40	47,000.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	9.22	30,426.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.55	27,300.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	70.80	19,824.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	108.36	45,511.20
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	7.89	24,459.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	47.60	33,320.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	228.35	68,505.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	63.00	31,500.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	7.85	3,925.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	54.04	32,424.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	8.02	19,248.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	53.58	21,432.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	103.86	41,544.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	37.89	26,523.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,800	162.81	293,058.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	24.67	22,203.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	59.10	76,830.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	17.04	42,600.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	48.18	115,632.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	38.32	160,944.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	51.04	51,040.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,000	174.97	174,970.00
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	2,000	16.89	33,780.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	62.40	18,720.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	82.08	24,624.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	900	1,705.00	1,534,500.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	186.69	186,690.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,940	70.08	206,035.20
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	25.85	67,210.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	800	250.10	200,080.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	76.29	30,516.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	61.04	30,520.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	30.92	102,036.00

TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	84.95	8,495.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	18.55	104,993.00
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,900	265.00	768,500.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	16.30	17,930.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	27.09	35,217.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	21.10	21,100.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	178.88	17,888.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	39.93	23,958.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,521	68.85	242,420.85
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	156.06	15,606.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	50.94	10,188.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	43.52	17,408.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	86.20	17,240.00
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	300	68.90	20,670.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	29.19	7,005.60
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	68.75	26,125.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	28.42	14,210.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	18.43	3,686.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	31.18	21,826.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	11.92	5,721.60
OVCTEK CHINA INC-A	300	71.27	21,381.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	20.31	4,062.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	343.85	240,695.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	242.80	24,280.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	18.16	18,886.40
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	20.79	18,711.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	266.05	53,210.00
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,080	34.17	36,903.60
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	27.22	5,444.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	113.10	33,930.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	132.50	39,750.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	200	354.04	70,808.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	43.33	25,998.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	27.30	2,730.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,300	131.94	171,522.00

DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	35.67	21,402.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	41.55	4,155.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	30.57	6,114.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	124.61	37,383.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	44.63	34,811.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	22.20	15,540.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	4,180	85.50	357,390.00
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	17.39	17,390.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	22.30	20,070.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	14.61	23,376.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	45.12	22,560.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	38.17	24,810.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	23.98	6,234.80
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	57.33	68,796.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	8.25	23,925.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	19.84	17,856.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	161.50	96,900.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	28.89	2,889.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,000	25.78	25,780.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	23.13	4,626.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	5.33	11,726.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	14.59	2,918.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	45.50	27,300.00
WUXI APPTec CO LTD-A	1,440	117.70	169,488.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	22.10	22,100.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	97.41	107,151.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	300	222.70	66,810.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.08	11,176.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	32.74	39,615.40
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	31.12	55,393.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	58.86	23,544.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.18	159,954.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.72	88,264.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	9.78	14,670.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.22	52,486.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.55	123,760.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	12.79	6,395.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.98	19,136.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	7.97	70,933.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	33.30	166,500.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	7.80	68,718.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.06	3,036.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.40	19,200.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	4.00	139,600.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	15,400	42.58	655,732.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	5.13	152,874.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.19	27,236.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	4.96	179,552.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	17.77	243,449.00
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	17.18	225,058.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	9.36	181,584.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.38	3,942.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	12.81	19,215.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	8.37	6,696.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	12.29	34,412.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	21.25	142,375.00
CITIC SECURITIES CO-A	8,600	28.71	246,906.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,500	43.03	107,575.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	12.57	2,514.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,920	24.96	147,763.20
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	18.42	58,944.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	10.09	5,045.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	9.00	64,800.00
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	16.84	45,468.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	13.36	61,456.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	18.05	124,545.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.52	4,260.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	13.93	123,977.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	140.16	70,080.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	8.04	3,216.00

HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	18.65	102,575.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	11.97	3,591.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.68	58,156.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	12.55	20,080.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	9.42	28,260.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	3.83	4,596.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	11.31	58,812.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.76	12,032.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	3,600	14.34	51,624.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.40	13,500.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.84	3,136.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	5.15	78,280.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	16.28	4,884.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.84	2,952.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.15	19,570.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	5.93	25,499.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.27	4,635.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	15.27	19,851.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	40.70	101,750.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	31.78	139,832.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.01	3,006.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	57.38	109,022.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	6.50	22,750.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	8,100	80.34	650,754.00	
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	6.28	13,816.00	
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	3.76	12,784.00	
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	13.77	19,691.10	
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	26.61	18,627.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	14.43	51,948.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	6,500	29.05	188,825.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.91	2,764.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	34.32	27,456.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	13.89	45,837.00	
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	4.75	12,825.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	6.21	7,452.00	

JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.18	28,458.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.85	5,495.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	15.78	130,974.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	7.05	4,230.00	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	18.29	16,461.00	
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	4.97	12,425.00	
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.16	3,792.00	
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	7.21	24,514.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	7.11	22,041.00	
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	3.07	15,657.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	15.11	60,440.00	
AISINO CORP-A	200	13.89	2,778.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	32.12	15,417.60	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	35.80	3,580.00	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	19.81	13,867.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	72.12	14,424.00	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	20.67	14,469.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	9.17	3,668.00	
GLODON CO LTD-A	500	69.34	34,670.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	88.67	61,093.63	
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	42.60	42,600.00	
NEULAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	15.74	7,870.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	195.08	19,508.00	
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	2.49	1,942.20	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	60.91	24,364.00	
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	18.02	7,208.00	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	94.22	28,266.00	
VENUSTECH GROUP INC-A	400	31.26	12,504.00	
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	7.88	7,092.00	
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	900	21.90	19,710.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	47.63	109,930.04	
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	32.00	19,200.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	59.72	53,748.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	5.36	109,880.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	33.84	23,688.00	

CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	15.12	39,312.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	36.23	40,577.60
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	24.82	27,302.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	14.35	54,530.00
GOERTEK INC -A	2,000	41.47	82,940.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	11.76	25,872.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	12.98	32,450.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	11.72	3,516.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	100.73	50,365.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	7,500	47.30	354,750.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	15.00	3,000.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	4.48	12,544.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	12.41	11,169.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	29.11	17,466.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	31.88	41,444.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	7.43	17,089.00
LUXSHARE PRECISIONIndustr-A	5,533	55.87	309,128.71
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	200	542.39	108,478.00
NINESTAR CORP-A	100	31.61	3,161.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	16.22	6,488.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	28.54	28,540.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	117.98	33,034.40
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	21.60	21,600.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	47.67	42,903.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	26.70	18,690.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	41.70	29,190.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	14.65	4,395.00
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	2.71	2,168.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	22.46	42,134.96
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	22.20	28,860.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	18.60	14,880.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	109.83	76,881.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	35.25	47,940.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	19.87	31,792.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	68.40	27,360.00

YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	69.91	20,973.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	22.95	55,080.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	50.88	25,440.00	
ZTE CORP-A	2,700	35.82	96,714.00	
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	4.78	65,964.00	
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	5.11	12,775.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.57	19,651.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,400	20.36	354,264.00	
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	2.06	5,768.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.47	4,511.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	5.01	4,008.00	
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.93	2,358.00	
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.60	12,740.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	9.27	61,182.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.14	15,708.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.43	3,801.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.50	3,300.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	10.25	7,175.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.67	15,781.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	207.15	29,001.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	15.86	31,720.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	66.56	173,056.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	181.87	36,374.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	25.79	41,264.00	
SG MICRO CORP-A	100	309.85	30,985.00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	178.48	44,620.00	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	23.08	53,084.00	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	15.54	29,526.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	25.48	20,384.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	95.38	47,690.00	
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	13.23	14,553.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	400	201.79	80,716.00	
WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	10.74	16,110.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	29.56	26,604.00	
オフショア人民元 小計	1,248,368		24,037,060.89	



				(381,948,897)
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	13.82	22,485.14
	SAUDI ARABIAN OIL CO	26,704	35.30	942,651.20
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	60.80	71,379.20
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	12.44	47,048.08
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	15.86	55,510.00
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	2,572	80.10	206,017.20
	SAUDI ARABIAN MINING CO	5,424	39.05	211,807.20
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	10,872	95.90	1,042,624.80
	SAUDI CEMENT	565	57.80	32,657.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	23.44	69,921.52
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	10.70	87,076.60
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,789	59.60	166,224.40
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	79.80	33,675.60
	JARIR MARKETING CO	611	179.40	109,613.40
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	129.60	52,617.60
	ALMARAI CO	3,167	54.60	172,918.20
	SAVOLA	3,337	45.55	152,000.35
	AL RAJHI BANK	14,912	72.20	1,076,646.40
	ALINMA BANK	12,351	16.22	200,333.22
	ARAB NATIONAL BANK	6,307	20.16	127,149.12
	BANK AL-JAZIRA	5,356	13.58	72,734.48
	BANK ALBILAD	3,925	26.40	103,620.00
	BANQUE SAUDI FRANSI	7,513	31.70	238,162.10
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	17,926	42.10	754,684.60
	RIYAD BANK	16,646	19.12	318,271.52
	SAMBA FINANCIAL GROUP	12,062	30.25	364,875.50
	SAUDI BRITISH BANK	8,978	24.98	224,270.44
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	123.00	98,400.00
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	84.00	55,524.00
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	8.39	33,073.38
	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	9.60	41,232.00
ETIHAD ETISALAT CO	3,984	29.70	118,324.80	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	13.12	68,224.00	
SAUDI TELECOM CO	7,265	106.60	774,449.00	

	SAUDI ELECTRICITY CO	9,159	22.08	202,230.72	
	サウジアラビアリアル 小計	219,355		8,348,432.77	
				(233,338,695)	
	合計	29,256,285		8,791,196,312	
				(8,791,196,312)	

(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	608,003.00	
		メキシコペソ 小計	34,100	608,003.00	
				(3,131,215)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	31,594	369,965.74	
		南アフリカランド 小計	31,594	369,965.74	
				(2,500,968)	
	合計			5,632,183	
				(5,632,183)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 60銘柄	100.0%		16.7%
メキシコペソ	株式 23銘柄	98.0%		1.7%
	投資証券 1銘柄		2.0%	0.0%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.0%		4.7%
チリペソ	株式 16銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	100.0%		0.1%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%

トルコリラ	株式	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	16銘柄	100.0%		0.7%
香港ドル	株式	204銘柄	100.0%		23.9%
マレーシアリングット	株式	40銘柄	100.0%		1.7%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%		1.9%
フィリピンペソ	株式	21銘柄	100.0%		0.8%
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%		12.5%
新台湾ドル	株式	86銘柄	100.0%		12.5%
インドルピー	株式	86銘柄	100.0%		8.1%
カタールリアル	株式	11銘柄	100.0%		0.7%
南アフリカランド	株式	38銘柄	99.2%		3.6%
	投資証券	1銘柄		0.8%	0.0%
アラブディルハム	株式	8銘柄	100.0%		0.5%
オフショア人民元	株式	462銘柄	100.0%		4.3%
サウジアラビアリアル	株式	35銘柄	100.0%		2.7%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年11月16日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,791,574

2020年11月16日現在

コール・ローン	15,886,086
投資信託受益証券	4,446,560,024
派生商品評価勘定	39,832
未収入金	17,693,825
未収配当金	4,795,339
流動資産合計	4,494,766,680
資産合計	4,494,766,680
負債の部	
流動負債	
未払解約金	13,702,000
未払利息	43
流動負債合計	13,702,043
負債合計	13,702,043
純資産の部	
元本等	
元本	4,255,650,305
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	225,414,332
元本等合計	4,481,064,637
純資産合計	4,481,064,637
負債純資産合計	4,494,766,680

