

【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4月23日提出
【計算期間】	第5期(自 2020年1月28日至 2021年1月25日)
【ファンド名】	D C りそな グローバルバランス
【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
	海外	不動産投信
追加型投信	内外	その他資産 ()
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
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(株式、債券、 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（株式、債券、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のないファンドをいう。
- (2) 追加型投信：一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

- (1) 株式：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信（リート）：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合：目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 独立した区分

- (1) MMF（マネー・マネージメント・ファンド）：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF（マネー・リザーブ・ファンド）：「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF：投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

< 補足として使用する商品分類 >

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1) 株式

- 一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- 大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- 中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2) 債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

う。

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

1 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の8つの資産に分散投資します。

- 各マザーファンドは、以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
投資対象資産	債券	RM国内債券マザーファンド 【主要投資対象】 国内の債券 【対象指数】 NOMURA-BPI総合	RM先進国債券マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	RM新興国債券マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダIVERSIFIファイド(円換算ベース)
	株式	RM国内株式マザーファンド 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 東証株価指数(TOPIX、配当込み)	RM先進国株式マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)	RM新興国株式マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	リート	RM国内リートマザーファンド 【主要投資対象】 不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	RM先進国リートマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資信託証券、不動産関連株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	—

2 中長期的な運用に適したポートフォリオ構築を目指します。

ポートフォリオの構築プロセス

(1) 原則年1回程度、独自の定量モデルを用いて「基本的資産配分比率」を決定します。

- 定量モデルを用いたポートフォリオの評価に従い、信託財産の着実な成長が期待でき、かつ運用期間中における信託財産の大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる投資比率を、「基本的資産配分比率」とします。

基本的資産配分比率の決定プロセス図

各資産のリターン・リスクに関する情報、および定量的なポートフォリオ価値の計算に必要な各種要素の条件設定等を行います。

さまざまな市場環境の変化が起こりうるとの想定のもと、各資産の価格変動についてのデータシナリオを多数生成します。

生成したシナリオ毎にポートフォリオ価値を計算した結果を通じ、ポートフォリオの着実な成長が期待でき、かつ運用期間中におけるポートフォリオの大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる資産配分比率を選択します。

(2) 「基本的資産配分比率」をポートフォリオ構築の主体としつつ、適時、市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)を行います。

- 投資環境やマクロ経済の状況に関する定点観測、および市場テーマ・金融政策の動向などに関する分析(定性判断)を行います。
- 相対的な魅力度が高いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや高め、また相対的な魅力度が低いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや低めに調整します。

市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)プロセス図 [適時]

<定点観測>

- 投資環境の分析(主に定量分析)
- 主要国・地域のマクロ分析

<定性判断>

- 政策(特に金融政策を重視)
- イベント(選挙、政治、地政学リスク等)
- 市場のテーマ
- 長期サイクル転換点の判断

- 市場見通しの策定
- 資産配分の見直し

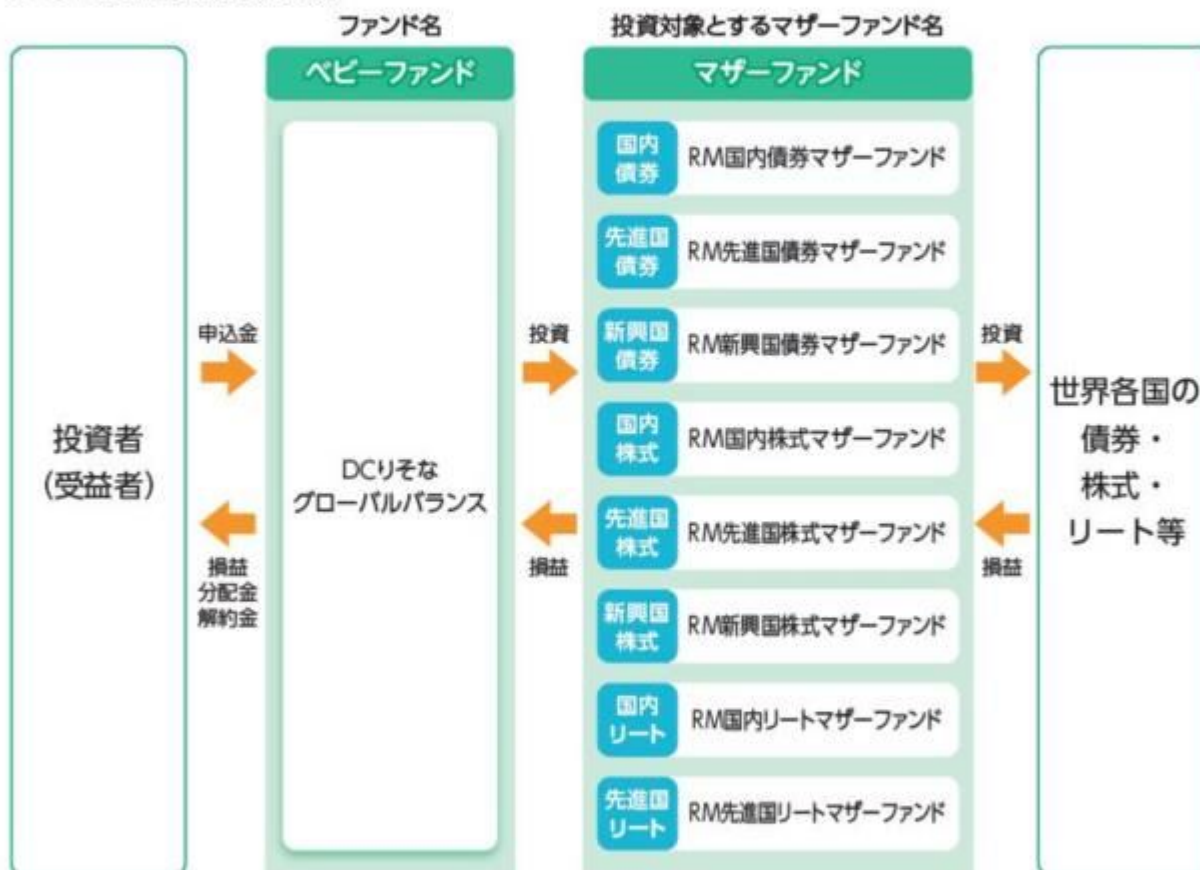
(3) 各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記(1)による独自の定量モデルを用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、(2)の市場動向に応じた資産配分の見直し(調整)を適時行い決定します。

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

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。

ファンドの仕組み

当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を実質的に投資を行う、ファミリーファンド方式で運用を行います。



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年1月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売却益(評価益を含みます。)等とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して分配を行わないことがあります。
- ③留保金は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RM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。

●RM先進国債券マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM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。

●RM先進国株式マザーファンド

「MSCI-KOKUSA指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSA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-KOKUSA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。

●RM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。

●RM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。

●RM先進国リートマザーファンド

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

信託金限度額

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

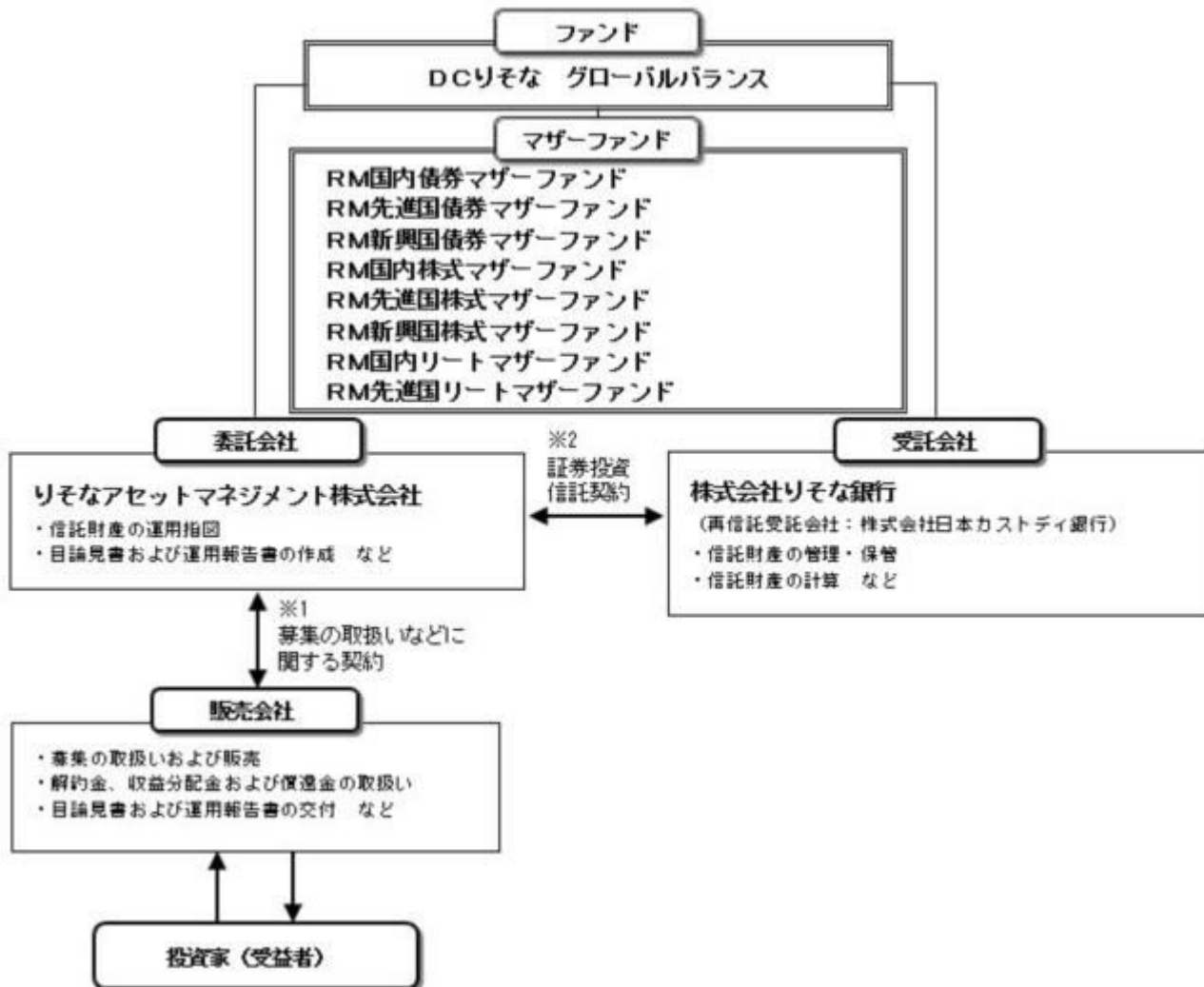
(2)【ファンドの沿革】

2016年5月12日

- ・ファンドの信託契約締結、当初自己設定、運用開始

（３）【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2021年1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】

以下に掲げるマザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。

R M国内債券マザーファンド受益証券
 R M先進国債券マザーファンド受益証券
 R M新興国債券マザーファンド受益証券
 R M国内株式マザーファンド受益証券
 R M先進国株式マザーファンド受益証券
 R M新興国株式マザーファンド受益証券
 R M国内リートマザーファンド受益証券
 R M先進国リートマザーファンド受益証券

2021年4月24日付で当ファンドが投資対象とするマザーファンドの名称を変更しております。

新名称	旧名称
R M国内債券マザーファンド	R A M国内債券マザーファンド
R M先進国債券マザーファンド	R A M先進国債券マザーファンド
R M新興国債券マザーファンド	R A M新興国債券マザーファンド
R M国内株式マザーファンド	R A M国内株式マザーファンド
R M先進国株式マザーファンド	R A M先進国株式マザーファンド
R M新興国株式マザーファンド	R A M新興国株式マザーファンド
R M国内リートマザーファンド	R A M国内リートマザーファンド
R M先進国リートマザーファンド	R A M先進国リートマザーファンド

主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式・上場投資信託証券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等（上場投資信託証券を含む。）への分散投資を行います。

中長期的な運用に適したポートフォリオ構築にあたり、以下の2つの手法を組み合わせます。

1. 原則年1回程度、独自の定量モデルを用いて「基本的資産配分比率」を決定します。すなわち、定量モデルを用いたポートフォリオの評価に従い、信託財産の着実な成長が期待でき、かつ運用期間中における信託財産の大幅な下落リスクを抑制する効果が期待できる投資比率を、「基本的資産配分比率」とします。
2. また、「基本的資産配分比率」をポートフォリオ構築の主体としつつ、適時、市場動向に応じた資産配分の見直し（調整）を行います。具体的には、投資環境やマクロ経済の状況に関する定点観測、および市場テーマ・金融政策の動向などに関する分析を行い、相対的な魅力度が高いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや高め、また相対的な魅力度が低いと判断した資産への投資比率を「基本的資産配分比率」よりやや低めに調整します。

各マザーファンド受益証券への投資比率は、上記 1. による独自の定量モデル用いて決定した「基本的資産配分比率」を基本として、上記 2. の市況動向に応じた資産配分の見直し（調整）を適時行い決定します。

株価指数先物取引、債券先物取引等を利用することがあります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げることがあります。

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。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。)
 - ハ) 約束手形(イ)に掲げるものに該当するものを除きます。)
 - ニ) 金銭債権(イ)、ロ)およびハ)に掲げるものに該当するものを除きます。)

2) 次に掲げる特定資産以外の資産

- イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 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す。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
- 20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M国内債券マザーファンド >

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

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

< R M先進国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

< R M新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、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	<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"> ・ J Pモルガン G B I E Mグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース） に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）

投資方針	<p>主として、ＪＰモルガンＧＢＩ ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</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>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	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M国内株式マザーファンド >

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

主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証株価指数(ＴＯＰＩＸ、配当込み)に採用されている株式
投資方針	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。
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

< R M先進国株式マザーファンド >

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

< R M新興国株式マザーファンド >

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

< R M国内リートマザーファンド >

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

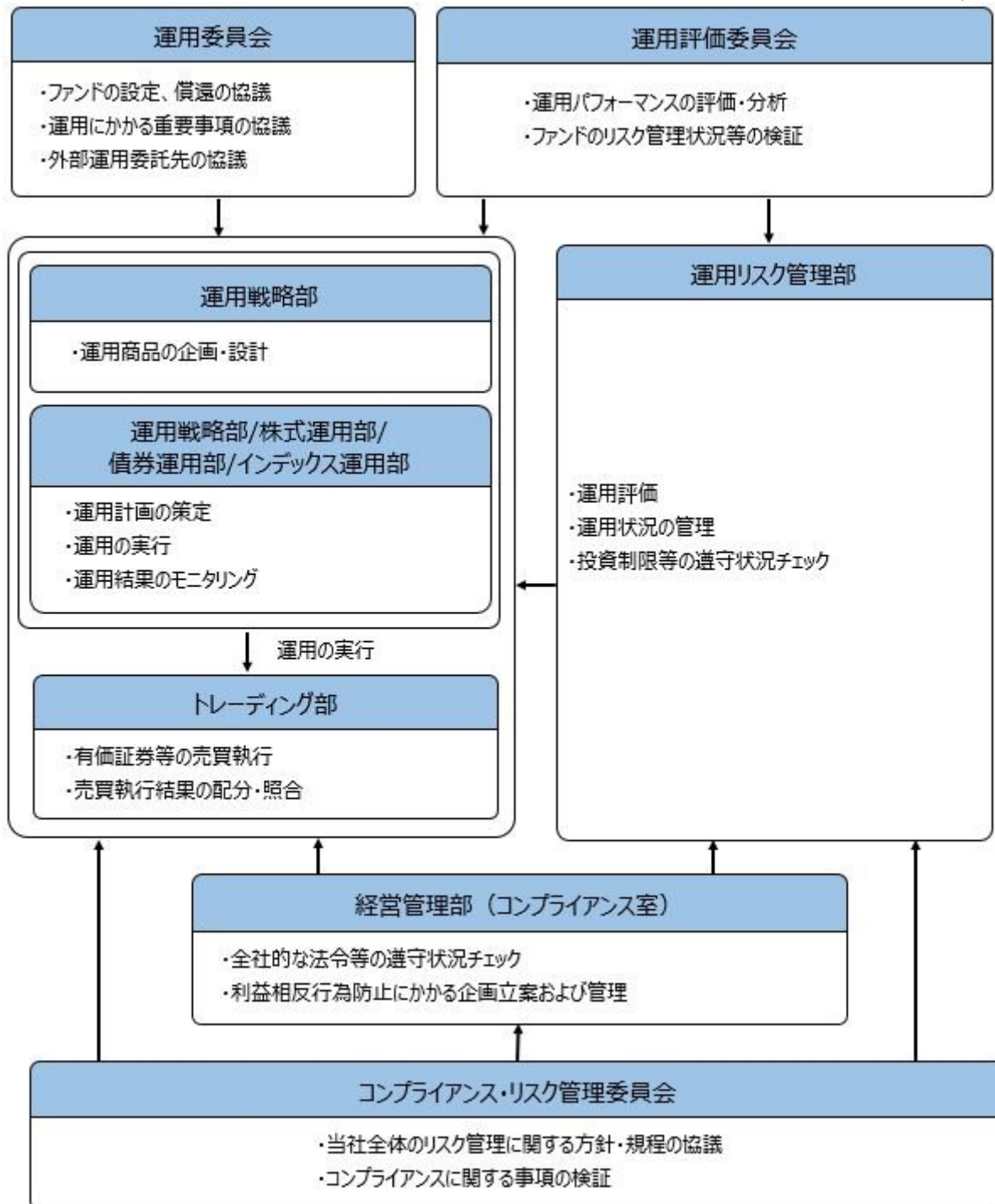
< R M先進国リートマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 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。 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	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

(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、2021年1月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、信託財産の中長期的な成長に資することを考慮して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

原則として、収益分配金は無手数料で自動的に再投資されます。

(5) 【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限りません。）の行使により取得可能な株券
 - ヘ) 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取る配当金も含まれます。)ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受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とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

す。

17) 資金の借入れ

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

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ことがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

(その他の留意点)

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

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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感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2021年1月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

【参考情報】

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年5月から2021年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	5.2	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△2.9	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	1.1	3.7	7.1	5.3	1.4	1.0	1.1

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2016年2月から2021年1月の5年間(当ファンドは2017年5月から2021年1月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX, 配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み, 円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。
信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.66%（税抜0.60%）の率を乗じて得た額とします。

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。

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
0.28%	0.28%	0.04%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（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。

確定拠出年金の場合

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

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

確定拠出年金でない場合

個人受益者の場合

1) 収益分配金に対する課税

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

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

2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

法人受益者の場合

1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

2) 受益者が収益分配金を受け取る際

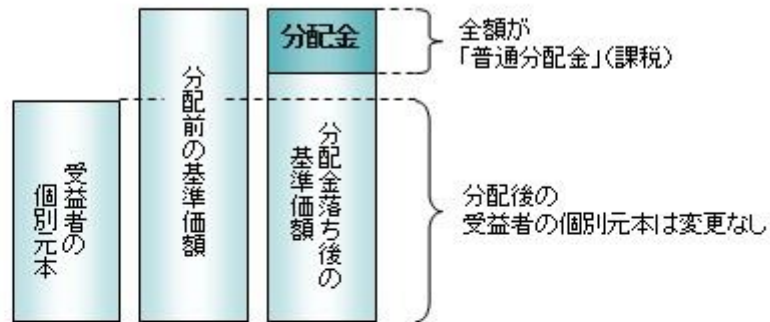
イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

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

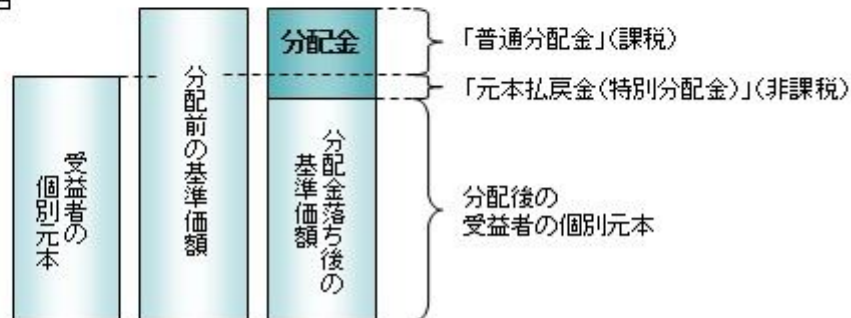
ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

<分配金に関するイメージ図>

イ) の場合



ロ)、ハ) の場合



上記は2021年1月末現在のものですので、税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【DCりそな グローバルバランス】

以下の運用状況は2021年 1月29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	754,955,380	99.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,264,566	0.30
合計(純資産総額)		757,219,946	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国内債券マザーファンド	489,731,772	1.0506	514,512,200	1.0497	514,071,441	67.89

日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	51,884,772	1.5774	81,843,040	1.5612	81,002,506	10.70
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	72,774,507	1.0589	77,060,926	1.0654	77,533,959	10.24
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	17,579,728	1.2649	22,236,598	1.3025	22,897,595	3.02
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	17,481,139	1.3336	23,312,847	1.2958	22,652,059	2.99
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	13,842,182	1.0775	14,914,952	1.0821	14,978,625	1.98
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	8,925,591	1.6589	14,806,662	1.6223	14,479,986	1.91
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	7,014,441	1.0370	7,273,976	1.0463	7,339,209	0.97

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.70
合計	99.70

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年 1月25日)	44	44	1.0004	1.0004
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	117	117	1.0382	1.0382
第3計算期間末 (2019年 1月25日)	273	273	1.0147	1.0147
第4計算期間末 (2020年 1月27日)	529	529	1.0590	1.0590
第5計算期間末 (2021年 1月25日)	740	740	1.0648	1.0648
2020年 1月末日	540		1.0584	
2月末日	555		1.0465	
3月末日	539		1.0053	
4月末日	560		1.0172	
5月末日	582		1.0248	
6月末日	618		1.0261	
7月末日	629		1.0298	

8月末日	650		1.0397
9月末日	657		1.0368
10月末日	662		1.0284
11月末日	686		1.0515
12月末日	708		1.0606
2021年 1月末日	757		1.0633

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.04
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.78
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	2.26
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4.37
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.55

(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	2016年 5月12日～2017年 1月25日	47,045,838	2,987,019
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	94,737,024	26,010,237
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	234,142,892	77,862,922
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	314,458,168	83,848,056
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	295,744,267	99,995,699

(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2021年 1月29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	68,626,747,820	82.80
地方債証券	日本	4,454,368,900	5.37
特殊債券	日本	5,618,704,527	6.78
社債券	日本	3,316,911,000	4.00
	フランス	100,317,000	0.12
	オーストラリア	99,989,000	0.12
	小計	3,517,217,000	4.24
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		666,483,968	0.80
合計（純資産総額）		82,883,522,215	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	100.38	1,284,966,400	100.37	1,284,812,800	0.100	2022/9/20	1.55
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	1,020,000,000	100.74	1,027,568,400	100.72	1,027,364,400	0.100	2024/3/20	1.24
日本	国債証券	第135回利付国債（5年）	1,000,000,000	100.49	1,004,940,000	100.48	1,004,800,000	0.100	2023/3/20	1.21
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	934,000,000	102.47	957,153,860	102.42	956,621,480	0.400	2025/9/20	1.15
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	940,000,000	100.56	945,307,400	100.54	945,160,600	0.100	2023/6/20	1.14
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	840,000,000	101.12	849,466,800	100.99	848,349,600	0.100	2029/9/20	1.02
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	830,000,000	100.44	833,710,100	100.43	833,593,900	0.100	2022/12/20	1.01
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	820,000,000	101.26	830,389,400	101.23	830,110,600	0.100	2027/3/20	1.00
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	790,000,000	100.89	797,039,800	100.74	795,917,100	0.100	2030/6/20	0.96
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	750,000,000	101.27	759,552,700	101.18	758,910,000	0.100	2028/9/20	0.92
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	740,000,000	100.80	745,936,200	100.78	745,779,400	0.100	2024/6/20	0.90
日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	710,000,000	100.62	714,430,400	100.60	714,309,700	0.100	2023/9/20	0.86

日本	国債証券	第138回利付国債(5年)	700,000,000	100.68	704,781,000	100.66	704,655,000	0.100	2023/12/20	0.85
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	690,000,000	101.24	698,597,400	101.21	698,369,700	0.100	2026/12/20	0.84
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	660,000,000	100.77	665,082,000	100.62	664,118,400	0.100	2030/9/20	0.80
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	650,000,000	101.26	658,248,500	101.14	657,449,000	0.100	2028/12/20	0.79
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	631,000,000	102.20	644,932,480	102.17	644,743,180	0.400	2025/3/20	0.78
日本	国債証券	第144回利付国債(5年)	630,000,000	101.03	636,513,200	100.99	636,243,300	0.100	2025/6/20	0.77
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	630,000,000	101.02	636,451,200	100.88	635,594,400	0.100	2029/12/20	0.77
日本	国債証券	第358回利付国債(10年)	600,000,000	100.96	605,760,000	100.82	604,920,000	0.100	2030/3/20	0.73
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	570,000,000	101.22	576,965,400	101.16	576,617,700	0.100	2026/9/20	0.70
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	560,000,000	101.19	566,692,000	101.13	566,361,600	0.100	2026/6/20	0.68
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	560,000,000	100.97	565,482,400	100.95	565,342,400	0.100	2025/3/20	0.68
日本	国債証券	第413回利付国債(2年)	550,000,000	100.32	551,776,500	100.30	551,683,000	0.100	2022/6/1	0.67
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	532,000,000	102.12	543,299,680	102.09	543,156,040	0.600	2023/12/20	0.66
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	520,000,000	101.29	526,723,600	101.25	526,520,800	0.100	2028/3/20	0.64
日本	国債証券	第151回利付国債(20年)	455,000,000	113.52	516,539,700	113.20	515,064,550	1.200	2034/12/20	0.62
日本	国債証券	第355回利付国債(10年)	490,000,000	101.18	495,788,600	101.04	495,140,100	0.100	2029/6/20	0.60
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	480,000,000	101.31	486,326,400	101.28	486,144,000	0.100	2027/12/20	0.59
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	480,000,000	100.92	484,420,800	100.89	484,305,600	0.100	2024/12/20	0.58

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	82.80
地方債証券	5.37
特殊債券	6.78
社債券	4.24
合計	99.20

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

RAM先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 1月29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	13,449,473,148	42.30
	カナダ	616,245,342	1.94
	メキシコ	248,955,696	0.78
	ドイツ	2,422,352,812	7.62
	イタリア	2,971,227,657	9.35
	フランス	3,353,923,157	10.55
	オランダ	621,095,680	1.95
	スペイン	1,902,897,403	5.99
	ベルギー	794,596,107	2.50
	オーストリア	477,947,058	1.50
	フィンランド	197,293,455	0.62
	アイルランド	263,261,250	0.83
	イギリス	2,156,312,627	6.78
	スウェーデン	99,031,300	0.31
	ノルウェー	67,631,701	0.21
	デンマーク	152,373,880	0.48
	ポーランド	195,667,125	0.62
	オーストラリア	864,584,467	2.72
	シンガポール	134,352,086	0.42
	マレーシア	143,440,280	0.45
イスラエル	133,833,663	0.42	
	小計	31,266,495,894	98.34
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		527,495,479	1.66
合計（純資産総額）		31,793,991,373	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		121,825,800	0.38

(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	2,580,000	10,449.04	269,585,355	10,449.63	269,600,504	0.125	2022/11/30	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	10,435.75	260,893,899	10,433.30	260,832,674	0.125	2023/12/15	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,810,000	10,241.48	185,370,931	10,275.77	185,991,453	0.875	2030/11/15	0.58
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,023.55	161,379,155	10,057.83	161,931,094	0.625	2030/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,510,000	10,341.47	156,156,325	10,354.94	156,359,698	0.500	2027/5/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	11,363.83	147,729,816	11,367.50	147,777,572	2.250	2025/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,731.23	142,725,464	10,729.60	142,703,759	1.625	2022/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	12,010.71	140,525,313	12,033.15	140,787,936	2.875	2028/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	10,826.33	129,915,976	10,914.48	130,973,835	2.000	2050/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,160,000	11,068.96	128,399,949	11,066.30	128,369,177	2.000	2024/5/31	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	520,000	23,732.70	123,410,077	23,781.75	123,665,132	4.500	2041/4/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,374.12	122,414,715	10,381.47	122,501,410	0.250	2025/9/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,361.47	122,265,428	10,376.17	122,438,806	0.625	2027/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,140,000	10,474.12	119,404,968	10,472.48	119,386,351	0.250	2023/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	11,216.49	118,894,882	11,220.98	118,942,472	2.000	2025/8/15	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	18,955.30	117,522,889	18,996.19	117,776,413	5.500	2029/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,130,000	10,352.90	116,987,843	10,365.55	117,130,804	0.500	2027/4/30	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	770,000	14,989.89	115,422,162	15,029.61	115,728,062	1.500	2031/5/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	710,000	16,057.10	114,005,437	16,093.12	114,261,190	2.500	2030/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	10,462.28	110,900,204	10,468.40	110,965,103	0.375	2025/4/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,050,000	10,422.69	109,438,306	10,430.85	109,524,007	0.375	2025/11/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	10,284.75	109,018,350	10,299.44	109,174,085	0.500	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	12,231.09	108,856,767	12,254.36	109,063,812	3.125	2028/11/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	680,000	15,490.63	105,336,339	15,523.52	105,559,955	2.750	2027/10/25	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	780,000	13,367.41	104,265,862	13,377.41	104,343,799	1.750	2023/5/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	10,381.47	103,814,755	10,388.61	103,886,178	0.250	2025/8/31	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	790,000	12,983.16	102,567,012	13,005.32	102,742,032	0.000	2025/3/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	850,000	11,873.58	100,925,434	11,889.90	101,064,197	2.750	2028/2/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	840,000	11,987.85	100,697,986	12,005.81	100,848,825	2.875	2028/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,030,000	9,297.90	95,768,399	9,384.42	96,659,586	1.375	2050/8/15	0.30

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.34
合計	98.34

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	500,000.00	52,139,500	52,235,000	0.16
	カナダドル	買建	30,000.00	2,442,900	2,440,200	0.01
	ユーロ	買建	400,000.00	50,496,000	50,592,000	0.16
	英ポンド	買建	60,000.00	8,559,600	8,593,800	0.03
	スウェーデンクローナ	買建	140,000.00	1,745,660	1,750,000	0.01
	デンマーククローネ	買建	130,000.00	2,207,010	2,211,300	0.01
	オーストラリアドル	買建	50,000.00	3,989,500	4,003,500	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 1月29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	1,525,813,595	29.47
	アイルランド	3,563,186,293	68.81
	小計	5,088,999,888	98.28
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		89,200,500	1.72
合計(純資産総額)		5,178,200,388	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	586,887	6,080.68	3,568,674,225	6,071.33	3,563,186,293	68.81
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	447,012	3,423.63	1,530,404,085	3,413.36	1,525,813,595	29.47

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.28
合計	98.28

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 1月29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	38,990,680,500	98.44
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		619,738,594	1.56
合計（純資産総額）		39,610,419,094	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	685,520,000	1.73

(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	159,600	7,674.89	1,224,913,467	7,300.00	1,165,080,000	2.94
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	122,600	8,657.53	1,061,414,250	8,108.00	994,040,800	2.51
日本	株式	ソニー	電気機器	98,700	10,295.63	1,016,178,688	10,050.00	991,935,000	2.50
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,500	57,433.44	890,218,325	56,140.00	870,170,000	2.20
日本	株式	任天堂	その他製品	9,000	62,680.00	564,120,000	60,580.00	545,220,000	1.38
日本	株式	日本電産	電気機器	37,900	14,321.51	542,785,290	13,850.00	524,915,000	1.33
日本	株式	信越化学工業	化学	28,500	19,557.49	557,388,735	18,175.00	517,987,500	1.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,062,700	479.92	510,020,500	469.30	498,725,110	1.26
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	107,800	4,671.27	503,563,790	4,542.00	489,627,600	1.24
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	131,100	3,714.39	486,956,841	3,698.00	484,807,800	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	180,800	2,739.39	495,282,579	2,618.00	473,334,400	1.19
日本	株式	村田製作所	電気機器	46,300	10,576.03	489,670,249	10,055.00	465,546,500	1.18

日本	株式	第一三共	医薬品	135,200	3,583.66	484,510,931	3,365.00	454,948,000	1.15
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,100	23,313.25	468,596,348	22,105.00	444,310,500	1.12
日本	株式	HOYA	精密機器	31,200	13,698.55	427,395,025	13,395.00	417,924,000	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	123,900	3,253.58	403,119,766	3,079.00	381,488,100	0.96
日本	株式	ファナック	電気機器	13,800	26,965.79	372,127,902	27,365.00	377,637,000	0.95
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,200	43,970.00	404,524,000	39,810.00	366,252,000	0.92
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	107,500	3,315.24	356,388,410	3,245.00	348,837,500	0.88
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	124,000	2,823.93	350,168,157	2,764.50	342,798,000	0.87
日本	株式	日立製作所	電気機器	75,700	4,397.73	332,908,696	4,306.00	325,964,200	0.82
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	108,500	3,128.71	339,465,168	2,997.50	325,228,750	0.82
日本	株式	S M C	機械	4,600	67,714.14	311,485,044	63,360.00	291,456,000	0.74
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	211,100	1,392.53	293,964,074	1,378.50	291,001,350	0.73
日本	株式	花王	化学	37,700	7,679.52	289,517,961	7,597.00	286,406,900	0.72
日本	株式	中外製薬	医薬品	49,300	5,646.83	278,389,202	5,472.00	269,769,600	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	51,500	5,408.16	278,520,582	5,133.00	264,349,500	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,000	16,227.23	259,635,766	16,350.00	261,600,000	0.66
日本	株式	三菱電機	電気機器	157,500	1,668.94	262,859,563	1,594.50	251,133,750	0.63
日本	株式	三菱商事	卸売業	94,500	2,707.47	255,855,978	2,647.50	250,188,750	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	0.09
		鉱業	0.15
		建設業	2.26
		食料品	3.51
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.53
		医薬品	5.92
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.55
		ガラス・土石製品	0.78
		鉄鋼	0.59
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.58
		機械	5.68
		電気機器	17.85
		輸送用機器	6.68
		精密機器	2.65
その他製品	2.46		
電気・ガス業	1.33		

	陸運業	3.39
	海運業	0.17
	空運業	0.40
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	9.11
	卸売業	4.47
	小売業	4.69
	銀行業	4.51
	証券、商品先物取引業	0.74
	保険業	1.83
	その他金融業	1.09
	不動産業	1.87
	サービス業	5.52
合 計		98.44

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	38	日本円	704,992,750	685,520,000	1.73

(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2021年 1月29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	45,886,714,511	54.42
	カナダ	2,303,984,342	2.73
	パナマ	13,684,258	0.02
	ドイツ	2,089,697,772	2.48
	イタリア	403,984,434	0.48
	フランス	2,236,428,683	2.65
	オランダ	1,270,927,275	1.51
	スペイン	534,188,617	0.63
	ベルギー	197,891,896	0.23

	オーストリア	38,717,634	0.05
	ルクセンブルク	56,345,668	0.07
	フィンランド	280,799,467	0.33
	アイルランド	1,211,033,174	1.44
	ポルトガル	41,401,304	0.05
	イギリス	3,031,108,476	3.59
	スイス	2,365,149,086	2.81
	スウェーデン	742,281,808	0.88
	ノルウェー	135,126,441	0.16
	デンマーク	561,292,874	0.67
	ケイマン	125,273,382	0.15
	リベリア	17,754,501	0.02
	オーストラリア	1,455,239,639	1.73
	バミューダ	204,704,548	0.24
	ニュージーランド	86,675,618	0.10
	パプアニューギニア	10,510,340	0.01
	香港	565,878,786	0.67
	シンガポール	206,746,889	0.25
	イスラエル	138,098,707	0.16
	キュラソー	43,909,425	0.05
	ジャージー	252,554,687	0.30
	マン島	12,364,334	0.01
	小計	66,520,468,576	78.89
投資証券	アメリカ	1,231,403,000	1.46
	カナダ	6,161,985	0.01
	フランス	36,826,250	0.04
	イギリス	40,661,253	0.05
	オーストラリア	101,602,553	0.12
	香港	28,754,120	0.03
	シンガポール	33,154,797	0.04
	小計	1,478,563,958	1.75
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,317,650,620	19.35
合計（純資産総額）		84,316,683,154	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	13,109,393,952	15.55
	買建	ドイツ	3,426,933,222	4.06

(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		414,119,080	0.49
--------	----	--	-------------	------

(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	233,699	14,530.03	3,395,654,323	14,323.16	3,347,308,917	3.97
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	98,226	23,607.25	2,318,846,328	24,963.40	2,452,055,557	2.91
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	5,817	343,972.19	2,000,886,231	338,266.53	1,967,696,449	2.33
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	32,918	28,679.76	944,080,340	27,687.20	911,407,250	1.08
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	10,210	88,456.94	903,145,431	87,285.72	891,187,267	1.06
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	4,114	198,621.70	817,129,691	194,657.73	800,821,913	0.95
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,117	197,734.66	814,073,631	193,622.33	797,143,157	0.95
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	36,055	17,087.70	616,097,168	17,673.83	637,230,186	0.76
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	41,718	13,978.37	583,150,024	13,593.89	567,110,020	0.67
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	23,094	21,107.04	487,446,203	20,710.02	478,277,331	0.57
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	39,531	11,868.83	469,187,106	12,070.92	477,175,641	0.57
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	19,252	24,335.48	468,506,691	24,129.65	464,544,137	0.55
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	34,093	13,582.39	463,064,763	13,620.01	464,347,096	0.55
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	8,445	57,307.28	483,959,980	54,542.73	460,613,433	0.55
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	13,033	36,312.02	473,254,609	35,329.91	460,454,743	0.55
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	24,844	18,052.05	448,485,240	17,958.02	446,149,109	0.53
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	14,748	29,672.32	437,607,376	29,050.66	428,439,193	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	12,242	34,372.87	420,792,738	33,880.77	414,768,440	0.49
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	15,303	26,328.96	402,912,075	24,844.29	380,192,311	0.45
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	9,649	37,414.69	361,014,348	37,250.20	359,427,223	0.43

アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	6,074	59,048.96	358,663,393	56,272.92	341,801,765	0.41
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	58,306	5,919.83	345,162,004	5,857.67	341,537,377	0.41
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	106,922	3,296.34	352,451,693	3,167.83	338,711,104	0.40
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	62,734	5,086.08	319,070,544	5,391.16	338,209,533	0.40
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	5,862	58,547.59	343,205,984	56,789.51	332,900,166	0.39
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	56,968	6,004.46	342,062,396	5,785.05	329,563,161	0.39
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	6,583	49,360.53	324,940,377	48,653.20	320,284,026	0.38
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	24,356	11,789.52	287,145,627	12,578.34	306,358,224	0.36
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	30,528	10,095.91	308,208,115	9,731.69	297,089,237	0.35
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	98,260	3,022.60	297,001,305	3,009.02	295,666,698	0.35

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	3.57
		資本財	5.14
		商業・専門サービス	0.90
		運輸	1.57
		自動車・自動車部品	1.83
		耐久消費財・アパレル	1.55
		消費者サービス	1.22
		メディア・娯楽	5.64
		小売	4.86
		食品・生活必需品小売り	1.16
		食品・飲料・タバコ	3.25
		家庭用品・パーソナル用品	1.53
		ヘルスケア機器・サービス	4.25
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.48
		銀行	4.52
		各種金融	3.52
		保険	2.47
		不動産	0.36
		ソフトウェア・サービス	9.69
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.18		
電気通信サービス	1.48		

		公益事業	2.62
		半導体・半導体製造装置	3.64
投資証券			1.75
合計			80.65

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	SP500MIN2103	買建	664	米ドル	127,284,967.5	13,298,733,404	125,472,760	13,109,393,952	15.55
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002103	買建	1,349	ユーロ	27,385,670	3,463,739,536	27,094,665	3,426,933,222	4.06

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	3,964,000.00	412,947,311	414,119,080	0.49

(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2021年 1月29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	39,711,254	0.29
	アルゼンチン	1,387,275	0.01
	メキシコ	180,339,628	1.33
	ブラジル	527,842,819	3.88
	チリ	55,575,041	0.41
	コロンビア	18,508,698	0.14
	ペルー	3,426,120	0.03
	オランダ	33,836,366	0.25
	ルクセンブルク	21,284,111	0.16
	ギリシャ	10,187,213	0.07
	トルコ	40,000,412	0.29

	チェコ	10,322,284	0.08
	ハンガリー	23,579,677	0.17
	ポーランド	65,366,344	0.48
	ロシア	266,439,195	1.96
	ケイマン	3,048,912,875	22.41
	バミューダ	86,236,835	0.63
	香港	126,269,342	0.93
	シンガポール	2,972,340	0.02
	マレーシア	156,612,553	1.15
	タイ	197,703,383	1.45
	フィリピン	76,878,809	0.57
	インドネシア	145,673,355	1.07
	韓国	1,512,044,855	11.11
	台湾	1,466,442,325	10.78
	中国	1,226,265,628	9.01
	インド	1,001,155,595	7.36
	カタール	76,736,849	0.56
	エジプト	7,761,928	0.06
	南アフリカ	374,591,674	2.75
	ジャージー	7,009,771	0.05
	英ヴァージン諸島	4,567,066	0.03
	アラブ首長国連邦	63,568,266	0.47
	マン島	3,819,205	0.03
	クウェート	56,058,650	0.41
	サウジアラビア	268,040,906	1.97
	小計	11,207,128,647	82.38
投資証券	メキシコ	5,377,836	0.04
	南アフリカ	4,082,129	0.03
	小計	9,459,965	0.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,387,759,030	17.55
合計(純資産総額)		13,604,347,642	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,389,967,453	17.57

(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		12,315,828	0.09
	売建		92,923	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 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	324,000	2,420.77	784,329,480	2,241.73	726,320,520	5.34
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	75,600	9,314.68	704,189,808	9,179.88	693,998,928	5.10
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	24,830	27,020.61	670,921,935	27,244.20	676,473,605	4.97
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	62,780	8,133.16	510,599,785	7,842.68	492,364,078	3.62
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	47,500	5,125.09	243,442,060	4,793.48	227,690,680	1.67
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,730	24,520.32	140,501,434	24,162.56	138,451,469	1.02
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	11,420	9,916.19	113,242,968	9,550.51	109,066,902	0.80
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	16,900	6,472.53	109,385,858	6,098.49	103,064,609	0.76
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,273,000	81.68	103,989,843	80.74	102,788,640	0.76
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	37,549	2,951.42	110,823,019	2,702.23	101,466,109	0.75
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	78,500	1,314.30	103,172,550	1,259.03	98,834,012	0.73
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,650	26,407.32	96,386,718	25,584.01	93,381,664	0.69
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	5,000	17,959.06	89,795,336	17,694.73	88,473,664	0.65
ブラジル	株式	VALE SA	素材	48,800	1,788.86	87,296,563	1,749.12	85,357,056	0.63
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	7,250	12,040.44	87,293,262	11,525.10	83,556,975	0.61
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	44,914	1,930.82	86,721,029	1,837.72	82,539,715	0.61
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	22,428	3,728.80	83,629,706	3,493.07	78,342,798	0.58
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,879	7,271.12	79,102,515	7,083.72	77,063,790	0.57
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	188,000	401.70	75,520,352	394.96	74,253,232	0.55
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	165,800	453.19	75,139,731	442.00	73,284,429	0.54
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	5,510	12,199.08	67,216,957	12,249.23	67,493,286	0.50
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	20,000	3,420.41	68,408,200	3,241.37	64,827,400	0.48

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	40,500	1,635.12	66,222,522	1,446.40	58,579,362	0.43
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,388	4,756.46	58,923,076	4,603.03	57,022,360	0.42
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	810,000	67.93	55,030,752	67.26	54,484,812	0.40
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,629	32,185.95	52,430,913	33,263.50	54,186,242	0.40
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	607	91,357.49	55,454,002	87,890.59	53,349,594	0.39
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	731	74,210.40	54,247,803	71,867.90	52,535,435	0.39
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	35,132	1,490.92	52,379,339	1,457.49	51,204,750	0.38
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	67,302	768.67	51,733,163	760.67	51,195,285	0.38

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	3.80
		素材	6.05
		資本財	2.20
		商業・専門サービス	0.22
		運輸	1.08
		自動車・自動車部品	3.18
		耐久消費財・アパレル	1.15
		消費者サービス	1.25
		メディア・娯楽	8.21
		小売	10.37
		食品・生活必需品小売り	0.98
		食品・飲料・タバコ	2.81
		家庭用品・パーソナル用品	0.87
		ヘルスケア機器・サービス	1.08
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.73
		銀行	10.13
		各種金融	1.69
		保険	2.27
		不動産	1.54
		ソフトウェア・サービス	1.98
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.82		
電気通信サービス	1.88		
公益事業	1.58		
半導体・半導体製造装置	7.50		
投資証券			0.07
合計			82.45

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 2103	買建	336	米ドル	23,375,885	2,442,312,462	22,874,880	2,389,967,453	17.57

(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	117,888.66	12,316,146	12,315,828	0.09
	ブラジルリアル	売建	4,839.77	93,262	92,923	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国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 1月29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	23,868,317,720	97.44
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		627,768,759	2.56
合計(純資産総額)		24,496,086,479	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	625,564,500	2.55

(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	2,715	593,056.72	1,610,149,000	632,000	1,715,880,000	7.00
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,412	604,059.7	1,456,992,000	637,000	1,536,444,000	6.27
日本	投資証券	G L P 投資法人	7,538	170,507.56	1,285,286,000	167,800	1,264,876,400	5.16
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,650	333,539.45	1,217,419,000	341,500	1,246,475,000	5.09
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	7,801	153,009.99	1,193,631,000	158,900	1,239,578,900	5.06
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,442	269,839.01	928,785,900	281,300	968,234,600	3.95
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	4,532	188,115.73	852,540,500	198,000	897,336,000	3.66
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,806	168,911.98	811,791,000	175,200	842,011,200	3.44
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,159	133,814.61	690,349,600	142,300	734,125,700	3.00
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,291	305,014.4	698,788,000	310,000	710,210,000	2.90
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,410	192,999.5	658,128,300	188,200	641,762,000	2.62
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,502	359,031.95	539,266,000	369,500	554,989,000	2.27
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,095	73,903.45	524,345,000	75,700	537,091,500	2.19
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,209	417,042.18	504,204,000	419,000	506,571,000	2.07
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	746	652,973.19	487,118,000	675,000	503,550,000	2.06
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,576	312,010.15	491,728,000	313,000	493,288,000	2.01
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	831	556,038.5	462,068,000	576,000	478,656,000	1.95
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,688	164,199.51	441,368,300	164,200	441,369,600	1.80
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	842	529,990.49	446,252,000	524,000	441,208,000	1.80
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,834	146,613.23	415,501,900	145,800	413,197,200	1.69
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,771	52,801	410,316,600	52,500	407,977,500	1.67
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	10,087	34,801.01	351,037,800	34,850	351,531,950	1.44
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	514	652,029.18	335,143,000	677,000	347,978,000	1.42
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	801	413,512.48	331,223,500	429,000	343,629,000	1.40
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,447	137,105.84	335,498,000	138,000	337,686,000	1.38
日本	投資証券	大和証券りびング投資法人	3,150	97,108.12	305,890,600	100,400	316,260,000	1.29
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,053	294,196.01	309,788,400	297,500	313,267,500	1.28
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,942	153,322.14	297,751,600	159,000	308,778,000	1.26
日本	投資証券	日本リート投資法人	784	355,005.1	278,324,000	372,000	291,648,000	1.19
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,952	94,407.11	278,689,800	98,400	290,476,800	1.19