## 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11月16日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	5,106,450,200円
期中追加設定元本額	4,029,854,310円
期中一部解約元本額	4,880,654,205円
期末元本額	4,255,650,305円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	724,843,369円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	479,244,002円
りそなラップ型ファンド(成長型)	264,525,713円
DCりそな グローバルバランス	12,778,850円
つみたてバランスファンド	454,672,951円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	195,973,892円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	96,784,131円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	58,174,877円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,912,159円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,494,532円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,434,184円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,949,974円
リスクコントロール・オープン	1,823,131円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	56,090,182円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	21,138,764円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	939,668,167円
Smart-i 8資産バランス 安定型	36,555,592円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	76,917,355円
Smart-i 8資産バランス 成長型	75,931,319円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	209,255,575円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	165,964,242円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	95,432,879円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	61,950,301円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	183,948,076円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	30,422,762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)	763,326円
2. 計算日における受益権の総数	4,255,650,305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	1.0530円
(10,000口当たり純資産額)	(10,530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11月16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11月16日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

### 2. 時価の算定方法

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		39,754,725
合計		39,754,725

(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11月16日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	17,783,092	-	17,743,260	39,832
	米ドル	17,783,092	-	17,743,260	39,832
	合計	17,783,092	-	17,743,260	39,832

## (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
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	515,147	29,590,043.68	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	401,732	12,883,545.24	
		米ドル 小計	916,879	42,473,588.92 (4,446,560,024)	
合計				4,446,560,024 (4,446,560,024)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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



## RAM国内リートマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2020年11月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	221,152,821
投資証券	16,955,008,650
派生商品評価勘定	924,260
未収配当金	172,308,706
前払金	3,236,200
差入委託証拠金	85,519,000
流動資産合計	17,438,149,637
資産合計	
17,438,149,637	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,716,720
未払解約金	31,597,000
未払利息	599
流動負債合計	38,314,319
負債合計	
38,314,319	
純資産の部	
元本等	
元本	14,766,221,925
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,633,613,393
元本等合計	17,399,835,318
純資産合計	
17,399,835,318	
負債純資産合計	
17,438,149,637	

## 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11月16日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	15,297,180,904円
期中追加設定元本額	12,473,907,862円
期中一部解約元本額	13,004,866,841円
期末元本額	14,766,221,925円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	640,487,681円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	426,568,001円
りそなラップ型ファンド(成長型)	406,596,649円
DCりそな グローバルバランス	11,286,347円
つみたてバランスファンド	803,493,880円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	204,499,349円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	103,176,772円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	61,910,636円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	5,179,932円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,684,107円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,489,960円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	3,030,653円
リスクコントロール・オープン	1,626,032円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	49,702,802円
FWりそな国内リートインデックスオープン	2,884,152,115円
FWりそな国内リートインデックスファンド	1,392,039,703円
Smart-i Jリートインデックス	2,391,930,206円
Smart-i 8資産バランス 安定型	32,365,492円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	84,061,946円
Smart-i 8資産バランス 成長型	79,527,149円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	184,859,157円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	147,089,693円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	84,579,998円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	54,904,314円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	162,097,894円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	26,831,093円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,158,772,467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)	681,785円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,359,596,112円
2. 計算日における受益権の総数	14,766,221,925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	1.1784円
(10,000口当たり純資産額)	(11,784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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		3,160,581,418
合計		3,160,581,418

(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11月16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	453,204,460	-	447,412,000	5,792,460
合計		453,204,460	-	447,412,000	5,792,460

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	309	33,742,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	463	45,049,900	
	S O S i L A物流リート投資法人	421	53,635,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	628	366,752,000	
	M C U B S Mid C i t y投資法人	2,314	180,723,400	
	森ヒルズリート投資法人	2,221	294,948,800	
	産業ファンド投資法人	2,673	473,922,900	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,796	545,984,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,234	213,975,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	948	378,252,000	
	G L P投資法人	5,437	851,977,900	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	825	244,117,500	
	日本プロロジスリート投資法人	2,861	1,004,211,000	
	星野リゾート・リート投資法人	288	144,000,000	
	O n eリート投資法人	295	71,891,500	
	イオンリート投資法人	1,918	234,187,800	
	ヒューリックリート投資法人	1,522	214,145,400	
	日本リート投資法人	614	212,751,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12,148	166,427,600	
	積水ハウス・リート投資法人	5,562	413,256,600	
	トーセイ・リート投資法人	418	44,224,400	
	ケネディクス商業リート投資法人	695	150,120,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	403	50,213,800	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	364	36,764,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	6,115	815,129,500	
	いちごホテルリート投資法人	331	23,931,300	
	ラサルロジポート投資法人	2,107	336,909,300	
スターアジア不動産投資法人	1,943	90,543,800		
マリモ地方創生リート投資法人	177	19,647,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	660	324,390,000		
大江戸温泉リート投資法人	305	21,960,000		

投資法人みらい	2,042	77,698,100	
森トラスト・ホテルリート投資法人	410	47,191,000	
三菱地所物流リート投資法人	425	170,637,500	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	516	80,805,600	
ザイマックス・リート投資法人	290	26,158,000	
タカラレーベン不動産投資法人	568	48,109,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	597	82,923,300	
日本ビルファンド投資法人	2,128	1,204,448,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,891	1,013,576,000	
日本リテールファンド投資法人	3,553	556,755,100	
オリックス不動産投資法人	3,768	581,779,200	
日本プライムリアルティ投資法人	1,177	343,684,000	
プレミア投資法人	1,708	197,274,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,268	185,508,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,313	132,744,300	
ユナイテッド・アーバン投資法人	4,044	501,051,600	
森トラスト総合リート投資法人	1,351	173,333,300	
インヴィンシブル投資法人	7,907	273,977,550	
フロンティア不動産投資法人	628	236,756,000	
平和不動産リート投資法人	1,160	136,996,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,236	365,608,800	
福岡リート投資法人	978	130,660,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	585	372,060,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,569	109,986,900	
大和証券オフィス投資法人	403	257,114,000	
阪急阪神リート投資法人	854	105,469,000	
スターツプロシード投資法人	294	57,712,200	
大和ハウスリート投資法人	2,698	659,661,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,092	319,830,000	
大和証券リビング投資法人	2,386	234,305,200	
ジャパンエクセレント投資法人	1,755	213,408,000	
合計	113,589	16,955,008,650	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

#### RAM先進国リートマザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）

2020年11月16日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	37,040,256
コール・ローン	5,465,429
株式	15,189,804
投資証券	21,608,388,735
派生商品評価勘定	318,796
未収入金	156,893,646
未収配当金	55,514,440
流動資産合計	21,878,811,106
<b>資産合計</b>	<b>21,878,811,106</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	108,696
未払解約金	142,346,000
未払利息	14
流動負債合計	142,454,710
<b>負債合計</b>	<b>142,454,710</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	21,375,618,231
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	360,738,165
元本等合計	21,736,356,396
<b>純資産合計</b>	<b>21,736,356,396</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>21,878,811,106</b>

#### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

	移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4.収益及び費用の計上基準	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11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	17,879,485,314円
期中追加設定元本額	19,445,431,206円
期中一部解約元本額	15,949,298,289円
期末元本額	21,375,618,231円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	794,854,604円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	847,241,812円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,972,878,874円
DCりそな グローバルバランス	13,810,554円
つみたてバランスファンド	510,380,607円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	303,641,337円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	145,156,219円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	85,639,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	7,316,123円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	5,226,923円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,037,273円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,224,973円
リスクコントロール・オープン	7,957,977円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	58,471,072円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	7,880,390,724円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,960,530,258円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,344,649,178円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,598,779円



Smart-i 8資産バランス 安定成長型	104,531,586円
Smart-i 8資産バランス 成長型	117,126,601円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	444,357,656円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	346,191,326円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	199,070,533円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	129,229,788円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	392,144,697円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	64,445,493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)	2,231,621円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,592,281,731円
2. 計算日における受益権の総数	21,375,618,231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	1.0169円
(10,000口当たり純資産額)	(10,169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11月16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11月16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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	1,474,401	
投資証券	843,966,279	
合計	842,491,878	

(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11月16日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	161,312,390	-	161,102,290	210,100
	米ドル	124,033,260	-	123,731,760	301,500
	ユーロ	3,966,792	-	3,966,080	712
	英ポンド	10,888,807	-	10,927,280	38,473
	オーストラリアドル	14,043,535	-	14,113,650	70,115
	香港ドル	4,332,160	-	4,320,000	12,160
	シンガポールドル	4,047,836	-	4,043,520	4,316
合計	161,312,390	-	161,102,290	210,100	

## (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	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	84,000	2.37	199,080.00	
	オーストラリアドル 小計	84,000		199,080.00 (15,189,804)	
	合計	84,000		15,189,804 (15,189,804)	

(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	ACADIA REALTY TRUST	14,937	201,201.39	
		AGREE REALTY CORP	9,135	613,141.20	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,500	192,625.00	
		ALEXANDER'S INC	368	101,144.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	19,913	3,273,099.81	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,032	213,651.20	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,365	950,955.50	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	138,989.52	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	45,194	1,368,474.32	
		AMERICOLD REALTY TRUST	34,259	1,262,101.56	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,237	784,618.33	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,304	424,340.48	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,000	103,800.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,802	4,030,630.68	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	31,635.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,051	2,203,552.62	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	28,901	310,685.75	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,216	763,785.36	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,842	160,030.92	
		BRT APARTMENTS CORP	877	11,576.40	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,540	1,659,127.40	
		CARETRUST REIT INC	16,311	322,957.80	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,481	84,046.71	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	21,500.00	
		CITY OFFICE REIT INC	8,644	67,855.40	
		CLIPPER REALTY INC	1,350	7,681.50	
		COLONY CAPITAL INC	83,392	331,900.16	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,342	244,289.46	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	176,936.96	
		CORECIVIC INC	19,484	128,594.40	

COREPOINT LODGING INC	7,200	41,544.00	
CORESITE REALTY CORP	7,262	935,853.94	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,032	486,838.56	
COUSINS PROPERTIES INC	24,871	784,431.34	
CUBESMART	32,896	1,118,464.00	
CYRUSONE INC	19,856	1,444,921.12	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,147	227,077.55	
DIGITAL REALTY TRUST INC	45,661	6,604,863.65	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,700	155,187.00	
DOUGLAS EMMETT INC	27,969	852,774.81	
DUKE REALTY CORP	62,792	2,532,401.36	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,562	295,922.84	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,707	979,624.42	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	22,245	171,731.40	
EPR PROPERTIES	12,750	387,090.00	
EQUINIX INC	14,994	11,407,585.14	
EQUITY COMMONWEALTH	20,578	559,721.60	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	28,804	1,803,418.44	
EQUITY RESIDENTIAL	57,870	3,480,880.50	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,356	339,656.92	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,039	2,813,951.49	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,880	2,575,713.60	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	25,126.89	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,703	1,035,364.41	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,692	929,068.36	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,967	344,888.94	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	75,792.60	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8,641	115,616.58	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	35,262	1,468,662.30	
GEO GROUP INC/THE	20,721	185,452.95	
GETTY REALTY CORP	6,175	175,925.75	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	111,204.00	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	36,574.01	

GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	105,907.13	
GLOBAL NET LEASE INC	14,650	241,871.50	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,153	743,674.36	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	37,079	1,044,886.22	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	91,157	2,708,274.47	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	27,341.24	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,632	634,752.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	119,645	1,585,296.25	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25,965	659,511.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	16,204	221,022.56	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,134	238,601.62	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,740	570,200.40	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,204	159,525.52	
INVITATION HOMES INC	94,922	2,768,874.74	
IRON MOUNTAIN INC	48,884	1,246,053.16	
JBG SMITH PROPERTIES	19,096	568,678.88	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,000	82,600.00	
KILROY REALTY CORP	17,780	1,077,112.40	
KIMCO REALTY CORP	73,357	1,043,136.54	
KITE REALTY GROUP TRUST	14,299	196,754.24	
LEXINGTON REALTY TRUST	46,038	488,923.56	
LIFE STORAGE INC	7,979	930,431.19	
LTC PROPERTIES INC	6,620	249,375.40	
MACERICH CO/THE	20,631	181,759.11	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	194,015.27	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	229,400	172,050.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	89,438	1,735,097.20	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,365	2,562,957.75	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	16,650	242,257.50	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	29,320	1,165,763.20	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,777	392,498.34	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,723	512,421.05	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,695	74,394.30	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,057	179,278.83	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	8,219	182,461.80	

OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,489	1,359,431.48	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	36,919.90	
PARAMOUNT GROUP INC	29,707	232,011.67	
PARK HOTELS & RESORTS INC	39,476	560,953.96	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	21,838	374,740.08	
PHYSICIANS REALTY TRUST	35,238	659,302.98	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,377	321,723.85	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	54,530.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	63,349.92	
PRIME US REIT	85,000	65,875.00	
PROLOGIS INC	125,315	12,973,861.95	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,337	460,138.93	
PUBLIC STORAGE	25,794	6,037,085.70	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,435	665,753.00	
REALTY INCOME CORP	58,324	3,677,328.20	
REGENCY CENTERS CORP	26,667	1,219,481.91	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,999	260,186.99	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,537	279,873.42	
RETAIL VALUE INC	1,615	22,464.65	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,645	1,046,907.95	
RLJ LODGING TRUST	28,086	328,887.06	
RPT REALTY	15,048	97,812.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,193	540,548.40	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,837	575,507.24	
SAFEHOLD INC	2,352	156,408.00	
SAUL CENTERS INC	2,130	62,622.00	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,386	78,043.14	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	293,096.80	
SIMON PROPERTY GROUP INC	51,841	3,872,522.70	
SITE CENTERS CORP	25,468	234,305.60	
SL GREEN REALTY CORP	12,435	681,562.35	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,542	638,528.80	
STAG INDUSTRIAL INC	25,404	793,112.88	
STORE CAPITAL CORP	38,567	1,212,160.81	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	143,942.40	

	SUN COMMUNITIES INC	16,635	2,439,190.05
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	36,008	357,919.52
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,020	148,074.00
	TAUBMAN CENTERS INC	10,106	398,984.88
	TERRENO REALTY CORP	11,652	716,947.56
	UDR INC	50,122	1,948,242.14
	UMH PROPERTIES INC	7,056	100,406.88
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,060	124,321.00
	URBAN EDGE PROPERTIES	17,978	221,129.40
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	61,900.64
	VENTAS INC	63,217	3,167,171.70
	VEREIT INC	182,262	1,341,448.32
	VICI PROPERTIES INC	90,546	2,336,992.26
	VORNADO REALTY TRUST	26,600	1,024,366.00
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	14,319.00
	WASHINGTON REIT	13,375	302,275.00
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,396	428,316.00
	WELLTOWER INC	70,719	4,637,044.83
	WHITESTONE REIT	7,716	56,249.64
	WP CAREY INC	29,597	2,069,422.24
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	20,048	235,163.04
	米ドル 小計	4,287,523	152,098,118.65 (15,923,152,041)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,777	379,249.83
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,597	127,607.61
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	36,610.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,226	132,020.24
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,021	715,912.26
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,837	347,766.02
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,780	119,059.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	123,762.30
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	130,890.99
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	165,948.65
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	78,765.78
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	274,576.86



	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,568	356,989.20
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,054	308,164.20
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	161,128.98
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	149,958.13
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	63,298.10
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	58,051.23
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,751	190,114.57
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	35,100.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,023	456,774.90
	SLATE GROCERY REIT	1,920	22,022.40
	SLATE OFFICE REIT	4,169	16,342.48
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,423	302,127.36
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,126	162,488.40
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	29,040.00
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,500	113,230.00
	カナダドル 小計	289,753	5,056,999.69 (403,548,575)
ユーロ	AEDIFICA	5,781	554,397.90
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	29,430	397,599.30
	ALTAREA	659	85,670.00
	BEFIMMO	4,584	167,545.20
	CARE PROPERTY INVEST	4,100	112,750.00
	CARMILA	8,000	83,040.00
	COFINIMMO	4,616	584,385.60
	COVIVIO	8,056	529,279.20
	CROMWELL EUROPEAN REIT	214,500	99,742.50
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	5,385	73,451.40
	GECINA SA	9,207	1,160,082.00
	HAMBORNER REIT AG	12,779	113,209.16
	HIBERNIA REIT PLC	108,886	135,889.72
	ICADE	5,146	313,648.70
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	16,734.38
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	41,787	338,892.57
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	93,970.80
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	112,732.36

	KLEPIERRE	34,103	637,385.07
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	45,641.11
	MERCIALYS	7,081	40,715.75
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	55,285	416,848.90
	MONTEA	1,671	163,925.10
	NSI NV	3,090	97,644.00
	RETAIL ESTATES	1,989	111,384.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,222	1,158,777.80
	VASTNED RETAIL NV	3,660	91,317.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,000	634,920.00
	WERELDHAVE NV	7,169	71,976.76
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,300	123,280.00
	ユーロ 小計	720,867	8,566,836.28 (1,061,773,688)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	15,680.00
	ASSURA PLC	445,319	338,442.44
	BIG YELLOW GROUP PLC	27,264	305,629.44
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	97,290.00
	BRITISH LAND CO PLC	158,620	752,810.52
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,700	204,171.70
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,652	122,340.07
	CUSTODIAN REIT PLC	77,000	68,299.00
	DERWENT LONDON PLC	18,758	600,631.16
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	70,739.90
	GCP STUDENT LIVING PLC	85,000	119,000.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,764	287,336.32
	HAMMERSON PLC	687,112	158,379.31
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,000	63,000.00
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,908	865,297.62
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	151,042	346,188.26
	LXI REIT PLC	81,711	100,177.68
	NEWRIVER REIT PLC	56,051	38,114.68
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	72,225.60
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	218,711	328,066.50
	RDI REIT PLC	48,350	45,594.05