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	97.44
合計	97.44

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	341	日本円	607,291,520	625,564,500	2.55

(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2021年1月29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	15,538,723	0.07
投資証券	アメリカ	16,316,645,833	72.37
	カナダ	420,241,908	1.86
	ドイツ	66,779,163	0.30
	イタリア	4,896,266	0.02
	フランス	576,384,846	2.56
	オランダ	43,311,383	0.19
	スペイン	106,718,931	0.47
	ベルギー	315,700,988	1.40
	アイルランド	29,251,170	0.13
	イギリス	1,249,962,097	5.54
	オーストラリア	1,654,706,309	7.34
	ニュージーランド	112,486,031	0.50
	香港	369,090,285	1.64
	シンガポール	966,165,953	4.29
	韓国	29,357,147	0.13
	イスラエル	14,173,051	0.06
	ガーンジー	59,031,986	0.26
	マン島	6,025,319	0.03
	小計	22,340,928,666	99.09
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		188,872,507	0.84
合計(純資産総額)		22,545,339,896	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	125,169	10,575.46	1,323,720,453	10,803.23	1,352,229,746	6.00
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	15,087	75,346.79	1,136,757,124	77,130.27	1,163,664,390	5.16
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	47,423	14,675.26	695,944,893	15,136.01	717,795,363	3.18
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	25,747	23,277.09	599,315,473	23,770.24	612,012,493	2.71
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	55,469	9,976.79	553,402,853	10,187.84	565,109,563	2.51
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	70,569	6,589.55	465,018,208	6,454.77	455,506,975	2.02
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,628	17,210.99	406,661,281	17,345.76	409,845,844	1.82
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	284,235	1,421.41	404,017,313	1,416.61	402,651,621	1.79
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	59,337	6,252.08	370,979,861	6,368.05	377,861,339	1.68
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	57,958	6,431.78	372,773,616	6,515.37	377,617,977	1.67
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,932	17,640.40	369,248,920	17,483.68	365,968,457	1.62
香港	投資証券	LINK REIT	348,300	926.74	322,787,024	918.66	319,969,974	1.42
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	63,296	5,133.10	324,904,849	4,930.41	312,075,307	1.38
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	94,837	3,136.48	297,455,264	3,030.96	287,447,609	1.27
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,945	3,153.20	286,768,356	3,135.44	285,153,027	1.26
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,031	25,435.65	280,580,722	25,427.29	280,488,520	1.24
イギリス	投資証券	SEGR0 PLC	201,220	1,395.44	280,791,258	1,368.80	275,430,226	1.22
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,197	15,352.29	279,365,643	15,021.08	273,338,767	1.21
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,348	14,019.12	271,242,058	13,873.89	268,432,202	1.19
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	62,866	4,204.27	264,305,965	4,124.87	259,314,103	1.15
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,858	12,058.03	263,564,569	11,835.49	258,700,237	1.15
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	90,714	2,757.22	250,119,108	2,700.80	245,001,097	1.09
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,914	9,539.02	228,116,219	9,603.80	229,665,311	1.02
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95,869	2,243.18	215,051,960	2,216.02	212,447,698	0.94
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,321	7,201.77	167,952,506	8,959.84	208,952,503	0.93
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	29,605	7,028.36	208,074,882	7,049.26	208,693,508	0.93
アメリカ	投資証券	UDR INC	49,795	4,086.21	203,472,967	4,066.36	202,484,476	0.90
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	875,142	229.02	200,432,722	226.62	198,330,281	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	28,651	6,611.49	189,425,927	6,425.52	184,097,574	0.82
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	118,920	1,506.60	179,165,062	1,488.84	177,052,853	0.79

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			99.09
合計			99.16

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報

運用実績

2021年1月29日現在

基準価額・純資産の推移



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

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2017年1月25日	0円
2018年1月25日	0円
2019年1月25日	0円
2020年1月27日	0円
2021年1月25日	0円
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■ 資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド	67.9
RAM先進国債券マザーファンド	10.2
RAM新興国債券マザーファンド	2.0
RAM国内株式マザーファンド	3.0
RAM先進国株式マザーファンド	10.7
RAM新興国株式マザーファンド	1.9
RAM国内リートマザーファンド	3.0
RAM先進国リートマザーファンド	1.0
現金等	0.3
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。
※現金等には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。
※2021年4月24日付で上記マザーファンドの名称を変更しております。

■ 各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内債券	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.55
	日本	第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.24
	日本	第135回利付国債(5年)	2023/3/20	1.21
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/11/30	0.85
	アメリカ	US TREASURY N/B	2023/12/15	0.82
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/11/15	0.58
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	-	68.81
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	-	29.47
国内株式	日本	トヨタ自動車	-	2.94
	日本	ソフトバンクグループ	-	2.51
	日本	ソニー	-	2.50
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	-	3.97
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	2.91
	アメリカ	AMAZON.COM INC	-	2.33
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	5.34
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	-	5.10
	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	-	4.97
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	-	7.00
	日本	ジャパニリアルエステイト投資法人	-	6.27
	日本	GLP投資法人	-	5.16
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	-	6.00
	アメリカ	EQUINIX INC	-	5.16
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	3.18

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2016年5月12日が設定日のため、2015年以前の実績はありません。2016年は5月12日から12月末までの騰落率です。2021年は1月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

（1）申込方法

- ・確定拠出年金制度の規定に従い、販売会社所定の方法でお申し込みください。
- ・当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度の拠出金を運用するための専用ファンドです。取得申込者は、確定拠出年金法に定める加入者などの運用の指図に基づいて取得の申込みを行なう資産管理機関および国民年金基金連合会等に限るものとします。
- ・当ファンドは、収益分配金を無手数料で自動的にファンドに再投資する＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞専用です。

（2）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（3）取扱時間

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

（4）取得申込不可日

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

ニューヨークの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

（5）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

（6）申込単位

1円以上1円単位

（7）申込代金の支払い

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

（8）受付の中止および取消

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

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

2【換金（解約）手続等】

（1）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（2）取扱時間

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

（3）解約請求不可日

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

ニューヨークの銀行の休業日

ニューヨーク証券取引所の休業日

ロンドンの銀行の休業日

ロンドン証券取引所の休業日

（4）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約

には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

(5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

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

(6) 手取額

1口当たりの手取額は、解約価額に基づいて計算された金額となります。

上記の手取額は、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合を記載しています。

税法または確定拠出年金法が改正された場合などには、課税上の取扱いが変更になる場合があります。

(7) 解約単位

1口単位

(8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

(9) 受付の中止および取消

- ・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

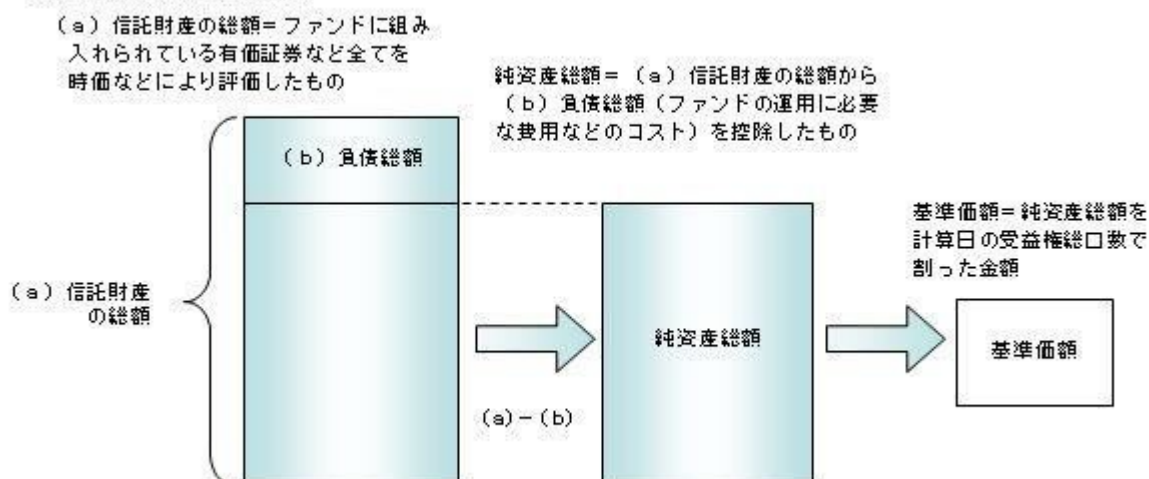
3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。なお、ファンドは1万口当たり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^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

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

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

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2016年5月12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1月26日から翌年1月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
 - 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
 - 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
- 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

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

償還金について

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

信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行いません。（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。

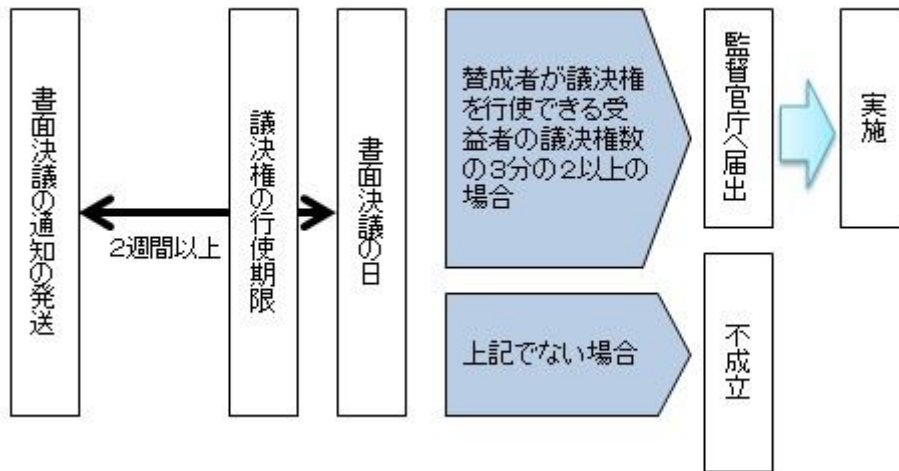
書面決議

- 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、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行いません。
- 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、原則として知れている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

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

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (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5期計算期間(2020年1月28日から2021年1月25日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【DCりそな グローバルバランス】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 2020年 1月27日現在	第5期 2021年 1月25日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,171,334	4,878,235
親投資信託受益証券	527,604,540	738,330,183
未収入金	1,660,000	-
流動資産合計	532,435,874	743,208,418
資産合計	532,435,874	743,208,418
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,916,094	496,865
未払受託者報酬	90,485	146,965
未払委託者報酬	1,266,668	2,057,415
未払利息	8	13
その他未払費用	19,130	28,567
流動負債合計	3,292,385	2,729,825
負債合計	3,292,385	2,729,825
純資産の部		
元本等		
元本	499,675,688	695,424,256
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,467,801	45,054,337
（分配準備積立金）	12,545,628	20,308,107
元本等合計	529,143,489	740,478,593
純資産合計	529,143,489	740,478,593
負債純資産合計	532,435,874	743,208,418

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期		第5期	
	自	2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	自	2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
営業収益				
有価証券売買等損益		17,202,667		12,135,643
営業収益合計		17,202,667		12,135,643
営業費用				
支払利息		2,222		3,078
受託者報酬		155,869		270,347
委託者報酬		2,181,938		3,784,655
その他費用		32,990		52,897
営業費用合計		2,373,019		4,110,977
営業利益又は営業損失（ ）		14,829,648		8,024,666
経常利益又は経常損失（ ）		14,829,648		8,024,666
当期純利益又は当期純損失（ ）		14,829,648		8,024,666
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（ ）		1,717,360		1,707,078
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,958,669		29,467,801
剰余金増加額又は欠損金減少額		14,128,236		11,211,055
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		14,128,236		11,211,055
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,731,392		5,356,263
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,731,392		5,356,263
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		29,467,801		45,054,337

(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原則として、毎年1月26日から翌年1月25日までとなっております。ただし、前計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2020年1月28日から2021年1月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第4期 2020年1月27日現在		第5期 2021年1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況		1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	269,065,576円	期首元本額	499,675,688円
期中追加設定元本額	314,458,168円	期中追加設定元本額	295,744,267円
期中一部解約元本額	83,848,056円	期中一部解約元本額	99,995,699円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	499,675,688口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	695,424,256口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0590円	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0648円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,590円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,648円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第4期 自 2019年1月26日 至 2020年1月27日		第5期 自 2020年1月28日 至 2021年1月25日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	4,556,614円	A 費用控除後の配当等収益額	5,373,276円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	5,211,437円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	4,358,468円
C 収益調整金額	16,922,173円	C 収益調整金額	27,096,077円
D 分配準備積立金額	2,777,577円	D 分配準備積立金額	10,576,363円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	29,467,801円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	47,404,184円
F 当ファンドの期末残存口数	499,675,688口	F 当ファンドの期末残存口数	695,424,256口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	589円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	681円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	第5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>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

第4期 2020年 1月27日現在	第5期 2021年 1月25日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券 同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p>

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

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	第5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第4期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	第5期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	13,419,069	4,441,209
合計	13,419,069	4,441,209

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	477,791,188	501,967,422	
	R A M先進国債券マザーファンド	71,180,372	75,372,895	
	R A M新興国債券マザーファンド	13,377,485	14,415,577	
	R A M国内株式マザーファンド	16,940,770	22,595,599	
	R A M先進国株式マザーファンド	50,787,586	80,117,416	
	R A M新興国株式マザーファンド	8,925,591	14,806,662	
	R A M国内リートマザーファンド	17,333,705	21,920,203	
	R A M先進国リートマザーファンド	6,880,518	7,134,409	
合計		663,217,215	738,330,183	

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R A M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	285,972
コール・ローン	477,802,700
国債証券	67,987,913,900
地方債証券	4,457,575,900
特殊債券	5,621,925,238
社債券	3,517,641,000
未収利息	141,876,019
前払費用	4,511,998
流動資産合計	82,209,532,727
資産合計	82,209,532,727
負債の部	
流動負債	
未払解約金	9,911,000
未払利息	1,295
その他未払費用	44
流動負債合計	9,912,339
負債合計	9,912,339
純資産の部	
元本等	
元本	78,237,277,839
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,962,342,549
元本等合計	82,199,620,388
純資産合計	82,199,620,388
負債純資産合計	82,209,532,727

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)

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月28日
期首元本額	75,458,660,146円
期中追加設定元本額	65,516,965,042円
期中一部解約元本額	62,738,347,349円

期末元本額	78,237,277,839円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,764,666,983円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,035,496,686円
りそなラップ型ファンド(成長型)	136,725,623円
DCりそな グローバルバランス	477,791,188円
つみたてバランスファンド	2,186,256,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,608,319,407円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	339,041,188円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	78,699,745円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	44,967,763円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	13,676,255円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,904,899円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	522,524円
リスクコントロール・オープン	52,766,504円
FWりそな円建債券アクティブファンド	520,309,132円
FWりそな国内債券インデックスファンド	45,122,154,760円
Smart-i 国内債券インデックス	999,052,971円
Smart-i 8資産バランス 安定型	576,971,635円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	343,170,086円
Smart-i 8資産バランス 成長型	123,625,014円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,624,064,867円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,606,166,309円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,520,894,120円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	907,358,174円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,310,078,109円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	386,002,233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)	11,456,412円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	7,334,607,433円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	110,530,907円
2. 計算日における受益権の総数	78,237,277,839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	1.0506円
(10,000口当たり純資産額)	(10,506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

2021年 1月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

2021年 1月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		1,157,094,440

地方債証券		30,449,100
特殊債券		48,861,022
社債券		17,228,000
合計		1,253,632,562

(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409回利付国債(2年)	30,000,000	30,071,700	
	第410回利付国債(2年)	410,000,000	411,074,200	
	第412回利付国債(2年)	330,000,000	330,999,900	
	第413回利付国債(2年)	550,000,000	551,776,500	
	第414回利付国債(2年)	430,000,000	431,474,900	
	第415回利付国債(2年)	240,000,000	240,854,400	
	第416回利付国債(2年)	120,000,000	120,451,200	
	第417回利付国債(2年)	350,000,000	351,414,000	
	第418回利付国債(2年)	440,000,000	441,984,400	
	第131回利付国債(5年)	360,000,000	360,946,800	
	第132回利付国債(5年)	40,000,000	40,131,200	
	第133回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,284,966,400	
	第134回利付国債(5年)	830,000,000	833,710,100	

第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,940,000	
第136回利付国債(5年)	910,000,000	915,141,500	
第137回利付国債(5年)	710,000,000	714,430,400	
第138回利付国債(5年)	700,000,000	704,781,000	
第139回利付国債(5年)	1,020,000,000	1,027,568,400	
第140回利付国債(5年)	670,000,000	675,373,400	
第141回利付国債(5年)	330,000,000	332,841,300	
第142回利付国債(5年)	480,000,000	484,420,800	
第143回利付国債(5年)	560,000,000	565,482,400	
第144回利付国債(5年)	500,000,000	505,195,000	
第145回利付国債(5年)	450,000,000	454,837,500	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	57,819,200	
第2回利付国債(40年)	100,000,000	140,214,000	
第3回利付国債(40年)	110,000,000	155,200,100	
第4回利付国債(40年)	150,000,000	212,896,500	
第5回利付国債(40年)	170,000,000	233,680,300	
第6回利付国債(40年)	170,000,000	230,486,000	
第7回利付国債(40年)	150,000,000	195,888,000	
第8回利付国債(40年)	190,000,000	232,088,800	
第9回利付国債(40年)	300,000,000	274,227,000	
第10回利付国債(40年)	290,000,000	310,764,000	
第11回利付国債(40年)	220,000,000	228,846,200	
第12回利付国債(40年)	250,000,000	234,945,000	
第13回利付国債(40年)	190,000,000	178,322,600	
第321回利付国債(10年)	241,000,000	244,123,360	
第322回利付国債(10年)	220,000,000	222,598,200	
第323回利付国債(10年)	340,000,000	344,899,400	
第324回利付国債(10年)	183,000,000	185,380,830	
第325回利付国債(10年)	330,000,000	335,072,100	
第326回利付国債(10年)	280,000,000	284,421,200	
第327回利付国債(10年)	387,000,000	393,849,900	
第328回利付国債(10年)	411,000,000	417,452,700	
第329回利付国債(10年)	297,000,000	303,640,920	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	263,317,060	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,746,000	
第332回利付国債(10年)	532,000,000	543,299,680	

第333回利付国債(10年)	225,000,000	230,186,250	
第334回利付国債(10年)	261,000,000	267,501,510	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	352,969,500	
第336回利付国債(10年)	210,000,000	215,182,800	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,862,800	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	644,932,480	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	394,109,100	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	957,153,860	
第341回利付国債(10年)	440,000,000	449,213,600	
第342回利付国債(10年)	210,000,000	212,389,800	
第343回利付国債(10年)	560,000,000	566,692,000	
第344回利付国債(10年)	570,000,000	576,965,400	
第345回利付国債(10年)	690,000,000	698,597,400	
第346回利付国債(10年)	820,000,000	830,389,400	
第347回利付国債(10年)	230,000,000	232,960,100	
第348回利付国債(10年)	340,000,000	344,433,600	
第349回利付国債(10年)	480,000,000	486,326,400	
第350回利付国債(10年)	520,000,000	526,723,600	
第351回利付国債(10年)	100,000,000	101,301,000	
第352回利付国債(10年)	680,000,000	688,622,400	
第353回利付国債(10年)	650,000,000	658,248,500	
第354回利付国債(10年)	460,000,000	465,639,600	
第355回利付国債(10年)	440,000,000	445,187,600	
第356回利付国債(10年)	840,000,000	849,466,800	
第357回利付国債(10年)	630,000,000	636,451,200	
第358回利付国債(10年)	600,000,000	605,760,000	
第359回利付国債(10年)	720,000,000	726,422,400	
第360回利付国債(10年)	660,000,000	665,082,000	
第1回利付国債(30年)	60,000,000	74,659,800	
第7回利付国債(30年)	40,000,000	49,899,200	
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,541,000	
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,713,600	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	110,997,900	
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,302,800	
第15回利付国債(30年)	160,000,000	208,969,600	
第16回利付国債(30年)	100,000,000	130,994,000	

第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,962,500	
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,332,200	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	129,207,000	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	132,451,000	
第21回利付国債(30年)	90,000,000	116,836,200	
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,562,000	
第23回利付国債(30年)	160,000,000	213,532,800	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	133,784,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	130,945,000	
第26回利付国債(30年)	145,000,000	192,632,500	
第27回利付国債(30年)	215,000,000	290,465,000	
第28回利付国債(30年)	110,000,000	149,218,300	
第29回利付国債(30年)	70,000,000	94,166,100	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	253,213,000	
第31回利付国債(30年)	130,000,000	171,502,500	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	288,927,750	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	374,868,500	
第34回利付国債(30年)	255,000,000	340,570,350	
第35回利付国債(30年)	316,000,000	411,258,200	
第36回利付国債(30年)	295,000,000	385,143,150	
第37回利付国債(30年)	320,000,000	412,755,200	
第38回利付国債(30年)	160,000,000	203,497,600	
第39回利付国債(30年)	190,000,000	245,803,000	
第40回利付国債(30年)	175,000,000	222,871,250	
第41回利付国債(30年)	155,000,000	194,413,400	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	238,533,600	
第43回利付国債(30年)	80,000,000	100,529,600	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	226,398,600	
第45回利付国債(30年)	190,000,000	230,806,300	
第46回利付国債(30年)	240,000,000	291,705,600	
第47回利付国債(30年)	230,000,000	285,013,700	
第48回利付国債(30年)	233,000,000	278,101,810	
第49回利付国債(30年)	180,000,000	214,918,200	
第50回利付国債(30年)	250,000,000	263,515,000	
第51回利付国債(30年)	210,000,000	196,331,100	
第52回利付国債(30年)	230,000,000	225,639,200	

第53回利付国債(30年)	220,000,000	220,741,400	
第54回利付国債(30年)	230,000,000	241,486,200	
第55回利付国債(30年)	120,000,000	125,899,200	
第56回利付国債(30年)	180,000,000	188,703,000	
第57回利付国債(30年)	230,000,000	240,931,900	
第58回利付国債(30年)	350,000,000	366,338,000	
第59回利付国債(30年)	190,000,000	194,012,800	
第60回利付国債(30年)	190,000,000	203,275,300	
第61回利付国債(30年)	180,000,000	183,205,800	
第62回利付国債(30年)	160,000,000	154,472,000	
第63回利付国債(30年)	210,000,000	196,942,200	
第64回利付国債(30年)	180,000,000	168,519,600	
第65回利付国債(30年)	190,000,000	177,579,700	
第66回利付国債(30年)	200,000,000	186,832,000	
第67回利付国債(30年)	200,000,000	197,288,000	
第68回利付国債(30年)	230,000,000	226,577,600	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	102,448,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,298,100	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	113,125,100	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	103,355,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,393,200	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,873,600	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,215,000	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,788,800	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	62,784,600	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	126,458,400	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	402,385,800	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,282,000	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	96,622,200	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,225,200	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	119,496,300	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	107,950,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	227,169,600	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	195,022,800	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	109,271,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	108,437,000	

第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,770,800	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,476,500	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,879,000	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	98,853,300	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,981,100	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	187,688,500	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,093,900	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	132,535,200	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	167,196,000	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	112,499,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	100,783,800	
第88回利付国債(20年)	185,000,000	209,262,750	
第89回利付国債(20年)	120,000,000	135,086,400	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	192,322,700	
第91回利付国債(20年)	80,000,000	90,959,200	
第92回利付国債(20年)	255,000,000	288,371,850	
第93回利付国債(20年)	80,000,000	90,387,200	
第94回利付国債(20年)	140,000,000	159,044,200	
第95回利付国債(20年)	185,000,000	213,586,200	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	79,914,800	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	149,913,400	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	80,254,300	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	97,887,700	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	175,676,420	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,555,800	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	171,630,700	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	117,622,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,613,500	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,991,760	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	46,946,800	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	93,676,000	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	254,119,800	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	92,758,400	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	229,286,850	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,436,500	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	241,961,500	

第113回利付国債(20年)	85,000,000	100,699,500	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	190,152,000	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	119,736,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	168,243,600	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	268,332,750	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	155,546,780	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	175,290,000	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	229,962,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	242,115,250	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	222,569,800	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	318,980,500	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	238,766,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	146,115,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	119,743,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	154,352,900	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	267,914,250	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	212,472,000	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	213,028,200	
第131回利付国債(20年)	70,000,000	82,103,700	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	199,862,200	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	290,685,150	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,520,300	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,132,000	
第136回利付国債(20年)	170,000,000	198,434,200	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	200,763,200	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,256,900	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	210,544,200	
第140回利付国債(20年)	300,000,000	355,068,000	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	219,417,400	
第142回利付国債(20年)	210,000,000	251,533,800	
第143回利付国債(20年)	245,000,000	288,232,700	
第144回利付国債(20年)	190,000,000	221,253,100	
第145回利付国債(20年)	375,000,000	446,557,500	
第146回利付国債(20年)	370,000,000	441,465,500	
第147回利付国債(20年)	395,000,000	467,178,350	
第148回利付国債(20年)	335,000,000	392,539,600	

	第149回利付国債(20年)	380,000,000	445,907,200	
	第150回利付国債(20年)	340,000,000	394,995,000	
	第151回利付国債(20年)	445,000,000	505,172,900	
	第152回利付国債(20年)	400,000,000	454,396,000	
	第153回利付国債(20年)	270,000,000	310,691,700	
	第154回利付国債(20年)	128,000,000	145,594,880	
	第155回利付国債(20年)	380,000,000	421,237,600	
	第156回利付国債(20年)	370,000,000	377,270,500	
	第157回利付国債(20年)	280,000,000	276,693,200	
	第158回利付国債(20年)	160,000,000	165,152,000	
	第159回利付国債(20年)	290,000,000	303,429,900	
	第160回利付国債(20年)	320,000,000	339,449,600	
	第161回利付国債(20年)	310,000,000	323,773,300	
	第162回利付国債(20年)	220,000,000	229,554,600	
	第163回利付国債(20年)	330,000,000	343,985,400	
	第164回利付国債(20年)	430,000,000	440,431,800	
	第165回利付国債(20年)	330,000,000	337,563,600	
	第166回利付国債(20年)	440,000,000	464,437,600	
	第167回利付国債(20年)	280,000,000	285,630,800	
	第168回利付国債(20年)	260,000,000	260,218,400	
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	274,730,400	
	第170回利付国債(20年)	370,000,000	362,318,800	
	第171回利付国債(20年)	270,000,000	264,095,100	
	第172回利付国債(20年)	280,000,000	278,513,200	
	第173回利付国債(20年)	320,000,000	317,993,600	
	第174回利付国債(20年)	200,000,000	198,372,000	
	国債証券合計	63,185,000,000	67,987,913,900	
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	115,831,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,200,000	
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,987,000	
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,173,000	
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,112,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,959,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,976,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,688,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,128,000	

第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,933,000	
第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,333,100	
第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,313,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,282,000	
平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,764,000	
平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,672,000	
平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,010,000	
平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,431,000	
平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,245,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,055,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,007,000	
平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,531,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,874,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	117,873,000	
第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,617,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,014,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,530,000	
第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,890,000	
平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,148,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,354,000	
第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,070,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,220,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,231,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,838,000	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,279,000	
第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,424,000	
第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,273,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,005,000	
平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,999,000	
平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,259,000	
平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,156,800	
平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,017,000	
平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,793,000	
平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,081,000	
地方債証券合計	4,330,000,000	4,457,575,900	

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	101,837,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,250,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,229,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,159,000	
	第27回道路債券	100,000,000	107,533,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	175,305,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,492,040	
	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	129,518,410	
	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	101,807,000	
	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	102,119,000	
	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	105,564,700	
	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	135,104,060	
	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	100,570,000	
	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	100,888,000	
	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	101,167,000	
	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	100,615,000	
	第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	125,425,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	109,407,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,392,680	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,813,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,214,000	
	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,016,450	
	第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,404,000	
	第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,394,420	
	F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,820,000	
	F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,852,000	
	F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	114,610,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,021,000		

	第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	113,279,000	
	第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	85,539,000	85,249,022	
	第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	91,410,000	91,388,061	
	第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,645,000	
	第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,342,000	
	第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,830,000	
	第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,224,000	86,250,949	
	第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,350,000	86,142,048	
	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,606,000	87,272,000	
	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,048,000	86,834,478	
	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,167,000	89,753,718	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,196,000	91,355,018	
	第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,055,000	94,279,351	
	第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,978,000	96,890,719	
	第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,243,000	99,503,016	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	59,790,000	59,739,178	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	61,950,000	61,938,849	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	66,110,000	66,141,071	
	第327回信金中金債	100,000,000	100,040,000	
	第340回信金中金債	100,000,000	100,162,000	
	第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,908,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,297,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,184,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,922,000	
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,051,000	
	特殊債券合計	5,390,666,000	5,621,925,238	
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	100,352,000	
	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	100,014,000	
	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	98,780,000	
	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	99,704,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,920,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,569,000	

第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,914,000	
第12回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,586,000	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,534,000	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,436,000	
第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,799,000	
第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,873,000	
第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,692,000	
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	99,222,000	
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	99,622,000	
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,938,000	
第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,913,000	
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	100,337,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,210,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,900,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,757,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,103,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,547,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,157,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,264,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,937,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,999,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,107,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,861,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,498,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,150,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,652,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,652,000	
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	100,729,000	

	社債券合計	3,500,000,000	3,517,641,000	
	合計		81,585,056,038	

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

貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月25日現在

資産の部		
流動資産		
預金		182,186,289
コール・ローン		83,985,084
国債証券		31,158,496,428
派生商品評価勘定		47,393
未収利息		176,719,868
前払費用		16,848,545
流動資産合計		31,618,283,607
資産合計		31,618,283,607
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,720
未払解約金		3,780,000
未払利息		227
その他未払費用		2
流動負債合計		3,781,949
負債合計		3,781,949
純資産の部		
元本等		
元本		29,857,342,278
剰余金		
剰余金又は欠損金()		1,757,159,380
元本等合計		31,614,501,658
純資産合計		31,614,501,658
負債純資産合計		31,618,283,607

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月28日
期首元本額	29,562,938,389円
期中追加設定元本額	16,141,842,258円
期中一部解約元本額	15,847,438,369円
期末元本額	29,857,342,278円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	4,117,975,646円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	515,361,422円
りそなラップ型ファンド(成長型)	277,031,677円
DCりそな グローバルバランス	71,180,372円
つみたてバランスファンド	533,914,335円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	870,371,246円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	182,522,064円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	42,250,482円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	24,328,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	7,398,467円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,041,780円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	197,333円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	103,452,491円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	202,656,232円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	140,432,603円

FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	21,008,959,753円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	598,942,272円
Smart-i 8資産バランス 安定型	321,845,291円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	175,561,703円
Smart-i 8資産バランス 成長型	69,903,354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)	793,312円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	591,222,236円
2. 計算日における受益権の総数	29,857,342,278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	1.0589円
(10,000口当たり純資産額)	(10,589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

2021年 1月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用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

2021年 1月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
2.時価の算定方法	ん。
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）

2021年 1月25日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	308,433,747	
合計	308,433,747	

(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）

（2021年 1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	16,238,377	-	16,284,050	45,673
	米ドル	7,246,337	-	7,268,100	21,763

	ユーロ	8,188,420	-	8,214,050	25,630
	オーストラリアドル	803,620	-	801,900	1,720
	合計	16,238,377	-	16,284,050	45,673

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	560,000.00	569,940.28	
		US TREASURY N/B	500,000.00	507,117.35	
		US TREASURY N/B	600,000.00	614,074.92	
		US TREASURY N/B	380,000.00	385,442.13	
		US TREASURY N/B	490,000.00	498,893.40	
		US TREASURY N/B	500,000.00	506,535.65	
		US TREASURY N/B	340,000.00	346,863.00	
		US TREASURY N/B	470,000.00	478,518.75	
		US TREASURY N/B	320,000.00	326,224.99	

US TREASURY N/B	700,000.00	718,101.51	
US TREASURY N/B	410,000.00	417,991.76	
US TREASURY N/B	460,000.00	469,631.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	513,134.75	
US TREASURY N/B	470,000.00	479,803.87	
US TREASURY N/B	700,000.00	715,695.26	
US TREASURY N/B	430,000.00	439,204.66	
US TREASURY N/B	510,000.00	522,152.33	
US TREASURY N/B	550,000.00	562,160.11	
US TREASURY N/B	470,000.00	480,675.95	
US TREASURY N/B	390,000.00	401,242.95	
US TREASURY N/B	410,000.00	419,641.39	
US TREASURY N/B	650,000.00	650,203.12	
US TREASURY N/B	450,000.00	460,872.04	
US TREASURY N/B	360,000.00	370,321.84	
US TREASURY N/B	400,000.00	410,718.72	
US TREASURY N/B	270,000.00	276,391.38	
US TREASURY N/B	390,000.00	400,983.96	
US TREASURY N/B	480,000.00	491,550.00	
US TREASURY N/B	460,000.00	460,107.77	
US TREASURY N/B	560,000.00	572,698.39	
US TREASURY N/B	520,000.00	534,340.61	
US TREASURY N/B	350,000.00	360,356.43	
US TREASURY N/B	600,000.00	600,140.58	
US TREASURY N/B	430,000.00	439,313.84	
US TREASURY N/B	430,000.00	443,319.89	
US TREASURY N/B	410,000.00	423,565.21	
US TREASURY N/B	910,000.00	910,142.14	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,366,055.36	
US TREASURY N/B	670,000.00	693,292.95	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	2,820,550.74	
US TREASURY N/B	460,000.00	473,081.25	
US TREASURY N/B	720,000.00	747,787.46	
US TREASURY N/B	560,000.00	575,181.20	
US TREASURY N/B	400,000.00	413,078.12	

US TREASURY N/B	560,000.00	585,309.36
US TREASURY N/B	650,000.00	674,984.37
US TREASURY N/B	300,000.00	308,578.11
US TREASURY N/B	390,000.00	401,578.12
US TREASURY N/B	410,000.00	431,124.59
US TREASURY N/B	700,000.00	701,859.34
US TREASURY N/B	490,000.00	506,499.18
US TREASURY N/B	420,000.00	444,839.05
US TREASURY N/B	640,000.00	663,749.95
US TREASURY N/B	530,000.00	529,917.16
US TREASURY N/B	320,000.00	331,149.98
US TREASURY N/B	400,000.00	424,484.36
US TREASURY N/B	520,000.00	521,421.83
US TREASURY N/B	470,000.00	484,063.24
US TREASURY N/B	550,000.00	583,161.09
US TREASURY N/B	400,000.00	411,093.71
US TREASURY N/B	320,000.00	340,949.98
US TREASURY N/B	460,000.00	487,707.77
US TREASURY N/B	530,000.00	546,810.90
US TREASURY N/B	130,000.00	138,749.59
US TREASURY N/B	540,000.00	557,718.75
US TREASURY N/B	480,000.00	514,912.46
US TREASURY N/B	400,000.00	399,625.00
US TREASURY N/B	540,000.00	561,937.50
US TREASURY N/B	150,000.00	161,238.27
US TREASURY N/B	710,000.00	761,599.74
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,142,850.00
US TREASURY N/B	440,000.00	464,612.50
US TREASURY N/B	340,000.00	366,177.31
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,497,070.25
US TREASURY N/B	140,000.00	148,553.11
US TREASURY N/B	450,000.00	482,299.78
US TREASURY N/B	420,000.00	446,250.00
US TREASURY N/B	440,000.00	470,731.22
US TREASURY N/B	690,000.00	744,270.08

US TREASURY N/B	490,000.00	519,285.14
US TREASURY N/B	340,000.00	362,910.15
US TREASURY N/B	350,000.00	371,382.79
US TREASURY N/B	320,000.00	338,668.73
US TREASURY N/B	700,000.00	746,415.95
US TREASURY N/B	850,000.00	914,248.01
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,228,942.86
US TREASURY N/B	390,000.00	413,636.10
US TREASURY N/B	420,000.00	441,820.30
US TREASURY N/B	220,000.00	234,562.10
US TREASURY N/B	420,000.00	442,197.63
US TREASURY N/B	790,000.00	849,867.14
US TREASURY N/B	400,000.00	423,273.40
US TREASURY N/B	600,000.00	621,375.00
US TREASURY N/B	220,000.00	234,991.79
US TREASURY N/B	710,000.00	742,144.11
US TREASURY N/B	310,000.00	332,953.29
US TREASURY N/B	530,000.00	554,305.42
US TREASURY N/B	750,000.00	806,044.87
US TREASURY N/B	400,000.00	428,179.68
US TREASURY N/B	450,000.00	470,830.05
US TREASURY N/B	400,000.00	430,609.36
US TREASURY N/B	400,000.00	422,734.36
US TREASURY N/B	430,000.00	467,759.37
US TREASURY N/B	550,000.00	573,396.45
US TREASURY N/B	730,000.00	779,845.27
US TREASURY N/B	340,000.00	373,694.51
US TREASURY N/B	250,000.00	273,842.75
US TREASURY N/B	600,000.00	604,171.86
US TREASURY N/B	250,000.00	276,850.57
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,061,449.12
US TREASURY N/B	570,000.00	613,351.12
US TREASURY N/B	240,000.00	266,170.29
US TREASURY N/B	700,000.00	696,800.72
US TREASURY N/B	290,000.00	320,472.64

US TREASURY N/B	470,000.00	522,654.66
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,137,967.86
US TREASURY N/B	310,000.00	343,361.30
US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,632.80
US TREASURY N/B	230,000.00	257,770.68
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,171,656.92
US TREASURY N/B	570,000.00	639,724.79
US TREASURY N/B	770,000.00	763,984.37
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,413,953.06
US TREASURY N/B	480,000.00	536,512.46
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,047,456.99
US TREASURY N/B	300,000.00	332,074.20
US TREASURY N/B	330,000.00	365,719.89
US TREASURY N/B	670,000.00	709,310.10
US TREASURY N/B	350,000.00	385,998.02
US TREASURY N/B	430,000.00	469,161.90
US TREASURY N/B	450,000.00	494,208.94
US TREASURY N/B	730,000.00	773,172.63
US TREASURY N/B	470,000.00	510,353.87
US TREASURY N/B	450,000.00	482,906.25
US TREASURY N/B	590,000.00	633,351.13
US TREASURY N/B	610,000.00	642,215.62
US TREASURY N/B	320,000.00	334,737.47
US TREASURY N/B	400,000.00	424,000.00
US TREASURY N/B	350,000.00	371,013.65
US TREASURY N/B	850,000.00	919,228.50
US TREASURY N/B	300,000.00	318,023.43
US TREASURY N/B	290,000.00	309,676.93
US TREASURY N/B	840,000.00	922,260.86
US TREASURY N/B	300,000.00	299,789.04
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,119,715.19
US TREASURY N/B	580,000.00	642,078.09
US TREASURY N/B	1,510,000.00	1,494,604.94
US TREASURY N/B	730,000.00	721,844.51
US TREASURY N/B	800,000.00	880,124.96

US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,043,437.50	
US TREASURY N/B	690,000.00	759,619.89	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,170,228.06	
US TREASURY N/B	850,000.00	965,978.50	
US TREASURY N/B	840,000.00	963,801.55	
US TREASURY N/B	120,000.00	161,268.74	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,344,997.25	
US TREASURY N/B	890,000.00	1,041,890.96	
US TREASURY N/B	310,000.00	415,654.29	
US TREASURY N/B	730,000.00	827,979.65	
US TREASURY N/B	680,000.00	758,598.41	
US TREASURY N/B	560,000.00	590,865.57	
US TREASURY N/B	710,000.00	756,427.32	
US TREASURY N/B	560,000.00	583,570.28	
US TREASURY N/B	120,000.00	176,432.80	
US TREASURY N/B	860,000.00	827,615.58	
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,544,593.75	
US TREASURY N/B	1,810,000.00	1,774,224.07	
US TREASURY N/B	200,000.00	282,843.74	
US TREASURY N/B	80,000.00	114,493.74	
US TREASURY N/B	90,000.00	137,288.66	
US TREASURY N/B	30,000.00	43,332.42	
US TREASURY N/B	100,000.00	146,699.21	
US TREASURY N/B	70,000.00	92,178.51	
US TREASURY N/B	140,000.00	201,621.86	
US TREASURY N/B	190,000.00	282,038.66	
US TREASURY N/B	40,000.00	58,650.00	
US TREASURY N/B	190,000.00	286,966.78	
US TREASURY N/B	210,000.00	308,749.20	
US TREASURY N/B	870,000.00	795,302.32	
US TREASURY N/B	150,000.00	208,078.12	
US TREASURY N/B	950,000.00	865,835.89	
US TREASURY N/B	210,000.00	305,410.53	
US TREASURY N/B	820,000.00	780,985.87	
US TREASURY N/B	230,000.00	355,844.13	

US TREASURY N/B	50,000.00	74,160.15
US TREASURY N/B	230,000.00	315,872.63
US TREASURY N/B	130,000.00	164,094.52
US TREASURY N/B	180,000.00	227,692.96
US TREASURY N/B	530,000.00	657,717.54
US TREASURY N/B	300,000.00	358,511.70
US TREASURY N/B	290,000.00	346,232.79
US TREASURY N/B	320,000.00	404,812.48
US TREASURY N/B	360,000.00	438,482.80
US TREASURY N/B	360,000.00	490,373.42
US TREASURY N/B	320,000.00	444,200.00
US TREASURY N/B	410,000.00	559,842.16
US TREASURY N/B	390,000.00	513,916.37
US TREASURY N/B	430,000.00	545,948.81
US TREASURY N/B	380,000.00	473,174.21
US TREASURY N/B	510,000.00	584,308.57
US TREASURY N/B	390,000.00	486,464.04
US TREASURY N/B	410,000.00	501,337.08
US TREASURY N/B	290,000.00	362,601.93
US TREASURY N/B	530,000.00	607,512.50
US TREASURY N/B	460,000.00	527,167.17
US TREASURY N/B	370,000.00	404,875.37
US TREASURY N/B	350,000.00	429,160.13
US TREASURY N/B	440,000.00	552,148.43
US TREASURY N/B	350,000.00	439,591.77
US TREASURY N/B	380,000.00	456,712.50
US TREASURY N/B	420,000.00	505,115.60
US TREASURY N/B	520,000.00	654,387.50
US TREASURY N/B	530,000.00	682,085.14
US TREASURY N/B	630,000.00	794,070.64
US TREASURY N/B	560,000.00	754,381.20
US TREASURY N/B	640,000.00	808,624.96
US TREASURY N/B	590,000.00	729,272.21
US TREASURY N/B	680,000.00	743,643.70
US TREASURY N/B	530,000.00	595,028.50

	US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,243,453.07	
	US TREASURY N/B	780,000.00	672,323.41	
	US TREASURY N/B	1,030,000.00	916,619.44	
	US TREASURY N/B	840,000.00	795,900.00	
	米ドル 小計	120,620,000.00	128,763,727.03 (13,370,825,414)	
カナダドル	GOV OF CANADA	100,000.00	101,465.00	
	GOV OF CANADA	210,000.00	210,972.30	
	GOV OF CANADA	200,000.00	203,570.00	
	GOV OF CANADA	120,000.00	124,299.60	
	GOV OF CANADA	250,000.00	250,520.00	
	GOV OF CANADA	380,000.00	385,361.80	
	GOV OF CANADA	230,000.00	230,485.30	
	GOV OF CANADA	290,000.00	290,600.30	
	GOV OF CANADA	300,000.00	310,047.00	
	GOV OF CANADA	270,000.00	278,391.60	
	GOV OF CANADA	340,000.00	355,888.20	
	GOV OF CANADA	210,000.00	222,988.50	
	GOV OF CANADA	160,000.00	171,849.60	
	GOV OF CANADA	170,000.00	177,247.10	
	GOV OF CANADA	200,000.00	207,138.00	
	GOV OF CANADA	150,000.00	161,901.00	
	GOV OF CANADA	460,000.00	461,159.20	
	GOV OF CANADA	170,000.00	167,919.20	
	GOV OF CANADA	180,000.00	189,423.00	
	GOV OF CANADA	200,000.00	205,694.00	
	GOV OF CANADA	150,000.00	164,908.50	
	GOV OF CANADA	120,000.00	168,704.40	
	GOV OF CANADA	110,000.00	123,669.70	
	GOV OF CANADA	540,000.00	560,476.80	
	GOV OF CANADA	280,000.00	270,023.60	
	GOV OF CANADA	130,000.00	201,017.70	
	GOV OF CANADA	120,000.00	188,536.80	
	GOV OF CANADA	140,000.00	207,765.60	
	GOV OF CANADA	180,000.00	259,443.00	

	GOV OF CANADA	180,000.00	234,327.60
	GOV OF CANADA	410,000.00	465,042.50
	GOV OF CANADA	60,000.00	84,941.40
	カナダドル 小計	7,010,000.00	7,635,778.30 (623,614,013)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	3,680,000.00	3,792,278.64
	UNITED MEXICAN STATE	3,520,000.00	3,699,731.20
	UNITED MEXICAN STATE	3,840,000.00	4,219,545.60
	UNITED MEXICAN STATE	3,800,000.00	4,255,430.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,220,000.00	3,855,145.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,410,000.00	3,573,918.70
	UNITED MEXICAN STATE	4,430,000.00	5,051,794.80
	UNITED MEXICAN STATE	4,040,000.00	4,919,184.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,250,000.00	2,634,772.50
	UNITED MEXICAN STATE	1,210,000.00	1,417,732.80
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	1,221,308.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,040,000.00	3,724,486.40
	UNITED MEXICAN STATE	2,700,000.00	3,060,261.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,440,000.00	2,832,156.80
	メキシコペソ 小計	42,460,000.00	48,257,746.24 (251,422,857)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	90,000.00	94,796.39
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	182,018.52
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	128,986.20
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	121,805.76
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	132,141.10
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	160,049.25
	GOV OF AUSTRIA	110,000.00	112,524.39
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	163,215.15
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	152,517.12
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	154,536.76
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	194,159.52
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	203,026.40
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	188,581.82
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	141,921.00
	GOV OF AUSTRIA	140,000.00	150,908.66

GOV OF AUSTRIA	160,000.00	165,557.92	
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	162,303.84	
GOV OF AUSTRIA	180,000.00	305,596.80	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	99,703.70	
GOV OF AUSTRIA	90,000.00	156,083.35	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	136,024.50	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	58,600.55	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	119,219.00	
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	62,717.00	
GOV OF AUSTRIA	74,000.00	158,608.34	
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	65,260.37	
GOV OF BELGIUM	180,000.00	189,861.42	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	292,479.59	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	171,440.16	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	163,912.05	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	211,489.95	
GOV OF BELGIUM	210,000.00	219,257.99	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	276,797.30	
GOV OF BELGIUM	130,000.00	164,972.17	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	271,981.50	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	184,906.45	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	144,956.70	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	374,192.00	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	296,187.30	
GOV OF BELGIUM	210,000.00	233,382.87	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	177,029.42	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	306,290.16	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	103,740.14	
GOV OF BELGIUM	140,000.00	164,854.54	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	170,531.52	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	449,965.36	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	135,436.40	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	131,529.80	
GOV OF BELGIUM	80,000.00	83,598.40	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	451,360.00	