	REGIONAL REIT LTD	68,961	53,789.58
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	34,857	281,644.56
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	34,414.74
	SEGRO PLC	201,616	1,863,738.30
	SHAFTESBURY PLC	41,622	240,783.27
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	41,538.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	115,000	120,175.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	55,339	60,042.81
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	286,477	468,676.37
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	131,710	100,099.60
	UNITE GROUP PLC	67,553	724,168.16
	WORKSPACE GROUP PLC	21,040	149,699.60
	英債券 小計	4,216,646	9,138,184.24 (1,264,085,025)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	52,607	164,133.84
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	75,668.82
	ARENA REIT	52,557	144,531.75
	AVENTUS GROUP	62,000	158,100.00
	BWP TRUST	86,381	364,527.82
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	68,504	213,047.44
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	158,087.34
	CHARTER HALL GROUP	78,014	1,103,117.96
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,828	360,280.64
	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,091	320,386.71
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	166,683.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	324,502	314,766.94
	DEXUS	186,312	1,760,648.40
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	103,741.92
	GOODMAN GROUP	281,953	5,427,595.25
	GPT GROUP	328,528	1,534,225.76
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	190,491.51
	HOME CONSORTIUM	24,000	95,520.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,020	66,423.20
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,899	232,030.35
	INVESTEC AUSTRALIA PROPERTY	96,000	120,000.00

	MIRVAC GROUP	664,152	1,726,795.20
	NATIONAL STORAGE REIT	165,638	305,602.11
	RURAL FUNDS GROUP	53,895	135,276.45
	SCENTRE GROUP	884,641	2,335,452.24
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	177,242	428,925.64
	STOCKLAND	407,172	1,791,556.80
	VICINITY CENTRES	647,128	1,025,697.88
	WAYPOINT REIT LTD	126,935	345,263.20
	オーストラリアドル 小計	5,290,189	21,168,578.17 (1,615,162,514)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	209,567.52
	GOODMAN PROPERTY TRUST	178,660	426,997.40
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	272,970	354,861.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	330,618.98
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	54,548	164,734.96
	ニュージーランドドル 小計	837,452	1,486,779.86 (106,973,810)
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,453,400.00
	FORTUNE REIT	247,000	1,714,180.00
	LINK REIT	350,600	23,945,980.00
	PROSPERITY REIT	226,000	522,060.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	152,000	542,640.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	1,007,100.00
	香港ドル 小計	1,583,600	29,185,360.00 (394,002,360)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	95,698.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	175,200	100,740.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	478,000	1,453,120.00
	ASCOTT TRUST	307,496	301,346.08
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	763,832	1,527,664.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	116,000	146,160.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	116,300	136,071.00
	EC WORLD REIT	50,000	35,000.00
	ESR REIT	390,700	144,559.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	101,727.00
	FIRST REAL ESTATE INVNT TRUST	107,400	49,404.00

	FRASERS CENTREPOINT TRUST	172,100	397,551.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	58,159.50	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL TRUST	446,979	558,723.75	
	IREIT GLOBAL	55,000	33,825.00	
	KEPPEL DC REIT	225,600	629,424.00	
	KEPPEL REIT	297,300	306,219.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	89,719.50	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	16,724.40	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	365,500	731,000.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	280,800	845,208.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	459,800	905,806.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL TRUST	357,300	325,143.00	
	MOORE COMMERCIAL REAL ESTATE I	446,000	151,640.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	62,900	245,939.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	56,835.50	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	92,100	73,219.50	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	165,900	80,461.50	
	SPH REIT	161,200	126,542.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	251,500	111,917.50	
	SUNTEC REIT	354,800	525,104.00	
	シンガポールドル 小計	7,573,007	10,360,651.23 (805,747,846)	
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	15,600	84,396,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,000	65,040,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,600	61,318,000.00	
	韓国ウォン 小計	40,200	210,754,000.00 (19,958,403)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	29,265	450,095.70	
	イスラエルシェケル 小計	29,265	450,095.70 (13,984,473)	
	合計		21,608,388,735 (21,608,388,735)	

(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	投資証券 155銘柄		100.0%	73.6%
カナダドル	投資証券 27銘柄		100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 30銘柄		100.0%	4.9%
英ポンド	投資証券 34銘柄		100.0%	5.8%
オーストラリアドル	株式 1銘柄	0.9%		0.1%
	投資証券 29銘柄		99.1%	7.5%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄		100.0%	0.5%
香港ドル	投資証券 6銘柄		100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 31銘柄		100.0%	3.7%
韓国ウォン	投資証券 3銘柄		100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	投資証券 1銘柄		100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## RAMマネーマザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2020年11月16日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	12,301,945,947
国債証券	18,202,878,600
流動資産合計	30,504,824,547
資産合計	30,504,824,547
負債の部	
流動負債	

2020年11月16日現在

未払利息	33,366
流動負債合計	33,366
負債合計	33,366
純資産の部	
元本等	
元本	30,567,683,419
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	62,892,238
元本等合計	30,504,791,181
純資産合計	30,504,791,181
負債純資産合計	30,504,824,547