GOV OF BELGIUM	140,000.00	254,030.98	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	223,235.50	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	135,889.40	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	143,541.18	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	147,301.20	
GOV OF FINLAND	60,000.00	60,501.27	
GOV OF FINLAND	80,000.00	83,079.20	
GOV OF FINLAND	90,000.00	94,472.55	
GOV OF FINLAND	60,000.00	61,136.40	
GOV OF FINLAND	90,000.00	97,941.60	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,281.37	
GOV OF FINLAND	80,000.00	96,942.64	
GOV OF FINLAND	80,000.00	85,828.69	
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,485.59	
GOV OF FINLAND	80,000.00	85,785.20	
GOV OF FINLAND	100,000.00	124,924.80	
GOV OF FINLAND	60,000.00	64,691.88	
GOV OF FINLAND	80,000.00	86,570.64	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,785.70	
GOV OF FINLAND	60,000.00	66,927.42	
GOV OF FINLAND	50,000.00	58,848.25	
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,154.48	
GOV OF FINLAND	50,000.00	52,471.60	
GOV OF FINLAND	70,000.00	110,035.10	
GOV OF FINLAND	50,000.00	67,360.70	
GOV OF FRANCE	430,000.00	432,878.67	
GOV OF FRANCE	580,000.00	606,210.20	
GOV OF FRANCE	500,000.00	504,241.00	
GOV OF FRANCE	480,000.00	504,685.92	
GOV OF FRANCE	300,000.00	304,170.90	
GOV OF FRANCE	660,000.00	669,672.16	
GOV OF FRANCE	780,000.00	824,366.40	
GOV OF FRANCE	560,000.00	636,809.60	
GOV OF FRANCE	660,000.00	673,914.78	
GOV OF FRANCE	440,000.00	483,197.00	

GOV OF FRANCE	520,000.00	568,456.20	
GOV OF FRANCE	790,000.00	810,934.65	
GOV OF FRANCE	620,000.00	650,909.48	
GOV OF FRANCE	340,000.00	449,156.32	
GOV OF FRANCE	490,000.00	528,808.00	
GOV OF FRANCE	430,000.00	442,950.31	
GOV OF FRANCE	520,000.00	633,819.16	
GOV OF FRANCE	690,000.00	730,687.92	
GOV OF FRANCE	550,000.00	576,430.25	
GOV OF FRANCE	620,000.00	681,194.00	
GOV OF FRANCE	680,000.00	832,830.00	
GOV OF FRANCE	580,000.00	632,596.72	
GOV OF FRANCE	630,000.00	689,368.68	
GOV OF FRANCE	620,000.00	929,181.60	
GOV OF FRANCE	360,000.00	387,376.56	
GOV OF FRANCE	610,000.00	629,306.50	
GOV OF FRANCE	710,000.00	901,371.27	
GOV OF FRANCE	400,000.00	411,230.40	
GOV OF FRANCE	770,000.00	912,572.43	
GOV OF FRANCE	440,000.00	753,819.88	
GOV OF FRANCE	560,000.00	661,510.08	
GOV OF FRANCE	410,000.00	696,954.90	
GOV OF FRANCE	570,000.00	680,350.86	
GOV OF FRANCE	360,000.00	613,412.28	
GOV OF FRANCE	430,000.00	562,101.16	
GOV OF FRANCE	100,000.00	106,573.90	
GOV OF FRANCE	520,000.00	975,728.00	
GOV OF FRANCE	380,000.00	648,127.24	
GOV OF FRANCE	430,000.00	616,564.10	
GOV OF FRANCE	450,000.00	589,350.60	
GOV OF FRANCE	340,000.00	371,424.84	
GOV OF FRANCE	220,000.00	469,362.52	
GOV OF FRANCE	240,000.00	541,068.00	
GOV OF FRANCE	170,000.00	252,866.50	
GOV OF GERMANY	180,000.00	184,580.46	

GOV OF GERMANY	230,000.00	231,735.35	
GOV OF GERMANY	330,000.00	332,745.27	
GOV OF GERMANY	210,000.00	211,985.13	
GOV OF GERMANY	360,000.00	372,771.36	
GOV OF GERMANY	260,000.00	269,358.05	
GOV OF GERMANY	240,000.00	242,758.80	
GOV OF GERMANY	290,000.00	293,496.82	
GOV OF GERMANY	220,000.00	222,985.62	
GOV OF GERMANY	270,000.00	282,597.41	
GOV OF GERMANY	260,000.00	264,354.34	
GOV OF GERMANY	370,000.00	389,369.50	
GOV OF GERMANY	340,000.00	364,187.53	
GOV OF GERMANY	270,000.00	275,628.42	
GOV OF GERMANY	320,000.00	344,911.23	
GOV OF GERMANY	360,000.00	368,780.40	
GOV OF GERMANY	360,000.00	387,261.82	
GOV OF GERMANY	400,000.00	425,402.80	
GOV OF GERMANY	360,000.00	370,189.80	
GOV OF GERMANY	380,000.00	399,702.49	
GOV OF GERMANY	300,000.00	309,574.67	
GOV OF GERMANY	380,000.00	410,783.68	
GOV OF GERMANY	480,000.00	496,956.00	
GOV OF GERMANY	410,000.00	436,187.52	
GOV OF GERMANY	450,000.00	468,556.65	
GOV OF GERMANY	460,000.00	487,531.92	
GOV OF GERMANY	140,000.00	206,994.55	
GOV OF GERMANY	500,000.00	540,278.50	
GOV OF GERMANY	340,000.00	356,022.16	
GOV OF GERMANY	170,000.00	246,899.50	
GOV OF GERMANY	390,000.00	423,286.89	
GOV OF GERMANY	190,000.00	269,134.43	
GOV OF GERMANY	450,000.00	481,624.20	
GOV OF GERMANY	450,000.00	482,805.45	
GOV OF GERMANY	350,000.00	368,451.65	
GOV OF GERMANY	210,000.00	343,430.01	

GOV OF GERMANY	310,000.00	326,528.58	
GOV OF GERMANY	420,000.00	442,464.54	
GOV OF GERMANY	90,000.00	95,158.17	
GOV OF GERMANY	300,000.00	486,726.90	
GOV OF GERMANY	350,000.00	603,038.10	
GOV OF GERMANY	320,000.00	336,305.60	
GOV OF GERMANY	410,000.00	704,617.39	
GOV OF GERMANY	260,000.00	486,379.66	
GOV OF GERMANY	300,000.00	604,598.70	
GOV OF GERMANY	250,000.00	444,501.00	
GOV OF GERMANY	420,000.00	695,655.66	
GOV OF GERMANY	440,000.00	748,496.66	
GOV OF GERMANY	390,000.00	541,051.90	
GOV OF GERMANY	230,000.00	236,887.58	
GOV OF IRELAND	90,000.00	91,530.36	
GOV OF IRELAND	120,000.00	121,382.88	
GOV OF IRELAND	90,000.00	98,919.53	
GOV OF IRELAND	110,000.00	124,098.40	
GOV OF IRELAND	140,000.00	175,231.00	
GOV OF IRELAND	160,000.00	173,451.36	
GOV OF IRELAND	110,000.00	114,920.74	
GOV OF IRELAND	100,000.00	109,927.00	
GOV OF IRELAND	120,000.00	134,865.10	
GOV OF IRELAND	120,000.00	150,832.20	
GOV OF IRELAND	150,000.00	156,991.50	
GOV OF IRELAND	70,000.00	81,637.01	
GOV OF IRELAND	60,000.00	70,732.44	
GOV OF IRELAND	90,000.00	95,706.00	
GOV OF IRELAND	80,000.00	101,816.88	
GOV OF IRELAND	120,000.00	170,144.64	
GOV OF IRELAND	80,000.00	105,391.04	
GOV OF ITALY	260,000.00	275,210.00	
GOV OF ITALY	210,000.00	213,749.94	
GOV OF ITALY	250,000.00	255,034.60	
GOV OF ITALY	210,000.00	213,988.00	

GOV OF ITALY	270,000.00	274,815.18	
GOV OF ITALY	230,000.00	251,121.93	
GOV OF ITALY	380,000.00	390,698.52	
GOV OF ITALY	340,000.00	374,405.96	
GOV OF ITALY	180,000.00	180,989.64	
GOV OF ITALY	240,000.00	245,889.60	
GOV OF ITALY	200,000.00	205,007.10	
GOV OF ITALY	250,000.00	276,745.25	
GOV OF ITALY	180,000.00	183,493.80	
GOV OF ITALY	340,000.00	382,619.00	
GOV OF ITALY	100,000.00	101,205.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	363,869.70	
GOV OF ITALY	400,000.00	408,938.00	
GOV OF ITALY	460,000.00	461,504.20	
GOV OF ITALY	200,000.00	228,482.43	
GOV OF ITALY	230,000.00	244,594.74	
GOV OF ITALY	350,000.00	371,735.00	
GOV OF ITALY	270,000.00	306,598.50	
GOV OF ITALY	200,000.00	211,194.00	
GOV OF ITALY	250,000.00	273,993.75	
GOV OF ITALY	300,000.00	304,138.80	
GOV OF ITALY	290,000.00	349,171.89	
GOV OF ITALY	200,000.00	211,915.22	
GOV OF ITALY	270,000.00	286,850.70	
GOV OF ITALY	240,000.00	258,840.00	
GOV OF ITALY	220,000.00	245,117.62	
GOV OF ITALY	330,000.00	359,985.74	
GOV OF ITALY	190,000.00	193,231.52	
GOV OF ITALY	270,000.00	329,393.30	
GOV OF ITALY	240,000.00	258,079.44	
GOV OF ITALY	300,000.00	330,872.70	
GOV OF ITALY	620,000.00	656,015.80	
GOV OF ITALY	390,000.00	403,045.50	
GOV OF ITALY	210,000.00	234,748.50	
GOV OF ITALY	240,000.00	266,339.28	

GOV OF ITALY	230,000.00	238,656.51	
GOV OF ITALY	350,000.00	492,434.25	
GOV OF ITALY	300,000.00	332,927.40	
GOV OF ITALY	300,000.00	395,124.00	
GOV OF ITALY	280,000.00	329,473.20	
GOV OF ITALY	430,000.00	516,769.70	
GOV OF ITALY	360,000.00	503,334.00	
GOV OF ITALY	320,000.00	401,328.96	
GOV OF ITALY	280,000.00	297,972.08	
GOV OF ITALY	260,000.00	266,870.50	
GOV OF ITALY	330,000.00	359,617.83	
GOV OF ITALY	260,000.00	264,115.54	
GOV OF ITALY	320,000.00	485,937.28	
GOV OF ITALY	330,000.00	359,238.66	
GOV OF ITALY	320,000.00	497,328.00	
GOV OF ITALY	280,000.00	330,184.40	
GOV OF ITALY	310,000.00	467,151.40	
GOV OF ITALY	330,000.00	429,741.18	
GOV OF ITALY	230,000.00	241,424.10	
GOV OF ITALY	230,000.00	267,504.72	
GOV OF ITALY	390,000.00	551,332.08	
GOV OF ITALY	290,000.00	368,925.53	
GOV OF ITALY	270,000.00	437,089.50	
GOV OF ITALY	200,000.00	260,097.80	
GOV OF ITALY	280,000.00	457,102.52	
GOV OF ITALY	150,000.00	161,195.25	
GOV OF ITALY	230,000.00	381,410.84	
GOV OF ITALY	280,000.00	383,664.12	
GOV OF ITALY	240,000.00	300,900.00	
GOV OF ITALY	220,000.00	313,239.96	
GOV OF ITALY	220,000.00	335,564.68	
GOV OF ITALY	200,000.00	240,328.00	
GOV OF ITALY	110,000.00	112,354.77	
GOV OF ITALY	120,000.00	153,955.44	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	211,405.11	

GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	229,627.81	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	163,333.20	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	307,977.10	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	255,443.25	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	208,186.49	
GOV OF NETHERLANDS	240,000.00	250,319.47	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	223,547.73	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	217,854.00	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	239,816.06	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	215,121.60	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	275,200.00	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	181,191.78	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	198,203.82	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	284,122.44	
GOV OF NETHERLANDS	220,000.00	373,985.48	
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	158,635.12	
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	423,811.01	
GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	404,509.74	
GOV OF NETHERLANDS	80,000.00	80,769.68	
GOV OF SPAIN	280,000.00	298,127.22	
GOV OF SPAIN	430,000.00	435,002.62	
GOV OF SPAIN	270,000.00	274,727.70	
GOV OF SPAIN	280,000.00	313,579.16	
GOV OF SPAIN	340,000.00	343,873.96	
GOV OF SPAIN	260,000.00	265,525.00	
GOV OF SPAIN	260,000.00	295,551.62	
GOV OF SPAIN	250,000.00	290,156.25	
GOV OF SPAIN	250,000.00	285,071.75	
GOV OF SPAIN	280,000.00	286,877.64	
GOV OF SPAIN	330,000.00	369,870.98	
GOV OF SPAIN	430,000.00	436,903.65	
GOV OF SPAIN	370,000.00	401,812.23	
GOV OF SPAIN	250,000.00	307,262.50	
GOV OF SPAIN	300,000.00	336,262.50	
GOV OF SPAIN	50,000.00	50,811.64	

	GOV OF SPAIN	290,000.00	325,004.45	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	376,427.52	
	GOV OF SPAIN	450,000.00	491,426.10	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	277,377.50	
	GOV OF SPAIN	240,000.00	255,405.75	
	GOV OF SPAIN	350,000.00	388,368.75	
	GOV OF SPAIN	260,000.00	288,765.53	
	GOV OF SPAIN	540,000.00	600,977.60	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	281,325.04	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	505,303.20	
	GOV OF SPAIN	340,000.00	381,490.15	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	294,247.85	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	291,209.24	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	341,332.90	
	GOV OF SPAIN	400,000.00	443,848.00	
	GOV OF SPAIN	310,000.00	504,768.04	
	GOV OF SPAIN	310,000.00	387,309.04	
	GOV OF SPAIN	250,000.00	299,473.75	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	440,812.40	
	GOV OF SPAIN	290,000.00	517,980.19	
	GOV OF SPAIN	200,000.00	218,572.00	
	GOV OF SPAIN	280,000.00	495,453.33	
	GOV OF SPAIN	220,000.00	429,052.80	
	GOV OF SPAIN	230,000.00	339,692.75	
	GOV OF SPAIN	220,000.00	318,164.66	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	182,860.74	
	GOV OF SPAIN	210,000.00	373,832.97	
	ユーロ 小計	85,784,000.00	102,837,974.39 (12,995,634,823)	
英bond	UK TREASURY	160,000.00	167,365.82	
	UK TREASURY	470,000.00	474,404.65	
	UK TREASURY	320,000.00	329,745.79	
	UK TREASURY	440,000.00	441,762.64	
	UK TREASURY	280,000.00	285,909.34	
	UK TREASURY	230,000.00	244,055.85	

UK TREASURY	100,000.00	100,471.46
UK TREASURY	310,000.00	320,863.88
UK TREASURY	150,000.00	165,293.56
UK TREASURY	250,000.00	302,116.40
UK TREASURY	310,000.00	318,915.97
UK TREASURY	190,000.00	207,836.06
UK TREASURY	410,000.00	412,029.96
UK TREASURY	170,000.00	183,852.07
UK TREASURY	280,000.00	300,938.40
UK TREASURY	180,000.00	231,186.56
UK TREASURY	300,000.00	299,400.00
UK TREASURY	210,000.00	233,642.55
UK TREASURY	140,000.00	203,388.24
UK TREASURY	180,000.00	189,648.00
UK TREASURY	460,000.00	462,140.46
UK TREASURY	190,000.00	271,911.81
UK TREASURY	140,000.00	137,942.00
UK TREASURY	210,000.00	299,266.96
UK TREASURY	200,000.00	304,040.72
UK TREASURY	200,000.00	199,260.00
UK TREASURY	310,000.00	471,957.64
UK TREASURY	360,000.00	418,403.37
UK TREASURY	190,000.00	319,246.13
UK TREASURY	210,000.00	337,991.86
UK TREASURY	190,000.00	311,141.56
UK TREASURY	300,000.00	323,997.34
UK TREASURY	290,000.00	503,341.40
UK TREASURY	280,000.00	419,730.69
UK TREASURY	280,000.00	439,640.20
UK TREASURY	220,000.00	391,804.95
UK TREASURY	320,000.00	366,771.32
UK TREASURY	140,000.00	170,176.10
UK TREASURY	160,000.00	297,625.87
UK TREASURY	340,000.00	316,154.83
UK TREASURY	190,000.00	340,690.29

	UK TREASURY	180,000.00	219,396.45
	UK TREASURY	230,000.00	465,167.91
	UK TREASURY	260,000.00	334,236.50
	UK TREASURY	190,000.00	391,010.27
	UK TREASURY	150,000.00	133,729.20
	UK TREASURY	200,000.00	325,957.84
	UK TREASURY	230,000.00	475,213.67
	UK TREASURY	90,000.00	124,145.33
	英ボンド 小計	11,790,000.00	14,984,919.87 (2,129,506,962)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,480,000.00	1,557,401.04
	GOV OF SWEDEN	1,220,000.00	1,284,018.28
	GOV OF SWEDEN	1,000,000.00	1,121,554.00
	GOV OF SWEDEN	880,000.00	941,436.76
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	701,019.00
	GOV OF SWEDEN	910,000.00	971,302.15
	GOV OF SWEDEN	400,000.00	401,413.63
	GOV OF SWEDEN	600,000.00	931,971.65
	スウェーデンクローナ 小計	7,150,000.00	7,910,116.51 (98,955,557)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,150,000.00	1,192,943.30
	GOV OF NORWAY	710,000.00	765,401.30
	GOV OF NORWAY	610,000.00	637,995.95
	GOV OF NORWAY	660,000.00	686,202.00
	GOV OF NORWAY	490,000.00	517,457.59
	GOV OF NORWAY	500,000.00	538,850.00
	GOV OF NORWAY	480,000.00	510,600.00
	GOV OF NORWAY	700,000.00	722,172.50
	ノルウェークローネ 小計	5,300,000.00	5,571,622.64 (68,085,228)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	970,000.00	985,197.47
	GOV OF DENMARK	780,000.00	827,164.26
	GOV OF DENMARK	820,000.00	913,384.88
	GOV OF DENMARK	970,000.00	1,038,113.40
	GOV OF DENMARK	1,550,000.00	1,678,417.50
	GOV OF DENMARK	1,640,000.00	3,100,769.97

	GOV OF DENMARK	390,000.00	418,341.30	
	デンマーククローネ 小計	7,120,000.00	8,961,388.78 (152,253,995)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	500,000.00	514,728.89	
	GOV OF POLAND	330,000.00	330,104.90	
	GOV OF POLAND	500,000.00	548,030.00	
	GOV OF POLAND	560,000.00	587,653.57	
	GOV OF POLAND	330,000.00	365,869.02	
	GOV OF POLAND	420,000.00	452,301.81	
	GOV OF POLAND	410,000.00	441,240.06	
	GOV OF POLAND	390,000.00	396,040.47	
	GOV OF POLAND	360,000.00	405,709.45	
	GOV OF POLAND	760,000.00	840,857.61	
	GOV OF POLAND	390,000.00	434,170.26	
	GOV OF POLAND	530,000.00	599,695.00	
	GOV OF POLAND	80,000.00	111,084.00	
	GOV OF POLAND	740,000.00	844,932.00	
	GOV OF POLAND	150,000.00	150,604.76	
	ポーランドズロチ 小計	6,450,000.00	7,023,021.80 (195,520,926)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	346,812.83	
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	395,061.52	
	GOV OF AUSTRALIA	520,000.00	582,553.65	
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	434,019.55	
	GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	510,982.10	
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	450,206.32	
	GOV OF AUSTRALIA	430,000.00	427,566.20	
	GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	575,202.48	
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	359,839.54	
	GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	602,731.53	
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	432,538.64	
	GOV OF AUSTRALIA	440,000.00	486,841.42	
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	515,904.03	
	GOV OF AUSTRALIA	500,000.00	594,349.95	
	GOV OF AUSTRALIA	450,000.00	518,383.35	

	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	532,118.30
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	466,250.34
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	373,186.39
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	373,324.50
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	391,531.95
	GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	287,522.86
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	81,726.79
	GOV OF AUSTRALIA	160,000.00	208,534.68
	GOV OF AUSTRALIA	190,000.00	233,525.40
	GOV OF AUSTRALIA	160,000.00	182,684.42
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	202,192.42
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	200,201.65
	オーストラリアドル 小計	9,750,000.00	10,765,792.81 (863,416,583)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	30,518.28
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	146,335.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	102,937.67
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	116,507.54
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	52,498.93
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	120,262.46
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	75,848.60
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	50,029.25
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	64,941.61
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	140,046.06
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	78,877.07
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	104,090.63
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	105,269.85
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	112,741.52
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	90,620.00
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	46,546.80
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	86,952.57
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	126,384.22
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	55,565.00
	シンガポールドル 小計	1,520,000.00	1,706,973.06 (133,570,641)
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	143,222.85

	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	143,391.89	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	268,388.92	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	268,718.45	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	145,530.84	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	125,479.47	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	83,846.67	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	214,480.40	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,186.24	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,176.10	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	205,661.71	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	210,317.09	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	140,950.56	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	130,919.60	
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	372,137.81	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	250,913.64	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	86,698.59	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	206,941.35	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	284,988.52	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	168,519.57	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	235,615.92	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	139,785.11	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	46,141.75	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	231,670.84	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	76,823.01	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	206,455.60	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	138,550.87	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	143,824.94	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	163,063.09	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	202,304.46	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	171,279.28	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,534.99	
	マレーシアリングット 小計	5,160,000.00	5,563,520.13 (142,759,926)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	220,000.00	232,133.00	
	GOV OF ISRAEL	380,000.00	385,415.00	

	GOV OF ISRAEL	190,000.00	194,531.50	
	GOV OF ISRAEL	150,000.00	150,277.50	
	GOV OF ISRAEL	450,000.00	468,472.50	
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	431,999.50	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	300,342.00	
	GOV OF ISRAEL	210,000.00	283,164.00	
	GOV OF ISRAEL	240,000.00	266,556.00	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	316,064.00	
	GOV OF ISRAEL	160,000.00	163,416.00	
	GOV OF ISRAEL	210,000.00	211,753.50	
	GOV OF ISRAEL	250,000.00	421,712.50	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	363,558.00	
	イスラエルシェケル 小計	3,710,000.00	4,189,395.00	(132,929,503)
合計			31,158,496,428	(31,158,496,428)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券 223銘柄	100.0%	43.0%
カナダドル	国債証券 32銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 322銘柄	100.0%	41.7%
英ポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	6.8%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.8%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2021年 1月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	18,344,285
コール・ローン	22,371,730
投資信託受益証券	4,995,390,884
未収配当金	70,518,379
流動資産合計	5,106,625,278
資産合計	5,106,625,278
負債の部	
流動負債	
未払金	17,081,475
未払解約金	1,986,000
未払利息	60
流動負債合計	19,067,535
負債合計	19,067,535
純資産の部	
元本等	
元本	4,721,029,528
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	366,528,215
元本等合計	5,087,557,743
純資産合計	5,087,557,743
負債純資産合計	5,106,625,278

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)

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月28日
期首元本額	5,408,384,361円
期中追加設定元本額	4,205,922,121円
期中一部解約元本額	4,893,276,954円
期末元本額	4,721,029,528円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	772,759,480円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	504,162,479円
りそなラップ型ファンド(成長型)	270,988,402円
DCりそな グローバルバランス	13,377,485円
つみたてバランスファンド	522,388,167円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	220,542,906円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	112,236,934円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	68,246,174円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	9,774,670円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	7,092,820円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,437,276円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,982,575円
リスクコントロール・オープン	2,444,188円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	66,015,174円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	2,180,500円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	925,299,667円
Smart-i 8資産バランス 安定型	38,589,960円

Smart-i 8資産バランス 安定成長型	85,223,520円
Smart-i 8資産バランス 成長型	85,679,303円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	253,878,992円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	253,345,286円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	147,845,826円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	88,202,265円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	224,163,228円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	37,396,892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)	775,359円
2. 計算日における受益権の総数	4,721,029,528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	1.0776円
(10,000口当たり純資産額)	(10,776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

2021年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用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

2021年 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 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)

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
投資信託受益証券		23,775,731
合計		23,775,731

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	577,887	33,633,023.40	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	441,672	14,473,591.44	
		米ドル 小計	1,019,559	48,106,614.84 (4,995,390,884)	
	合計			4,995,390,884 (4,995,390,884)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RAM国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	633,016,715
株式	39,757,682,500
派生商品評価勘定	28,101,850
未収入金	760,414,472
未収配当金	56,645,029
差入委託証拠金	30,195,000
流動資産合計	41,266,055,566
資産合計	41,266,055,566
負債の部	
流動負債	
前受金	27,295,000
未払金	249,051,222
未払解約金	949,000
未払利息	1,716
その他未払費用	16
流動負債合計	277,296,954
負債合計	277,296,954
純資産の部	
元本等	
元本	30,730,895,014
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,257,863,598
元本等合計	40,988,758,612
純資産合計	40,988,758,612
負債純資産合計	41,266,055,566

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）

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	

期首	2020年 1月28日
期首元本額	34,456,230,681円
期中追加設定元本額	39,020,479,973円
期中一部解約元本額	42,745,815,640円
期末元本額	30,730,895,014円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,001,004,694円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	621,505,044円
りそなラップ型ファンド(成長型)	838,236,767円
DCりそな グローバルバランス	16,940,770円
つみたてバランスファンド	2,604,209,212円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	862,200,668円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	446,775,004円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	266,725,304円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	38,817,727円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	27,999,795円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	13,481,835円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	19,219,906円
リスクコントロール・オープン	8,035,074円
FWりそな国内株式アクティブファンド	218,916,330円
FWりそな国内株式インデックスファンド	17,450,920,640円
Smart-i TOPIXインデックス	1,179,719,445円
Smart-i 8資産バランス 安定型	128,308,620円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	332,616,766円
Smart-i 8資産バランス 成長型	364,685,851円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	413,882,777円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	411,211,621円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	239,972,979円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	143,160,195円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	364,616,923円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	60,926,609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)	1,039,962円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	531,427,671円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	641,336,981円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,419,395,682円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	63,604,162円
2. 計算日における受益権の総数	30,730,895,014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	1.3338円
(10,000口当たり純資産額)	(13,338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

2021年 1月25日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

2021年 1月25日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		4,009,428,675
合計		4,009,428,675

(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)

(2021年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	585,038,150	-	613,140,000	28,101,850
合計		585,038,150	-	613,140,000	28,101,850

(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	700	3,100.00	2,170,000	

日本水産	20,900	434.00	9,070,600	
マルハニチロ	3,000	2,350.00	7,050,000	
雪国まいたけ	1,300	1,815.00	2,359,500	
カネコ種苗	600	1,553.00	931,800	
サカタのタネ	2,500	3,630.00	9,075,000	
ホクト	1,600	2,176.00	3,481,600	
ホクリヨウ	300	705.00	211,500	
住石ホールディングス	4,300	115.00	494,500	
日鉄鉱業	500	5,760.00	2,880,000	
三井松島ホールディングス	800	796.00	636,800	
国際石油開発帝石	77,000	618.00	47,586,000	
石油資源開発	2,700	2,062.00	5,567,400	
K & O エナジーグループ	1,000	1,435.00	1,435,000	
ヒノキヤグループ	500	2,055.00	1,027,500	
ショーボンドホールディングス	3,300	4,625.00	15,262,500	
ミライト・ホールディングス	6,200	1,704.00	10,564,800	
タマホーム	1,100	1,912.00	2,103,200	
サンヨーホームズ	200	864.00	172,800	
日本アクア	800	621.00	496,800	
ファーストコーポレーション	600	704.00	422,400	
ベステラ	400	1,771.00	708,400	
T A T E R U	4,000	178.00	712,000	
キャンディル	400	548.00	219,200	
スペースバリューホールディングス	2,600	697.00	1,812,200	
ダイセキ環境ソリューション	400	792.00	316,800	
第一カッター興業	500	1,406.00	703,000	
安藤・間	12,500	735.00	9,187,500	
東急建設	6,100	515.00	3,141,500	
コムシスホールディングス	7,400	3,115.00	23,051,000	
ピーアールホールディングス	2,300	663.00	1,524,900	
高松コンストラクショングループ	1,300	2,072.00	2,693,600	
東建コーポレーション	600	7,930.00	4,758,000	
ソネック	200	866.00	173,200	
ヤマウラ	900	928.00	835,200	
大成建設	16,100	3,500.00	56,350,000	
大林組	48,300	921.00	44,484,300	

清水建設	49,000	774.00	37,926,000
飛島建設	1,400	1,069.00	1,496,600
長谷工コーポレーション	18,700	1,249.00	23,356,300
松井建設	1,900	711.00	1,350,900
銭高組	200	4,115.00	823,000
鹿島建設	37,900	1,424.00	53,969,600
不動テトラ	1,300	1,702.00	2,212,600
大末建設	600	823.00	493,800
鉄建建設	1,000	1,879.00	1,879,000
西松建設	3,700	2,403.00	8,891,100
三井住友建設	11,700	445.00	5,206,500
大豊建設	1,100	3,695.00	4,064,500
前田建設工業	12,100	883.00	10,684,300
佐田建設	1,000	440.00	440,000
ナカノフドー建設	1,300	393.00	510,900
奥村組	2,300	2,661.00	6,120,300
東鉄工業	2,100	2,741.00	5,756,100
イチケン	300	1,899.00	569,700
富士ピー・エス	700	587.00	410,900
浅沼組	500	4,210.00	2,105,000
戸田建設	20,100	737.00	14,813,700
熊谷組	2,200	2,647.00	5,823,400
北野建設	300	2,462.00	738,600
植木組	200	2,711.00	542,200
矢作建設工業	2,100	857.00	1,799,700
ピーエス三菱	1,600	625.00	1,000,000
日本ハウスホールディングス	3,300	333.00	1,098,900
大東建託	5,300	9,660.00	51,198,000
新日本建設	2,100	849.00	1,782,900
N I P P O	4,000	2,694.00	10,776,000
東亜道路工業	300	3,820.00	1,146,000
前田道路	4,300	1,754.00	7,542,200
日本道路	500	7,530.00	3,765,000
東亜建設工業	1,500	2,092.00	3,138,000
日本国土開発	4,700	555.00	2,608,500
若築建設	900	1,245.00	1,120,500

東洋建設	5,400	495.00	2,673,000	
五洋建設	19,200	906.00	17,395,200	
世紀東急工業	2,300	819.00	1,883,700	
福田組	600	5,050.00	3,030,000	
住友林業	12,200	2,068.00	25,229,600	
日本基礎技術	1,600	465.00	744,000	
巴コーポレーション	2,100	396.00	831,600	
大和ハウス工業	47,800	3,037.00	145,168,600	
ライト工業	2,800	1,721.00	4,818,800	
積水ハウス	52,400	2,130.50	111,638,200	
日特建設	1,300	778.00	1,011,400	
北陸電気工事	800	1,228.00	982,400	
ユアテック	2,800	899.00	2,517,200	
日本リーテック	1,000	2,419.00	2,419,000	
四電工	300	2,629.00	788,700	
中電工	1,900	2,162.00	4,107,800	
関電工	6,900	905.00	6,244,500	
きんでん	11,500	1,723.00	19,814,500	
東京エネシス	1,600	1,005.00	1,608,000	
トーエネック	500	3,690.00	1,845,000	
住友電設	1,400	2,667.00	3,733,800	
日本電設工業	2,600	2,030.00	5,278,000	
協和エクシオ	7,300	2,772.00	20,235,600	
新日本空調	1,300	2,166.00	2,815,800	
九電工	3,400	3,215.00	10,931,000	
三機工業	3,400	1,247.00	4,239,800	
日揮ホールディングス	14,900	1,184.00	17,641,600	
中外炉工業	500	1,633.00	816,500	
ヤマト	1,500	707.00	1,060,500	
太平電業	1,200	2,569.00	3,082,800	
高砂熱学工業	3,700	1,599.00	5,916,300	
三晃金属工業	200	2,898.00	579,600	
朝日工業社	300	3,055.00	916,500	
明星工業	3,100	802.00	2,486,200	
大気社	2,400	2,804.00	6,729,600	
ダイダン	1,200	2,911.00	3,493,200	

日比谷総合設備	1,600	1,868.00	2,988,800
フィル・カンパニー	300	1,870.00	561,000
OSJBホールディングス	7,600	275.00	2,090,000
東洋エンジニアリング	2,000	454.00	908,000
レイズネクスト	2,600	1,202.00	3,125,200
ニッポン	4,500	1,619.00	7,285,500
日清製粉グループ本社	17,500	1,676.00	29,330,000
日東富士製粉	100	6,790.00	679,000
昭和産業	1,400	3,035.00	4,249,000
鳥越製粉	1,400	872.00	1,220,800
中部飼料	1,900	1,443.00	2,741,700
フィード・ワン	2,100	860.00	1,806,000
東洋精糖	300	1,209.00	362,700
日本甜菜製糖	800	1,602.00	1,281,600
三井製糖	1,400	1,869.00	2,616,600
塩水港精糖	1,700	224.00	380,800
日新製糖	700	1,841.00	1,288,700
森永製菓	3,600	3,935.00	14,166,000
中村屋	400	3,850.00	1,540,000
江崎グリコ	4,300	4,580.00	19,694,000
名糖産業	700	1,408.00	985,600
井村屋グループ	900	2,581.00	2,322,900
不二家	1,000	2,243.00	2,243,000
山崎製パン	11,600	1,784.00	20,694,400
第一屋製パン	300	971.00	291,300
モロゾフ	300	5,780.00	1,734,000
亀田製菓	900	4,865.00	4,378,500
寿スピリッツ	1,500	5,500.00	8,250,000
カルビー	7,000	3,150.00	22,050,000
森永乳業	2,900	5,140.00	14,906,000
六甲バター	1,000	1,770.00	1,770,000
ヤクルト本社	10,600	5,560.00	58,936,000
明治ホールディングス	10,200	7,160.00	73,032,000
雪印メグミルク	3,700	2,289.00	8,469,300
プリマハム	2,400	3,170.00	7,608,000
日本ハム	5,900	4,410.00	26,019,000

林兼産業	500	601.00	300,500	
丸大食品	1,600	1,708.00	2,732,800	
S Foods	1,200	3,455.00	4,146,000	
柿安本店	500	2,657.00	1,328,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	10,000	700.00	7,000,000	
サッポロホールディングス	5,300	2,000.00	10,600,000	
アサヒグループホールディングス	33,800	4,294.00	145,137,200	
キリンホールディングス	65,600	2,297.50	150,716,000	
宝ホールディングス	11,500	1,252.00	14,398,000	
オエノンホールディングス	4,400	384.00	1,689,600	
養命酒製造	500	1,857.00	928,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	11,800	1,575.00	18,585,000	
サントリー食品インターナショナル	10,300	3,655.00	37,646,500	
ダイドーグループホールディングス	800	5,130.00	4,104,000	
伊藤園	4,700	6,490.00	30,503,000	
キーコーヒー	1,500	2,148.00	3,222,000	
ユニカフェ	500	992.00	496,000	
ジャパンフーズ	200	1,220.00	244,000	
日清オイリオグループ	2,000	3,030.00	6,060,000	
不二製油グループ本社	3,800	3,065.00	11,647,000	
かどや製油	200	3,975.00	795,000	
J - オイルミルズ	800	3,670.00	2,936,000	
キッコーマン	11,100	7,570.00	84,027,000	
味の素	34,200	2,445.50	83,636,100	
キューピー	8,600	2,274.00	19,556,400	
ハウス食品グループ本社	5,800	3,750.00	21,750,000	
カゴメ	6,300	3,395.00	21,388,500	
焼津水産化学工業	700	998.00	698,600	
アリアケジャパン	1,400	6,710.00	9,394,000	
ピエトロ	200	1,746.00	349,200	
エバラ食品工業	400	2,493.00	997,200	
やまみ	100	2,194.00	219,400	
ニチレイ	7,400	2,926.00	21,652,400	
東洋水産	8,000	5,160.00	41,280,000	
イトアンドホールディングス	500	1,828.00	914,000	

大冷	200	1,939.00	387,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	900	822.00	739,800	
日清食品ホールディングス	6,600	9,020.00	59,532,000	
永谷園ホールディングス	800	2,302.00	1,841,600	
一正蒲鉾	600	1,123.00	673,800	
フジッコ	1,700	2,029.00	3,449,300	
ロック・フィールド	1,700	1,519.00	2,582,300	
日本たばこ産業	82,900	2,053.50	170,235,150	
ケンコーマヨネーズ	900	1,807.00	1,626,300	
わらべや日洋ホールディングス	1,000	1,634.00	1,634,000	
なとり	900	1,901.00	1,710,900	
イフジ産業	300	866.00	259,800	
ピクルスコーポレーション	300	3,735.00	1,120,500	
北の達人コーポレーション	5,400	520.00	2,808,000	
ユーグレナ	6,700	881.00	5,902,700	
ミヨシ油脂	500	1,161.00	580,500	
理研ビタミン	1,500	1,367.00	2,050,500	
片倉工業	2,000	1,372.00	2,744,000	
ゲンゼ	1,100	3,300.00	3,630,000	
東洋紡	6,000	1,352.00	8,112,000	
ユニチカ	4,400	399.00	1,755,600	
富士紡ホールディングス	700	4,250.00	2,975,000	
倉敷紡績	1,500	1,806.00	2,709,000	
シキボウ	800	1,034.00	827,200	
日本毛織	5,000	963.00	4,815,000	
ダイトウボウ	2,500	108.00	270,000	
トーア紡コーポレーション	600	465.00	279,000	
ダイドーリミテッド	2,000	183.00	366,000	
帝国繊維	1,700	2,289.00	3,891,300	
帝人	12,300	1,960.00	24,108,000	
東レ	109,300	724.60	79,198,780	
サカイオーベックス	400	2,062.00	824,800	
住江織物	300	2,041.00	612,300	
日本フェルト	900	430.00	387,000	
イチカワ	200	1,268.00	253,600	
日東製網	200	1,496.00	299,200	

アツギ	1,200	490.00	588,000	
ダイニック	600	785.00	471,000	
セーレン	3,700	1,596.00	5,905,200	
ソトー	600	823.00	493,800	
東海染工	200	1,123.00	224,600	
小松マテーレ	2,500	1,012.00	2,530,000	
ワコールホールディングス	3,800	2,059.00	7,824,200	
ホギメディカル	1,700	3,230.00	5,491,000	
クラウドシアホールディングス	400	263.00	105,200	
T S Iホールディングス	4,600	252.00	1,159,200	
マツオカコーポレーション	400	2,018.00	807,200	
ワールド	2,100	1,307.00	2,744,700	
三陽商会	800	611.00	488,800	
ナイガイ	600	327.00	196,200	
オンワードホールディングス	9,100	238.00	2,165,800	
ルックホールディングス	500	920.00	460,000	
キムラタン	8,900	23.00	204,700	
ゴールドウイン	2,700	6,400.00	17,280,000	
デサント	2,900	1,817.00	5,269,300	
キング	700	599.00	419,300	
ヤマトインターナショナル	1,300	331.00	430,300	
特種東海製紙	900	4,805.00	4,324,500	
王子ホールディングス	63,100	643.00	40,573,300	
日本製紙	6,700	1,242.00	8,321,400	
三菱製紙	1,700	334.00	567,800	
北越コーポレーション	9,000	434.00	3,906,000	
中越パルプ工業	600	1,180.00	708,000	
巴川製紙所	400	778.00	311,200	
大王製紙	7,300	1,957.00	14,286,100	
阿波製紙	400	446.00	178,400	
レンゴー	14,300	859.00	12,283,700	
トーモク	900	1,815.00	1,633,500	
ザ・パック	1,100	2,581.00	2,839,100	
クラレ	23,800	1,133.00	26,965,400	
旭化成	100,000	1,204.50	120,450,000	
共和レザー	800	633.00	506,400	

昭和電工	11,500	2,433.00	27,979,500	
住友化学	110,900	500.00	55,450,000	
住友精化	700	4,420.00	3,094,000	
日産化学	8,300	6,120.00	50,796,000	
ラサ工業	500	2,557.00	1,278,500	
クレハ	1,300	6,770.00	8,801,000	
多木化学	600	6,130.00	3,678,000	
テイカ	1,100	1,507.00	1,657,700	
石原産業	2,700	763.00	2,060,100	
片倉コープアグリ	400	1,227.00	490,800	
日本曹達	2,100	3,060.00	6,426,000	
東ソー	23,300	1,789.00	41,683,700	
トクヤマ	4,400	2,622.00	11,536,800	
セントラル硝子	3,100	2,187.00	6,779,700	
東亜合成	9,500	1,176.00	11,172,000	
大阪ソーダ	1,500	2,620.00	3,930,000	
関東電化工業	3,600	836.00	3,009,600	
デンカ	5,500	4,180.00	22,990,000	
信越化学工業	25,900	19,635.00	508,546,500	
日本カーバイド工業	500	1,291.00	645,500	
堺化学工業	1,000	2,058.00	2,058,000	
第一稀元素化学工業	1,600	963.00	1,540,800	
エア・ウォーター	14,000	1,758.00	24,612,000	
日本酸素ホールディングス	14,500	2,093.00	30,348,500	
日本化学工業	500	3,240.00	1,620,000	
東邦アセチレン	200	1,483.00	296,600	
日本パーカラライジング	7,600	1,017.00	7,729,200	
高压ガス工業	2,400	788.00	1,891,200	
チタン工業	200	1,890.00	378,000	
四国化成工業	2,200	1,195.00	2,629,000	
戸田工業	400	2,415.00	966,000	
ステラ ケミファ	800	3,725.00	2,980,000	
保土谷化学工業	600	5,550.00	3,330,000	
日本触媒	2,300	5,810.00	13,363,000	
大日精化工業	1,300	2,284.00	2,969,200	
カネカ	3,900	3,695.00	14,410,500	

三菱瓦斯化学	14,000	2,539.00	35,546,000	
三井化学	14,000	3,060.00	42,840,000	
J S R	14,100	3,280.00	46,248,000	
東京応化工業	2,600	7,760.00	20,176,000	
大阪有機化学工業	1,400	3,845.00	5,383,000	
三菱ケミカルホールディングス	100,900	746.00	75,271,400	
K Hネオケム	2,500	2,526.00	6,315,000	
ダイセル	18,800	793.00	14,908,400	
住友ベークライト	2,400	3,760.00	9,024,000	
積水化学工業	31,900	2,047.00	65,299,300	
日本ゼオン	13,600	1,542.00	20,971,200	
アイカ工業	4,500	3,570.00	16,065,000	
宇部興産	7,600	2,038.00	15,488,800	
積水樹脂	2,700	2,061.00	5,564,700	
タキロンシーアイ	3,300	656.00	2,164,800	
旭有機材	900	1,501.00	1,350,900	
ニチバン	800	1,693.00	1,354,400	
リケンテクノス	3,700	462.00	1,709,400	
大倉工業	700	1,935.00	1,354,500	
積水化成成品工業	2,000	545.00	1,090,000	
群栄化学工業	300	2,426.00	727,800	
タイガースポリマー	800	400.00	320,000	
ミライアル	500	1,236.00	618,000	
ダイキアクシス	500	1,143.00	571,500	
ダイキョーニシカワ	3,200	806.00	2,579,200	
竹本容器	500	915.00	457,500	
森六ホールディングス	800	2,104.00	1,683,200	
日本化薬	9,300	1,000.00	9,300,000	
カーリットホールディングス	1,600	764.00	1,222,400	
日本精化	1,200	1,392.00	1,670,400	
扶桑化学工業	1,500	3,925.00	5,887,500	
トリケミカル研究所	300	17,490.00	5,247,000	
A D E K A	6,900	1,806.00	12,461,400	
日油	5,700	5,040.00	28,728,000	
新日本理化	2,500	268.00	670,000	
ハリマ化成グループ	1,200	954.00	1,144,800	

花王	36,900	7,680.00	283,392,000	
第一工業製薬	600	4,140.00	2,484,000	
石原ケミカル	400	2,097.00	838,800	
日華化学	500	858.00	429,000	
ニイタカ	300	2,805.00	841,500	
三洋化成工業	900	5,410.00	4,869,000	
有機合成薬品工業	1,200	316.00	379,200	
大日本塗料	1,700	930.00	1,581,000	
日本ペイントホールディングス	12,500	9,430.00	117,875,000	
関西ペイント	17,000	3,020.00	51,340,000	
神東塗料	1,200	213.00	255,600	
中国塗料	4,300	981.00	4,218,300	
日本特殊塗料	1,100	1,070.00	1,177,000	
藤倉化成	2,000	498.00	996,000	
太陽ホールディングス	1,100	6,560.00	7,216,000	
D I C	6,400	2,610.00	16,704,000	
サカタインクス	3,300	1,049.00	3,461,700	
東洋インキ S C ホールディングス	3,200	1,868.00	5,977,600	
T & K T O K A	1,200	817.00	980,400	
富士フイルムホールディングス	29,500	6,257.00	184,581,500	
資生堂	30,600	7,009.00	214,475,400	
ライオン	20,000	2,357.00	47,140,000	
高砂香料工業	1,000	2,515.00	2,515,000	
マンダム	3,500	1,588.00	5,558,000	
ミルボン	2,100	6,790.00	14,259,000	
ファンケル	6,200	4,020.00	24,924,000	
コーセー	2,900	16,620.00	48,198,000	
コタ	900	1,471.00	1,323,900	
シーボン	200	1,943.00	388,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,600	2,162.00	14,269,200	
ノエビアホールディングス	1,300	4,630.00	6,019,000	
アジュバンコスメジャパン	300	1,055.00	316,500	
エステー	1,000	1,985.00	1,985,000	
アグロ カネショウ	600	1,588.00	952,800	
コニシ	2,500	1,546.00	3,865,000	
長谷川香料	2,700	2,048.00	5,529,600	

星光PMC	900	789.00	710,100
小林製薬	4,300	11,880.00	51,084,000
荒川化学工業	1,400	1,207.00	1,689,800
メック	1,100	2,410.00	2,651,000
日本高純度化学	400	2,700.00	1,080,000
タカラバイオ	4,000	2,877.00	11,508,000
JCU	1,900	4,040.00	7,676,000
新田ゼラチン	1,000	665.00	665,000
OATアグリオ	300	1,305.00	391,500
デクセリアルズ	4,000	1,397.00	5,588,000
アース製薬	1,200	6,060.00	7,272,000
北興化学工業	1,400	1,298.00	1,817,200
大成ラミック	500	2,890.00	1,445,000
クミアイ化学工業	6,400	880.00	5,632,000
日本農薬	2,700	487.00	1,314,900
アキレス	1,100	1,458.00	1,603,800
有沢製作所	2,300	989.00	2,274,700
日東電工	10,600	9,290.00	98,474,000
レック	1,600	1,353.00	2,164,800
三光合成	1,800	468.00	842,400
きもと	2,600	179.00	465,400
藤森工業	1,400	4,750.00	6,650,000
前澤化成工業	1,000	968.00	968,000
未来工業	800	1,610.00	1,288,000
ウェーブロックホールディングス	500	884.00	442,000
JSP	900	1,742.00	1,567,800
エフピコ	3,200	4,175.00	13,360,000
天馬	1,000	2,183.00	2,183,000
信越ポリマー	2,800	971.00	2,718,800
東リ	3,900	244.00	951,600
ニフコ	5,700	3,860.00	22,002,000
バルカー	1,300	2,160.00	2,808,000
ユニ・チャーム	32,700	4,822.00	157,679,400
ショーエイコーポレーション	300	1,031.00	309,300
協和キリン	15,500	2,918.00	45,229,000
武田薬品工業	128,200	3,714.00	476,134,800