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年11月16日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年12月17日
期首元本額	20,463,883,646円
期中追加設定元本額	89,354,519,568円
期中一部解約元本額	79,250,719,795円
期末元本額	30,567,683,419円
期末元本の内訳	
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	11,687,316,697円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	6,613,979,753円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	4,792,087,450円
りそなDAA先物ファンド(適格機関投資家専用)	7,220,264,084円
りそなマネー・プール・ファンド(適格機関投資家専用)	553,926円
りそなDAA先物ファンド(適格機関投資家専用)	253,481,509円
2. 計算日における受益権の総数	30,567,683,419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	62,892,238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	0.9979円
(10,000口当たり純資産額)	(9,979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11月16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11月16日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	
国債証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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11月16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11月16日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		2,732,900
合計		2,732,900

(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933回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,048,000	
	第934回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,073,500	
	第936回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,099,000	
	第938回国庫短期証券	2,200,000,000	2,200,182,600	
	第940回国庫短期証券	2,000,000,000	2,000,300,000	
	第941回国庫短期証券	2,000,000,000	2,000,368,000	
	第943回国庫短期証券	2,000,000,000	2,000,372,000	
	第944回国庫短期証券	1,000,000,000	1,000,207,000	
	第948回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,391,500	
	第949回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,387,000	
	第951回国庫短期証券	1,500,000,000	1,500,450,000	
合計		18,200,000,000	18,202,878,600	

## 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11月30日現在です。

## 【りそな・リスクコントロールファンド2019-12】

## 【純資産額計算書】

資産総額	15,336,668,786円
負債総額	14,284,467円
純資産総額（ - ）	15,322,384,319円
発行済口数	15,862,875,360口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9659円

（参考）

## RAM国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	84,461,848,523円
負債総額	137,593,435円
純資産総額（ - ）	84,324,255,088円
発行済口数	80,142,747,346口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0522円

## RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

資産総額	201,688,722,996円
負債総額	2,893,210,259円
純資産総額（ - ）	198,795,512,737円
発行済口数	185,059,370,269口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0742円

## RAM国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	41,298,651,618円
負債総額	389,875,374円
純資産総額（ - ）	40,908,776,244円
発行済口数	32,580,563,003口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2556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	76,485,175,030円
負債総額	242,509,010円
純資産総額（ - ）	76,242,666,020円
発行済口数	51,284,738,230口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4867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	12,432,097,670円
負債総額	245,478,658円
純資産総額（ - ）	12,186,619,012円
発行済口数	8,311,921,216口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4662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	4,838,426,891円
負債総額	163,332,406円
純資産総額（ - ）	4,675,094,485円
発行済口数	4,413,996,640口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0592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	18,337,541,108円
負債総額	18,607,149円
純資産総額（ - ）	18,318,933,959円
発行済口数	15,489,326,625口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1827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	22,614,139,283円
負債総額	363,702,767円
純資産総額（ - ）	22,250,436,516円
発行済口数	21,986,119,379口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0120円

## R A Mマネーマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	25,449,825,997円
負債総額	19,657円
純資産総額（ - ）	25,449,806,340円
発行済口数	25,503,067,726口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9979円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 名義書換

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

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

## 受益権の譲渡

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

するものとしします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### (1) 資本金の額

2020年11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11月末現在）

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

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

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

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

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

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

###### PLAN：計画

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

###### DO：実行

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

###### CHECK：検証 ACTION：改善

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

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

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

## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年11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	83	858,714
単位型株式投資信託	6	113,738
合計	89	972,453

## 3【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57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) 財務諸表及び中間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、第6期事業年度に係る中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

### (1)【貸借対照表】

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



無形固定資産計	29,501	18,733
投資その他の資産		
投資有価証券	599	7,975
長期前払費用	1,416	416
繰延税金資産	34,080	72,304
投資その他の資産計	36,097	80,969
固定資産計	77,557	115,424
資産合計	1,851,107	5,003,507

(単位：千円)

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

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,786,724	3,170,025
運用受託報酬	-	1,201,400
投資助言報酬	35,360	1,166,500

営業収益計		1,822,084	5,537,925
営業費用			
支払手数料		437,713	1,050,201
広告宣伝費		48,845	63,238
調査費			
調査費		192,459	500,578
委託調査費		199,514	128,044
委託計算費		149,138	188,413
営業雑経費			
印刷費		49,857	68,686
協会費		3,294	5,690
販売促進費		5,915	5,255
その他		42,522	55,169
営業費用計		1,129,261	2,065,279
一般管理費			
給料			
役員報酬		65,787	82,651
給料・手当		216,403	490,014
賞与		18,883	3,982
賞与引当金繰入額		36,596	132,198
旅費交通費		8,181	13,634
租税公課		14,129	48,964
不動産賃借料		23,852	48,771
固定資産減価償却費		15,147	16,096
諸経費		72,402	119,502
一般管理費計		471,383	955,815
営業利益		221,439	2,516,831
営業外収益			
受取配当金		-	23
投資有価証券売却益		176	73
雑収入		2	46
営業外収益計		179	142
営業外費用			
雑損失		-	13
営業外費用計		-	13
経常利益		221,618	2,516,960
税引前当期純利益		221,618	2,516,960
法人税、住民税及び事業税	1	49,931	769,705
法人税等調整額		7,606	38,032
法人税等計		57,538	731,672
当期純利益		164,079	1,785,287

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683

当期変動額						
当期純利益				164,079	164,079	164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	164,079	164,079	164,079
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

## (1)有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

## (2)無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3.引当金の計上基準

## 賞与引当金

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

## 4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## (1)消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## (2)連結納税制度の適用

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

## (3)連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

## (未適用の会計基準等)

・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日)

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

## (1)概要

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

ステップ1:顧客との契約を識別する。

ステップ2:契約における履行義務を識別する。

ステップ3:取引価格を算定する。

ステップ4:契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5:履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## (2)適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3)当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
流動負債		
その他未払金	44,766千円	616,704千円