アステラス製薬	133,600	1,720.00	229,792,000	
大日本住友製薬	11,400	1,547.00	17,635,800	
塩野義製薬	19,400	5,751.00	111,569,400	
わかもと製薬	1,800	248.00	446,400	
あすか製薬	1,800	1,579.00	2,842,200	
日本新薬	4,000	7,280.00	29,120,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,471.00	741,300	
中外製薬	48,200	5,649.00	272,281,800	
科研製薬	2,600	4,100.00	10,660,000	
エーザイ	18,400	7,850.00	144,440,000	
ロート製薬	7,900	3,135.00	24,766,500	
小野薬品工業	35,400	3,108.00	110,023,200	
久光製薬	4,100	6,130.00	25,133,000	
持田製薬	2,100	3,905.00	8,200,500	
参天製薬	28,700	1,692.00	48,560,400	
扶桑薬品工業	500	2,621.00	1,310,500	
日本ケミファ	200	2,271.00	454,200	
ツムラ	4,800	3,395.00	16,296,000	
日医工	4,400	1,002.00	4,408,800	
キッセイ薬品工業	2,700	2,228.00	6,015,600	
生化学工業	3,000	1,031.00	3,093,000	
栄研化学	2,700	1,995.00	5,386,500	
日水製薬	600	1,001.00	600,600	
鳥居薬品	1,000	3,270.00	3,270,000	
JCRファーマ	4,300	2,483.00	10,676,900	
東和薬品	2,000	1,986.00	3,972,000	
富士製薬工業	1,000	1,219.00	1,219,000	
沢井製薬	3,200	4,775.00	15,280,000	
ゼリア新薬工業	2,800	1,926.00	5,392,800	
第一三共	132,300	3,586.00	474,427,800	
キョーリン製薬ホールディングス	3,400	1,958.00	6,657,200	
大幸薬品	1,900	1,632.00	3,100,800	
ダイト	1,000	3,665.00	3,665,000	
大塚ホールディングス	32,000	4,478.00	143,296,000	
大正製薬ホールディングス	3,300	6,730.00	22,209,000	
ペプチドリーム	7,800	5,910.00	46,098,000	

日本コークス工業	13,100	95.00	1,244,500	
ニチレキ	1,800	1,516.00	2,728,800	
ユシロ化学工業	900	1,116.00	1,004,400	
ピーピー・カストロール	500	1,228.00	614,000	
富士石油	4,200	212.00	890,400	
MORESCO	600	1,110.00	666,000	
出光興産	17,100	2,524.00	43,160,400	
ENEOSホールディングス	231,800	435.40	100,925,720	
コスモエネルギーホールディングス	4,500	2,321.00	10,444,500	
横浜ゴム	8,900	1,696.00	15,094,400	
TOYO TIRE	8,100	1,639.00	13,275,900	
ブリヂストン	41,000	4,100.00	168,100,000	
住友ゴム工業	13,800	994.00	13,717,200	
藤倉コンポジット	1,300	399.00	518,700	
オカモト	900	3,905.00	3,514,500	
フコク	700	670.00	469,000	
ニッタ	1,700	2,225.00	3,782,500	
住友理工	3,000	587.00	1,761,000	
三ツ星ベルト	2,000	1,680.00	3,360,000	
バンドー化学	2,700	660.00	1,782,000	
日東紡績	2,300	4,660.00	10,718,000	
A G C	14,100	3,830.00	54,003,000	
日本板硝子	7,400	474.00	3,507,600	
石塚硝子	300	1,885.00	565,500	
日本山村硝子	600	863.00	517,800	
日本電気硝子	5,700	2,257.00	12,864,900	
オハラ	600	1,889.00	1,133,400	
住友大阪セメント	2,800	3,115.00	8,722,000	
太平洋セメント	9,700	2,661.00	25,811,700	
日本ヒューム	1,500	787.00	1,180,500	
日本コンクリート工業	3,300	309.00	1,019,700	
三谷セキサン	700	4,750.00	3,325,000	
アジアパイルホールディングス	2,200	499.00	1,097,800	
東海カーボン	15,100	1,530.00	23,103,000	
日本カーボン	800	4,135.00	3,308,000	
東洋炭素	900	2,059.00	1,853,100	

ノリタケカンパニーリミテド	900	3,210.00	2,889,000	
TOTO	11,000	5,960.00	65,560,000	
日本碍子	18,500	1,753.00	32,430,500	
日本特殊陶業	11,700	1,798.00	21,036,600	
ダントーホールディングス	1,100	463.00	509,300	
MARUWA	600	11,670.00	7,002,000	
品川リフラクトリーズ	400	2,806.00	1,122,400	
黒崎播磨	300	4,870.00	1,461,000	
ヨータイ	1,200	839.00	1,006,800	
イソライト工業	800	555.00	444,000	
東京窯業	2,000	341.00	682,000	
ニッカトー	700	819.00	573,300	
フジミインコーポレーテッド	1,400	4,535.00	6,349,000	
クニミネ工業	600	1,256.00	753,600	
エーアンドエーマテリアル	300	1,088.00	326,400	
ニチアス	4,200	2,464.00	10,348,800	
ニチハ	2,100	3,290.00	6,909,000	
日本製鉄	68,200	1,305.50	89,035,100	
神戸製鋼所	27,900	521.00	14,535,900	
中山製鋼所	2,100	354.00	743,400	
合同製鐵	800	2,012.00	1,609,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	41,200	1,003.00	41,323,600	
東京製鐵	7,400	674.00	4,987,600	
共英製鋼	1,700	1,383.00	2,351,100	
大和工業	3,200	2,688.00	8,601,600	
東京鐵鋼	600	2,024.00	1,214,400	
大阪製鐵	800	1,269.00	1,015,200	
淀川製鋼所	2,100	2,102.00	4,414,200	
丸一鋼管	4,900	2,276.00	11,152,400	
モリ工業	500	2,346.00	1,173,000	
大同特殊鋼	2,500	4,220.00	10,550,000	
日本高周波鋼業	600	353.00	211,800	
日本冶金工業	1,300	1,822.00	2,368,600	
山陽特殊製鋼	1,000	1,468.00	1,468,000	
愛知製鋼	900	3,185.00	2,866,500	
日立金属	16,400	1,680.00	27,552,000	

日本金属	400	1,219.00	487,600	
大太平洋金属	1,000	2,366.00	2,366,000	
新日本電工	9,800	284.00	2,783,200	
栗本鐵工所	800	1,672.00	1,337,600	
虹技	200	1,118.00	223,600	
日本鑄鉄管	200	1,318.00	263,600	
三菱製鋼	1,100	642.00	706,200	
日亜鋼業	2,200	300.00	660,000	
日本精線	200	3,785.00	757,000	
エンビプロ・ホールディングス	600	699.00	419,400	
シンニッタン	2,400	205.00	492,000	
新家工業	300	1,288.00	386,400	
大紀アルミニウム工業所	2,500	762.00	1,905,000	
日本軽金属ホールディングス	3,900	1,982.00	7,729,800	
三井金属鉱業	4,100	4,035.00	16,543,500	
東邦亜鉛	800	2,380.00	1,904,000	
三菱マテリアル	10,100	2,380.00	24,038,000	
住友金属鉱山	19,500	5,103.00	99,508,500	
DOWAホールディングス	3,900	4,045.00	15,775,500	
古河機械金属	2,700	1,246.00	3,364,200	
エス・サイエンス	6,800	46.00	312,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,600	878.00	1,404,800	
東邦チタニウム	2,700	905.00	2,443,500	
UACJ	2,300	1,922.00	4,420,600	
CKサンエツ	300	3,725.00	1,117,500	
古河電気工業	4,700	2,850.00	13,395,000	
住友電気工業	57,000	1,449.00	82,593,000	
フジクラ	18,400	487.00	8,960,800	
昭和電線ホールディングス	1,800	1,799.00	3,238,200	
東京特殊電線	200	2,414.00	482,800	
タツタ電線	3,000	789.00	2,367,000	
カナレ電気	300	1,818.00	545,400	
平河ヒューテック	800	1,338.00	1,070,400	
リョービ	1,900	1,242.00	2,359,800	
アーレスティ	2,000	372.00	744,000	
アサヒホールディングス	2,700	4,330.00	11,691,000	

稲葉製作所	900	1,396.00	1,256,400	
宮地エンジニアリンググループ	500	2,451.00	1,225,500	
トーカロ	4,200	1,549.00	6,505,800	
アルファC o	500	1,002.00	501,000	
SUMCO	19,500	2,446.00	47,697,000	
川田テクノロジーズ	300	4,390.00	1,317,000	
RS Technologies	500	6,770.00	3,385,000	
ジェイテックコーポレーション	100	3,925.00	392,500	
信和	900	701.00	630,900	
東洋製罐グループホールディングス	9,700	1,155.00	11,203,500	
ホッカンホールディングス	800	1,435.00	1,148,000	
コロナ	800	942.00	753,600	
横河ブリッジホールディングス	2,800	2,057.00	5,759,600	
駒井ハルテック	300	2,323.00	696,900	
高田機工	100	2,558.00	255,800	
三和ホールディングス	14,400	1,222.00	17,596,800	
文化シャッター	4,500	931.00	4,189,500	
三協立山	2,000	813.00	1,626,000	
アルインコ	1,100	945.00	1,039,500	
東洋シャッター	400	674.00	269,600	
LIXIL	22,500	2,487.00	55,957,500	
日本フィルコン	1,100	508.00	558,800	
ノーリツ	3,200	1,534.00	4,908,800	
長府製作所	1,500	2,093.00	3,139,500	
リンナイ	3,000	11,250.00	33,750,000	
ダイニチ工業	800	923.00	738,400	
日東精工	1,900	452.00	858,800	
三洋工業	200	1,854.00	370,800	
岡部	3,100	770.00	2,387,000	
ジーテクト	1,900	1,480.00	2,812,000	
東プレ	2,800	1,469.00	4,113,200	
高周波熱錬	2,900	483.00	1,400,700	
東京製綱	1,100	1,346.00	1,480,600	
サンコール	1,100	474.00	521,400	
モリテック スチール	1,200	431.00	517,200	
パイオラックス	2,300	1,539.00	3,539,700	

エイチワン	1,500	758.00	1,137,000	
日本発條	16,300	722.00	11,768,600	
中央発條	200	2,809.00	561,800	
アドバネクス	200	1,354.00	270,800	
立川ブラインド工業	700	1,302.00	911,400	
三益半導体工業	1,200	3,010.00	3,612,000	
日本ドライケミカル	400	1,522.00	608,800	
日本製鋼所	4,600	3,100.00	14,260,000	
三浦工業	6,600	6,170.00	40,722,000	
タクマ	5,200	2,166.00	11,263,200	
ツガミ	3,200	1,856.00	5,939,200	
オークマ	1,800	6,240.00	11,232,000	
芝浦機械	1,700	2,512.00	4,270,400	
アマダ	18,900	1,203.00	22,736,700	
アイダエンジニアリング	4,000	992.00	3,968,000	
滝澤鉄工所	500	1,007.00	503,500	
F U J I	6,600	2,864.00	18,902,400	
牧野フライス製作所	1,800	4,220.00	7,596,000	
オーエスジー	7,500	1,949.00	14,617,500	
ダイジェット工業	200	1,333.00	266,600	
旭ダイヤモンド工業	4,000	475.00	1,900,000	
D M G 森精機	9,600	1,619.00	15,542,400	
ソディック	3,300	922.00	3,042,600	
ディスコ	2,100	37,200.00	78,120,000	
日東工器	800	1,745.00	1,396,000	
日進工具	600	2,721.00	1,632,600	
パンチ工業	1,400	445.00	623,000	
富士ダイス	700	664.00	464,800	
豊和工業	800	877.00	701,600	
O K K	600	422.00	253,200	
石川製作所	400	1,793.00	717,200	
東洋機械金属	1,100	444.00	488,400	
津田駒工業	300	886.00	265,800	
エンシュウ	400	883.00	353,200	
島精機製作所	2,400	1,880.00	4,512,000	
オプトラン	1,900	2,339.00	4,444,100	

NCホールディングス	500	591.00	295,500	
イワキポンプ	1,000	825.00	825,000	
フリー	1,500	1,126.00	1,689,000	
ヤマシンフィルタ	3,400	1,042.00	3,542,800	
日阪製作所	1,900	848.00	1,611,200	
やまびこ	3,000	1,335.00	4,005,000	
平田機工	700	8,430.00	5,901,000	
ペガサスマシン製造	1,600	341.00	545,600	
マルマエ	600	1,359.00	815,400	
タツモ	600	1,619.00	971,400	
ナブテスコ	9,000	5,080.00	45,720,000	
三井海洋開発	1,600	2,073.00	3,316,800	
レオン自動機	1,500	1,176.00	1,764,000	
S M C	4,800	67,740.00	325,152,000	
ホソカワミクロン	500	6,400.00	3,200,000	
ユニオンツール	600	3,575.00	2,145,000	
オイレス工業	2,000	1,686.00	3,372,000	
日精エー・エス・ピー機械	400	5,930.00	2,372,000	
サトーホールディングス	2,200	2,206.00	4,853,200	
技研製作所	1,300	4,990.00	6,487,000	
日本エアーテック	500	1,534.00	767,000	
カワタ	400	1,016.00	406,400	
日精樹脂工業	1,300	898.00	1,167,400	
オカダアイヨン	500	1,162.00	581,000	
ワイエイシイホールディングス	700	1,098.00	768,600	
小松製作所	69,800	2,935.00	204,863,000	
住友重機械工業	8,800	3,035.00	26,708,000	
日立建機	6,200	3,220.00	19,964,000	
日工	2,100	717.00	1,505,700	
巴工業	600	2,035.00	1,221,000	
井関農機	1,500	1,388.00	2,082,000	
T O W A	1,600	2,160.00	3,456,000	
丸山製作所	300	1,640.00	492,000	
北川鉄工所	700	1,358.00	950,600	
ローツェ	700	8,530.00	5,971,000	
タカキタ	500	710.00	355,000	

クボタ	81,000	2,360.00	191,160,000
荏原実業	400	3,970.00	1,588,000
三菱化工機	500	3,390.00	1,695,000
月島機械	2,800	1,386.00	3,880,800
帝国電機製作所	1,300	1,192.00	1,549,600
東京機械製作所	600	285.00	171,000
新東工業	3,700	753.00	2,786,100
澁谷工業	1,300	3,485.00	4,530,500
アイチ コーポレーション	2,700	926.00	2,500,200
小森コーポレーション	3,900	712.00	2,776,800
鶴見製作所	1,200	1,813.00	2,175,600
住友精密工業	200	2,009.00	401,800
日本ギア工業	600	298.00	178,800
酒井重工業	300	2,120.00	636,000
荏原製作所	6,400	3,685.00	23,584,000
石井鐵工所	200	2,883.00	576,600
西島製作所	1,600	874.00	1,398,400
北越工業	1,600	1,044.00	1,670,400
ダイキン工業	19,600	23,330.00	457,268,000
オルガノ	600	6,860.00	4,116,000
トーヨーカネツ	700	2,559.00	1,791,300
栗田工業	8,300	4,435.00	36,810,500
榑本チエイン	2,200	2,760.00	6,072,000
大同工業	700	735.00	514,500
木村化工機	1,300	612.00	795,600
アネスト岩田	2,400	1,122.00	2,692,800
ダイフク	7,900	12,850.00	101,515,000
サムコ	400	4,210.00	1,684,000
加藤製作所	800	940.00	752,000
油研工業	300	1,569.00	470,700
タダノ	7,400	941.00	6,963,400
フジテック	5,600	2,373.00	13,288,800
C K D	4,200	2,649.00	11,125,800
キトー	1,200	1,581.00	1,897,200
平和	4,300	1,457.00	6,265,100
理想科学工業	1,400	1,363.00	1,908,200

SANKYO	3,400	2,940.00	9,996,000	
日本金銭機械	1,700	522.00	887,400	
マースグループホールディングス	1,000	1,518.00	1,518,000	
フクシマガリレイ	1,000	4,335.00	4,335,000	
オーイズミ	600	407.00	244,200	
ダイコク電機	700	878.00	614,600	
竹内製作所	2,600	2,404.00	6,250,400	
アマノ	4,000	2,431.00	9,724,000	
JUKI	2,100	549.00	1,152,900	
サンデンホールディングス	2,000	375.00	750,000	
蛇の目マシン工業	1,400	832.00	1,164,800	
マックス	2,400	1,462.00	3,508,800	
グローリー	4,000	2,048.00	8,192,000	
新晃工業	1,400	1,806.00	2,528,400	
大和冷機工業	2,500	1,036.00	2,590,000	
セガサミーホールディングス	15,300	1,706.00	26,101,800	
日本ピストンリング	600	943.00	565,800	
リケン	700	2,128.00	1,489,600	
T P R	2,100	1,431.00	3,005,100	
ツバキ・ナカシマ	2,900	1,257.00	3,645,300	
ホシザキ	4,900	9,030.00	44,247,000	
大豊工業	1,300	760.00	988,000	
日本精工	29,000	971.00	28,159,000	
NTN	35,700	275.00	9,817,500	
ジェイテクト	14,800	886.00	13,112,800	
不二越	1,400	4,395.00	6,153,000	
日本トムソン	4,600	483.00	2,221,800	
THK	9,600	3,660.00	35,136,000	
ユーシン精機	1,200	965.00	1,158,000	
前澤給装工業	600	2,209.00	1,325,400	
イーグル工業	1,900	1,003.00	1,905,700	
前澤工業	1,000	598.00	598,000	
日本ピラー工業	1,600	1,695.00	2,712,000	
キッツ	5,600	600.00	3,360,000	
マキタ	20,100	5,150.00	103,515,000	
日立造船	12,200	662.00	8,076,400	

三菱重工業	25,800	3,158.00	81,476,400
I H I	11,100	1,999.00	22,188,900
スター精密	2,400	1,625.00	3,900,000
日清紡ホールディングス	9,400	786.00	7,388,400
イビデン	9,400	5,110.00	48,034,000
コニカミノルタ	33,700	423.00	14,255,100
ブラザー工業	18,800	2,340.00	43,992,000
ミネベアミツミ	28,600	2,352.00	67,267,200
日立製作所	74,100	4,398.00	325,891,800
三菱電機	154,100	1,670.00	257,347,000
富士電機	9,300	4,150.00	38,595,000
東洋電機製造	600	1,178.00	706,800
安川電機	16,600	5,820.00	96,612,000
シンフォニアテクノロジー	2,000	1,459.00	2,918,000
明電舎	2,800	2,494.00	6,983,200
オリジン	400	1,364.00	545,600
山洋電気	700	6,220.00	4,354,000
デンヨー	1,300	2,076.00	2,698,800
東芝テック	1,900	3,760.00	7,144,000
芝浦メカトロニクス	300	6,050.00	1,815,000
マブチモーター	4,300	4,180.00	17,974,000
日本電産	37,100	14,320.00	531,272,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	900	480.00	432,000
トレックス・セミコンダクター	900	1,581.00	1,422,900
東光高岳	900	1,623.00	1,460,700
ダブル・スコープ	2,800	1,076.00	3,012,800
宮越ホールディングス	600	774.00	464,400
ダイヘン	1,700	4,975.00	8,457,500
ヤーマン	2,500	1,887.00	4,717,500
J V C ケンウッド	12,600	174.00	2,192,400
ミマキエンジニアリング	1,400	479.00	670,600
I - P E X	700	2,219.00	1,553,300
日新電機	3,600	1,400.00	5,040,000
大崎電気工業	3,100	592.00	1,835,200
オムロン	13,800	9,410.00	129,858,000
日東工業	2,300	2,074.00	4,770,200

I D E C	2,200	1,848.00	4,065,600	
正興電機製作所	400	2,118.00	847,200	
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	5,100	3,215.00	16,396,500	
サクサホールディングス	400	1,385.00	554,000	
メルコホールディングス	500	3,500.00	1,750,000	
テクノメディカ	300	1,580.00	474,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	1,526.00	457,800	
日本電気	18,700	5,930.00	110,891,000	
富士通	14,900	16,740.00	249,426,000	
沖電気工業	6,300	1,080.00	6,804,000	
岩崎通信機	700	840.00	588,000	
電気興業	700	2,764.00	1,934,800	
サンケン電気	1,700	5,110.00	8,687,000	
ナカヨ	300	1,421.00	426,300	
アイホン	900	1,642.00	1,477,800	
ルネサスエレクトロニクス	66,200	1,334.00	88,310,800	
セイコーエプソン	19,100	1,662.00	31,744,200	
ワコム	10,400	1,008.00	10,483,200	
アルバック	2,800	5,150.00	14,420,000	
アクセル	600	772.00	463,200	
E I Z O	1,200	3,750.00	4,500,000	
ジャパンディスプレイ	44,900	48.00	2,155,200	
日本信号	3,900	936.00	3,650,400	
京三製作所	3,600	416.00	1,497,600	
能美防災	2,000	2,223.00	4,446,000	
ホーチキ	1,100	1,237.00	1,360,700	
星和電機	800	662.00	529,600	
エレコム	1,800	5,050.00	9,090,000	
パナソニック	176,100	1,423.00	250,590,300	
シャープ	17,800	2,073.00	36,899,400	
アンリツ	9,900	2,654.00	26,274,600	
富士通ゼネラル	4,200	2,636.00	11,071,200	
ソニー	96,500	10,300.00	993,950,000	
T D K	7,400	17,750.00	131,350,000	

帝国通信工業	700	1,100.00	770,000
タムラ製作所	5,100	576.00	2,937,600
アルプスアルパイン	13,600	1,543.00	20,984,800
池上通信機	500	862.00	431,000
日本電波工業	1,400	785.00	1,099,000
鈴木	800	1,177.00	941,600
日本トリム	200	4,545.00	909,000
ローランド ディー . ジー .	900	1,745.00	1,570,500
フォスター電機	1,600	1,488.00	2,380,800
S M K	400	3,100.00	1,240,000
ヨコオ	1,000	3,290.00	3,290,000
ティアック	1,100	106.00	116,600
ホシデン	4,200	960.00	4,032,000
ヒロセ電機	2,400	15,610.00	37,464,000
日本航空電子工業	3,500	1,627.00	5,694,500
T O A	1,700	832.00	1,414,400
マクセルホールディングス	3,300	1,351.00	4,458,300
古野電気	2,000	1,142.00	2,284,000
ユニデンホールディングス	400	2,166.00	866,400
スミダコーポレーション	1,300	1,020.00	1,326,000
アイコム	900	2,712.00	2,440,800
リオン	600	3,420.00	2,052,000
本多通信工業	1,300	497.00	646,100
船井電機	1,600	430.00	688,000
横河電機	14,100	2,318.00	32,683,800
新電元工業	500	2,925.00	1,462,500
アズビル	9,700	5,450.00	52,865,000
東亜ディーケーケー	800	834.00	667,200
日本光電工業	6,400	3,140.00	20,096,000
チノー	500	1,405.00	702,500
共和電業	1,600	391.00	625,600
日本電子材料	600	2,232.00	1,339,200
堀場製作所	3,100	6,940.00	21,514,000
アドバンテスト	11,500	9,170.00	105,455,000
小野測器	600	537.00	322,200
エスベック	1,400	2,035.00	2,849,000