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

### (損益計算書関係)

#### 1 関係会社に対する主な取引

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

### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

#### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

#### 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

#### 2 配当に関する事項

該当事項はありません。

### (金融商品関係)

#### 1 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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

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

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

#### 2 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	1,344,092	1,344,092	-
未収委託者報酬	369,524	369,524	-
未収投資助言報酬	38,188	38,188	-
資産計	1,751,805	1,751,805	-
未払手数料	87,317	87,317	-
その他未払金	163,133	163,133	-
負債計	250,451	250,451	-

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

## 金融商品の時価の算定方法に関する事項

## 資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

## 負債

未払手数料、その他未払金

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

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

繰延税金資産の純額 34,080千円 72,304千円

( \* 1 ) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2019年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2020年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

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

## (1)中間貸借対照表

(単位:千円)

		第6期中間会計期間 (2020年9月30日現在)	
資産の部			
流動資産			
預金			2,260,421
前払費用			147,264
未収入金			247
未収委託者報酬			763,034
未収運用受託報酬			2,414,786
未収投資助言報酬			405,399
流動資産計			5,991,153
固定資産			
有形固定資産			
建物	1		4,437
器具備品	1		18,016
有形固定資産計			22,454
無形固定資産			
ソフトウェア			13,023
無形固定資産計			13,023
投資その他の資産			
投資有価証券			12,358
繰延税金資産			87,613
投資その他の資産計			99,972
固定資産計			135,449
資産合計			6,126,603

(単位:千円)

		第6期中間会計期間 (2020年9月30日現在)	
負債の部			
流動負債			
未払金			
未払手数料			274,799
その他未払金			678,644
未払費用			92,385
未払法人税等			153,032
未払消費税等	2		186,565
賞与引当金			167,456
預り金			824
流動負債計			1,553,708
負債合計			1,553,708
純資産の部			

株主資本	
資本金	1,000,000
資本剰余金	
資本準備金	490,000
資本剰余金計	490,000
利益剰余金	
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	3,082,368
利益剰余金計	3,082,368
株主資本計	4,572,368
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	526
評価・換算差額等計	526
純資産合計	4,572,895
負債・純資産合計	6,126,603

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

	第6期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	1,615,328
運用受託報酬	2,227,738
投資助言報酬	403,885
営業収益計	4,246,952
営業費用	
支払手数料	527,367
広告宣伝費	17,661
調査費	
調査費	597,857
委託調査費	51,583
図書費	270
委託計算費	98,908
事務委託費	11,940
営業雑経費	
印刷費	32,679
協会費	2,573
諸会費	1,510
その他	30,051
営業費用計	1,372,402
一般管理費	
給料	
役員報酬	55,705
給料・手当	533,076
賞与	9,130
賞与引当金繰入額	167,456
旅費交通費	1,630
租税公課	33,348
不動産賃借料	48,858
固定資産減価償却費	9,288

諸経費	131,422
一般管理費計	989,916
営業利益	1,884,632
営業外収益	
受取配当金	50
雑収入	311
営業外収益計	361
営業外費用	
投資有価証券売却損	277
営業外費用計	277
経常利益	1,884,716
税引前中間純利益	1,884,716
法人税、住民税及び事業税	596,131
法人税等調整額	15,732
法人税等計	580,399
中間純利益	1,304,317

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当中間期変動額						
当中間純利益				1,304,317	1,304,317	1,304,317
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	1,304,317	1,304,317	1,304,317
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	3,082,368	3,082,368	4,572,368

	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	433	433	3,267,617
当中間期変動額			
当中間純利益			1,304,317
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	960	960	960
当中間期変動額合計	960	960	1,305,277
当中間期末残高	526	526	4,572,895

## （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

中間会計期間末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、当中間会計期間に帰属する額を計上しております。

## 4. その他中間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。

## 注記事項

### (中間貸借対照表関係)

#### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	第6期中間会計期間 (2020年9月30日)
建物	1,112千円
器具備品	14,674千円

#### 2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

### (中間損益計算書関係)

#### 1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

	第6期中間会計期間 (2020年9月30日)
有形固定資産	3,578千円
無形固定資産	5,710千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
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．金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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。

第6期中間会計期間（2020年9月30日現在）

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
（1）預金	2,260,421	2,260,421	-
（2）未収委託者報酬	763,034	763,034	-
（3）未収運用受託報酬	2,414,786	2,414,786	-
（4）未収投資助言報酬	405,399	405,399	-
資産計	5,843,641	5,843,641	-
（1）未払手数料	274,799	274,799	-
（2）その他未払金	678,644	678,644	-
負債計	953,443	953,443	-

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

（1）預金、（2）未収委託者報酬、（3）未収運用受託報酬、（4）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

（1）未払手数料、（2）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。

（セグメント情報等）

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30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中間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中間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中間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	2,445,827

## 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。

## (1株当たり情報)

	第6期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
1株当たり純資産額	1,154円77銭
1株当たり中間純利益金額	329円37銭

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	第6期中間会計期間 (自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)
中間純利益(千円)	1,304,317
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益(千円)	1,304,317
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000

## (重要な後発事象)

第6期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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



て、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項  
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項  
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

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

#### <再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2020年7月27日現在)

事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部(信託財産の管理)を原信託受託者から再信託受託者(株式会社日本カストディ銀行)へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

#### (2) 販売会社

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

#### (3) 保証会社

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

## 2【関係業務の概要】

- ( 1 ) 受託会社  
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。
- ( 2 ) 販売会社  
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。
- ( 3 ) 保証会社  
基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。

### 3【資本関係】

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

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年 9月16日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

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

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

### 監査意見

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

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

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年1月11日

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

### 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそな・リスクコントロールファンド2019-12の2019年12月17日から2020年11月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・リスクコントロールファンド2019-12の2020年11月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2020年12月4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

### 中間監査意見

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2020年4月1日から2021年3月31日までの第6期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 中間監査意見の根拠

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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

### 中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間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中間財務諸表の作成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。

### 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた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中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。