キーエンス	14,000	57,470.00	804,580,000
日置電機	700	4,255.00	2,978,500
シスメックス	11,000	13,000.00	143,000,000
日本マイクロニクス	2,700	1,676.00	4,525,200
メガチップス	1,400	3,200.00	4,480,000
O B A R A G R O U P	900	4,140.00	3,726,000
澤藤電機	200	2,177.00	435,400
原田工業	700	847.00	592,900
コーセル	2,100	1,221.00	2,564,100
イリソ電子工業	1,300	4,805.00	6,246,500
オブテックスグループ	2,500	2,090.00	5,225,000
千代田インテグレ	600	1,801.00	1,080,600
アイ・オー・データ機器	500	1,020.00	510,000
レーザーテック	6,800	15,060.00	102,408,000
スタンレー電気	10,800	3,300.00	35,640,000
岩崎電気	600	1,429.00	857,400
ウシオ電機	8,500	1,395.00	11,857,500
岡谷電機産業	1,200	362.00	434,400
ヘリオス テクノ ホールディング	1,400	321.00	449,400
エノモト	500	1,625.00	812,500
日本セラミック	1,600	2,843.00	4,548,800
遠藤照明	800	520.00	416,000
古河電池	1,100	1,663.00	1,829,300
双信電機	700	450.00	315,000
山一電機	1,100	1,737.00	1,910,700
図研	1,000	2,859.00	2,859,000
日本電子	3,000	4,475.00	13,425,000
カシオ計算機	13,600	1,769.00	24,058,400
ファナック	14,500	26,960.00	390,920,000
日本シイエムケイ	3,600	423.00	1,522,800
エンプラス	800	3,970.00	3,176,000
大真空	600	2,548.00	1,528,800
ローム	6,400	11,690.00	74,816,000
浜松ホトニクス	11,100	6,520.00	72,372,000
三井ハイテック	1,700	4,395.00	7,471,500
新光電気工業	5,200	2,700.00	14,040,000

京セラ	21,700	6,952.00	150,858,400
太陽誘電	6,900	6,040.00	41,676,000
村田製作所	45,300	10,580.00	479,274,000
双葉電子工業	2,400	946.00	2,270,400
北陸電気工業	600	924.00	554,400
ニチコン	5,200	1,509.00	7,846,800
日本ケミコン	1,300	1,976.00	2,568,800
K O A	2,300	1,693.00	3,893,900
市光工業	2,300	695.00	1,598,500
小糸製作所	9,200	7,070.00	65,044,000
ミツバ	2,800	452.00	1,265,600
S C R E E Nホールディングス	2,700	8,430.00	22,761,000
キャノン電子	1,400	1,597.00	2,235,800
キャノン	76,600	2,225.00	170,435,000
リコー	39,200	736.00	28,851,200
象印マホービン	4,200	1,739.00	7,303,800
M U T O Hホールディングス	200	1,511.00	302,200
東京エレクトロン	9,800	43,970.00	430,906,000
トヨタ紡織	4,500	1,664.00	7,488,000
芦森工業	300	950.00	285,000
ユニプレス	3,000	979.00	2,937,000
豊田自動織機	12,500	8,680.00	108,500,000
モリタホールディングス	2,700	1,705.00	4,603,500
三櫻工業	2,000	961.00	1,922,000
デンソー	33,900	5,993.00	203,162,700
東海理化電機製作所	4,100	1,704.00	6,986,400
三井E & Sホールディングス	5,600	426.00	2,385,600
川崎重工業	12,000	2,392.00	28,704,000
名村造船所	5,000	179.00	895,000
サノヤスホールディングス	1,900	160.00	304,000
日本車輛製造	600	2,507.00	1,504,200
三菱ロジスネクスト	2,000	1,193.00	2,386,000
近畿車輛	200	1,235.00	247,000
日産自動車	181,800	549.50	99,899,100
いすゞ自動車	44,700	952.00	42,554,400
トヨタ自動車	172,000	7,677.00	1,320,444,000

日野自動車	19,200	919.00	17,644,800
三菱自動車工業	57,000	235.00	13,395,000
エフテック	1,100	612.00	673,200
レシップホールディングス	600	501.00	300,600
G M B	300	1,116.00	334,800
ファルテック	300	704.00	211,200
武蔵精密工業	3,400	1,495.00	5,083,000
日産車体	3,000	867.00	2,601,000
新明和工業	4,200	909.00	3,817,800
極東開発工業	2,900	1,436.00	4,164,400
トビー工業	1,300	1,283.00	1,667,900
ティラド	600	1,338.00	802,800
曙ブレーキ工業	8,500	156.00	1,326,000
タチエス	2,500	1,094.00	2,735,000
N O K	8,300	1,245.00	10,333,500
フタバ産業	4,300	515.00	2,214,500
K Y B	1,700	2,330.00	3,961,000
大同メタル工業	3,000	520.00	1,560,000
プレス工業	7,700	310.00	2,387,000
ミクニ	2,000	273.00	546,000
太平洋工業	3,200	1,141.00	3,651,200
河西工業	2,100	396.00	831,600
アイシン精機	12,700	3,130.00	39,751,000
マツダ	45,300	765.00	34,654,500
今仙電機製作所	1,400	735.00	1,029,000
本田技研工業	121,300	2,824.50	342,611,850
スズキ	30,500	5,137.00	156,678,500
S U B A R U	47,800	2,031.00	97,081,800
安永	700	1,291.00	903,700
ヤマハ発動機	21,800	2,195.00	47,851,000
T B K	1,800	444.00	799,200
エクセディ	2,100	1,467.00	3,080,700
豊田合成	5,000	2,794.00	13,970,000
愛三工業	2,400	525.00	1,260,000
盟和産業	200	878.00	175,600
日本プラスト	1,200	497.00	596,400

ヨロズ	1,400	1,251.00	1,751,400	
エフ・シー・シー	2,500	1,724.00	4,310,000	
シマノ	5,800	26,220.00	152,076,000	
テイ・エス テック	3,600	3,090.00	11,124,000	
ジャムコ	800	689.00	551,200	
テルモ	43,600	4,193.00	182,814,800	
クリエートメディック	500	968.00	484,000	
日機装	5,000	1,034.00	5,170,000	
日本エム・ディ・エム	900	2,306.00	2,075,400	
島津製作所	18,400	4,155.00	76,452,000	
JMS	1,300	959.00	1,246,700	
クボテック	400	363.00	145,200	
長野計器	1,100	986.00	1,084,600	
ブイ・テクノロジー	700	6,510.00	4,557,000	
東京計器	1,000	916.00	916,000	
愛知時計電機	200	4,250.00	850,000	
インターアクション	800	2,646.00	2,116,800	
オーバル	1,400	347.00	485,800	
東京精密	2,800	5,120.00	14,336,000	
マニー	6,100	2,906.00	17,726,600	
ニコン	23,500	855.00	20,092,500	
トプコン	7,800	1,305.00	10,179,000	
オリンパス	85,300	2,056.50	175,419,450	
理研計器	1,400	3,040.00	4,256,000	
タムロン	1,200	2,032.00	2,438,400	
HOYA	30,600	13,710.00	419,526,000	
シード	700	607.00	424,900	
ノーリツ鋼機	1,000	2,250.00	2,250,000	
エー・アンド・デイ	1,400	1,296.00	1,814,400	
朝日インテック	17,500	3,455.00	60,462,500	
シチズン時計	18,000	306.00	5,508,000	
リズム	500	689.00	344,500	
大研医器	1,100	570.00	627,000	
メニコン	2,200	6,830.00	15,026,000	
シンシア	200	689.00	137,800	
松風	700	1,783.00	1,248,100	

セイコーホールディングス	2,200	1,322.00	2,908,400
ニプロ	10,700	1,236.00	13,225,200
中本パックス	400	1,661.00	664,400
スノーピーク	900	1,896.00	1,706,400
パラマウントベッドホールディングス	1,600	4,775.00	7,640,000
トランザクション	800	1,062.00	849,600
粧美堂	400	396.00	158,400
ニホンフラッシュ	1,400	1,336.00	1,870,400
前田工織	1,700	2,724.00	4,630,800
永大産業	2,000	285.00	570,000
アートネイチャー	1,600	647.00	1,035,200
バンダイナムコホールディングス	15,900	9,544.00	151,749,600
アイフィスジャパン	400	708.00	283,200
共立印刷	2,600	118.00	306,800
S H O E I	1,300	4,150.00	5,395,000
フランスベッドホールディングス	2,200	917.00	2,017,400
パイロットコーポレーション	2,700	2,988.00	8,067,600
萩原工業	900	1,486.00	1,337,400
トッパン・フォームズ	3,300	1,066.00	3,517,800
フジシールインターナショナル	3,500	1,931.00	6,758,500
タカラトミー	6,900	900.00	6,210,000
廣済堂	1,100	849.00	933,900
エステールホールディングス	400	604.00	241,600
タカノ	600	597.00	358,200
プロネクサス	1,300	1,071.00	1,392,300
ホクシン	1,100	112.00	123,200
ウッドワン	500	1,052.00	526,000
大建工業	1,000	1,757.00	1,757,000
凸版印刷	21,800	1,488.00	32,438,400
大日本印刷	20,200	1,849.00	37,349,800
共同印刷	500	3,565.00	1,782,500
N I S S H A	3,200	1,384.00	4,428,800
光村印刷	100	1,667.00	166,700
T A K A R A & C O M P A N Y	700	1,739.00	1,217,300
アシックス	13,600	1,782.00	24,235,200
ツツミ	500	1,865.00	932,500

小松ウオール工業	500	1,739.00	869,500	
ヤマハ	9,200	6,070.00	55,844,000	
河合楽器製作所	500	2,862.00	1,431,000	
クリナップ	1,400	469.00	656,600	
ピジョン	9,900	4,600.00	45,540,000	
オリバー	300	2,482.00	744,600	
兼松サステック	100	1,749.00	174,900	
キングジム	1,300	861.00	1,119,300	
リンテック	3,700	2,429.00	8,987,300	
イトーキ	3,100	335.00	1,038,500	
任天堂	9,500	62,680.00	595,460,000	
三菱鉛筆	2,500	1,306.00	3,265,000	
タカラスタンダード	3,200	1,509.00	4,828,800	
コクヨ	7,400	1,343.00	9,938,200	
ナカバヤシ	1,500	611.00	916,500	
グローブライド	700	4,555.00	3,188,500	
オカムラ	5,400	942.00	5,086,800	
美津濃	1,400	2,076.00	2,906,400	
東京電力ホールディングス	123,000	409.00	50,307,000	
中部電力	47,100	1,318.00	62,077,800	
関西電力	58,400	1,079.50	63,042,800	
中国電力	22,200	1,292.00	28,682,400	
北陸電力	14,100	712.00	10,039,200	
東北電力	38,500	910.00	35,035,000	
四国電力	13,900	729.00	10,133,100	
九州電力	31,800	1,025.00	32,595,000	
北海道電力	14,400	427.00	6,148,800	
沖縄電力	3,000	1,418.00	4,254,000	
電源開発	12,300	1,775.00	21,832,500	
エフオン	800	1,222.00	977,600	
イーレックス	2,400	1,839.00	4,413,600	
レノバ	2,600	4,470.00	11,622,000	
東京瓦斯	29,600	2,356.00	69,737,600	
大阪瓦斯	29,900	1,971.00	58,932,900	
東邦瓦斯	7,600	6,290.00	47,804,000	
北海道瓦斯	800	1,560.00	1,248,000	

広島ガス	3,200	375.00	1,200,000
西部瓦斯	1,700	3,025.00	5,142,500
静岡ガス	4,400	997.00	4,386,800
メタウォーター	1,500	2,489.00	3,733,500
SBSホールディングス	1,100	2,422.00	2,664,200
東武鉄道	16,100	2,943.00	47,382,300
相鉄ホールディングス	4,900	2,451.00	12,009,900
東急	38,900	1,267.00	49,286,300
京浜急行電鉄	19,800	1,620.00	32,076,000
小田急電鉄	22,900	3,205.00	73,394,500
京王電鉄	8,000	8,190.00	65,520,000
京成電鉄	10,700	3,465.00	37,075,500
富士急行	2,100	4,965.00	10,426,500
新京成電鉄	400	2,192.00	876,800
東日本旅客鉄道	27,100	6,840.00	185,364,000
西日本旅客鉄道	13,700	5,390.00	73,843,000
東海旅客鉄道	12,800	14,750.00	188,800,000
西武ホールディングス	20,100	989.00	19,878,900
鴻池運輸	2,500	1,013.00	2,532,500
西日本鉄道	4,300	2,929.00	12,594,700
ハマキョウレックス	1,200	3,005.00	3,606,000
サカイ引越センター	800	5,080.00	4,064,000
近鉄グループホールディングス	14,600	4,475.00	65,335,000
阪急阪神ホールディングス	19,500	3,365.00	65,617,500
南海電気鉄道	6,900	2,537.00	17,505,300
京阪ホールディングス	6,500	4,935.00	32,077,500
神戸電鉄	300	3,585.00	1,075,500
名古屋鉄道	12,000	2,661.00	31,932,000
山陽電気鉄道	1,000	1,985.00	1,985,000
日本通運	5,100	7,280.00	37,128,000
ヤマトホールディングス	24,200	2,616.00	63,307,200
山九	4,100	3,955.00	16,215,500
丸運	900	254.00	228,600
丸全昭和運輸	1,200	3,375.00	4,050,000
センコーグループホールディングス	8,000	994.00	7,952,000
トナミホールディングス	400	5,420.00	2,168,000

ニッコンホールディングス	5,200	2,108.00	10,961,600	
日本石油輸送	200	2,652.00	530,400	
福山通運	1,900	4,080.00	7,752,000	
セイノーホールディングス	10,900	1,390.00	15,151,000	
エスライン	400	880.00	352,000	
神奈川中央交通	400	3,830.00	1,532,000	
日立物流	2,700	3,125.00	8,437,500	
丸和運輸機関	3,100	2,293.00	7,108,300	
C & F ロジホールディングス	1,500	2,119.00	3,178,500	
九州旅客鉄道	12,800	2,137.00	27,353,600	
S Gホールディングス	30,600	2,775.00	84,915,000	
日本郵船	12,200	2,585.00	31,537,000	
商船三井	9,200	2,978.00	27,397,600	
川崎汽船	4,500	1,971.00	8,869,500	
N S ユナイテッド海運	800	1,459.00	1,167,200	
明治海運	1,600	377.00	603,200	
飯野海運	6,800	431.00	2,930,800	
共栄タンカー	300	906.00	271,800	
乾汽船	800	927.00	741,600	
日本航空	32,800	1,890.00	61,992,000	
A N A ホールディングス	36,300	2,233.00	81,057,900	
パスコ	300	1,404.00	421,200	
トランコム	400	8,430.00	3,372,000	
日新	1,300	1,238.00	1,609,400	
三菱倉庫	4,600	3,100.00	14,260,000	
三井倉庫ホールディングス	1,700	2,290.00	3,893,000	
住友倉庫	5,200	1,288.00	6,697,600	
澁澤倉庫	800	2,123.00	1,698,400	
東陽倉庫	2,600	319.00	829,400	
日本トランスシティ	3,200	528.00	1,689,600	
ケイヒン	300	1,301.00	390,300	
中央倉庫	900	1,139.00	1,025,100	
川西倉庫	300	1,157.00	347,100	
安田倉庫	1,200	953.00	1,143,600	
ファイズホールディングス	300	1,137.00	341,100	
東洋埠頭	400	1,400.00	560,000	

宇徳	1,200	461.00	553,200	
上組	8,100	1,861.00	15,074,100	
サンリツ	300	700.00	210,000	
キムラユニティー	400	1,082.00	432,800	
キューソー流通システム	400	1,565.00	626,000	
近鉄エクスプレス	3,100	2,622.00	8,128,200	
東海運	800	314.00	251,200	
エーアイティー	1,000	990.00	990,000	
内外トランスライン	500	1,170.00	585,000	
日本コンセプト	500	1,458.00	729,000	
N E C ネットズエスアイ	4,300	1,917.00	8,243,100	
クロスキャット	400	1,226.00	490,400	
システナ	5,400	2,038.00	11,005,200	
デジタルアーツ	700	10,370.00	7,259,000	
日鉄ソリューションズ	2,300	3,235.00	7,440,500	
キューブシステム	800	1,285.00	1,028,000	
エイジア	300	1,948.00	584,400	
コア	600	1,444.00	866,400	
ラクーンホールディングス	700	1,921.00	1,344,700	
ソリトンシステムズ	800	1,864.00	1,491,200	
ソフトクリエイトホールディングス	700	2,814.00	1,969,800	
T I S	15,100	2,192.00	33,099,200	
J N S ホールディングス	600	570.00	342,000	
電算システム	600	3,270.00	1,962,000	
グリー	9,300	593.00	5,514,900	
コーエーテクモホールディングス	3,100	6,010.00	18,631,000	
三菱総合研究所	600	4,290.00	2,574,000	
ボルテージ	400	523.00	209,200	
電算	200	2,473.00	494,600	
A G S	900	831.00	747,900	
ファインデックス	1,300	1,155.00	1,501,500	
ブレインパッド	400	4,250.00	1,700,000	
K L a b	2,800	921.00	2,578,800	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	1,800	1,222.00	2,199,600	
イーブックイニシアティブジャパン	200	2,736.00	547,200	

ネクソン	38,200	3,265.00	124,723,000	
アイスタイル	4,200	437.00	1,835,400	
エムアップホールディングス	400	2,543.00	1,017,200	
エイチーム	1,000	1,184.00	1,184,000	
エニグモ	1,400	1,274.00	1,783,600	
テクノスジャパン	1,200	715.00	858,000	
e n i s h	800	488.00	390,400	
コロプラ	5,000	930.00	4,650,000	
オルトプラス	900	432.00	388,800	
ブロードリーフ	7,500	654.00	4,905,000	
クロス・マーケティンググループ	700	373.00	261,100	
デジタルハーツホールディングス	800	1,339.00	1,071,200	
システム情報	1,100	1,225.00	1,347,500	
メディアドゥ	500	6,970.00	3,485,000	
じげん	3,700	403.00	1,491,100	
ブイキューブ	800	3,320.00	2,656,000	
エンカレッジ・テクノロジー	300	693.00	207,900	
サイバーリンクス	500	2,198.00	1,099,000	
ディー・エル・イー	1,200	322.00	386,400	
フィックスターズ	1,600	1,013.00	1,620,800	
C A R T A H O L D I N G S	600	1,368.00	820,800	
オブティム	800	3,235.00	2,588,000	
セレス	500	2,562.00	1,281,000	
S H I F T	700	13,100.00	9,170,000	
ティーガイア	1,300	1,918.00	2,493,400	
セック	200	2,849.00	569,800	
日本アジアグループ	1,600	877.00	1,403,200	
テクマトリックス	2,100	1,997.00	4,193,700	
プロシップ	400	1,447.00	578,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,600	2,593.00	9,334,800	
G M O ペイメントゲートウェイ	3,200	15,640.00	50,048,000	
ザッパラス	700	497.00	347,900	
システムリサーチ	400	1,813.00	725,200	
インターネットイニシアティブ	4,500	2,236.00	10,062,000	
さくらインターネット	1,600	732.00	1,171,200	
ヴァンクス	400	1,200.00	480,000	

GMOグローバルサイン・ホールディングス	300	9,360.00	2,808,000	
SRAホールディングス	800	2,539.00	2,031,200	
システムインテグレータ	500	620.00	310,000	
朝日ネット	1,100	872.00	959,200	
eBASE	1,800	1,073.00	1,931,400	
アバント	1,400	1,258.00	1,761,200	
アドソル日進	500	3,345.00	1,672,500	
フリービット	800	996.00	796,800	
コムチュア	1,700	2,969.00	5,047,300	
サイバーコム	300	1,705.00	511,500	
アステリア	900	1,059.00	953,100	
アイル	800	1,507.00	1,205,600	
マークライنز	600	2,548.00	1,528,800	
メディカル・データ・ビジョン	1,700	3,020.00	5,134,000	
gumi	1,900	881.00	1,673,900	
ショーケース	300	1,021.00	306,300	
モバイルファクトリー	300	1,112.00	333,600	
テラスカイ	500	3,830.00	1,915,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	600	1,621.00	972,600	
PCIホールディングス	600	1,564.00	938,400	
パイプドHD	200	1,660.00	332,000	
アイビーシー	200	1,116.00	223,200	
ネオジャパン	300	2,026.00	607,800	
PR TIMES	300	4,120.00	1,236,000	
ランドコンピュータ	200	1,117.00	223,400	
ダブルスタンダード	200	4,505.00	901,000	
オープンドア	700	1,720.00	1,204,000	
マイネット	500	935.00	467,500	
アカツキ	500	4,815.00	2,407,500	
ベネフィットジャパン	100	1,890.00	189,000	
Ubicomホールディングス	300	3,555.00	1,066,500	
カナミックネットワーク	1,400	741.00	1,037,400	
ノムラシステムコーポレーション	700	381.00	266,700	
チェンジ	2,100	3,770.00	7,917,000	
シンクロ・フード	700	344.00	240,800	

オークネット	800	1,361.00	1,088,800
セグエグループ	400	1,333.00	533,200
エイトレッド	300	2,688.00	806,400
AOI TYO Holdings	1,500	443.00	664,500
マクロミル	3,100	721.00	2,235,100
ビーグリー	300	1,773.00	531,900
オロ	500	4,055.00	2,027,500
ユーザーローカル	200	4,430.00	886,000
テモナ	300	1,043.00	312,900
ニーズウェル	300	683.00	204,900
サインポスト	300	975.00	292,500
ソルクシーズ	600	1,001.00	600,600
フェイス	500	812.00	406,000
プロトコーポレーション	1,400	1,069.00	1,496,600
ハイマックス	400	1,210.00	484,000
野村総合研究所	21,400	3,805.00	81,427,000
サイバネットシステム	1,100	987.00	1,085,700
CEホールディングス	800	645.00	516,000
日本システム技術	200	1,590.00	318,000
インテージホールディングス	1,900	1,153.00	2,190,700
東邦システムサイエンス	400	928.00	371,200
ソースネクスト	7,200	282.00	2,030,400
インフォコム	1,700	3,415.00	5,805,500
HEROZ	200	2,833.00	566,600
ラクスル	1,200	4,255.00	5,106,000
FIG	1,700	265.00	450,500
システムサポート	300	1,597.00	479,100
イーソル	800	1,228.00	982,400
アルテリア・ネットワークス	1,700	1,605.00	2,728,500
EduLab	100	7,260.00	726,000
東海ソフト	100	1,213.00	121,300
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	1,965.00	589,500
東名	100	1,146.00	114,600
ヴィッツ	100	2,188.00	218,800
トピラシステムズ	100	1,391.00	139,100

Link - U	100	1,365.00	136,500
フォーカスシステムズ	900	968.00	871,200
クレスコ	900	1,332.00	1,198,800
フジ・メディア・ホールディングス	14,600	1,171.00	17,096,600
オービック	5,200	20,930.00	108,836,000
ジャストシステム	2,500	7,890.00	19,725,000
TDCソフト	1,300	975.00	1,267,500
Zホールディングス	207,700	690.10	143,333,770
トレンドマイクロ	8,100	5,660.00	45,846,000
IDホールディングス	600	1,238.00	742,800
日本オラクル	3,100	13,170.00	40,827,000
アルファシステムズ	500	3,530.00	1,765,000
フューチャー	1,800	1,816.00	3,268,800
CAC Holdings	1,000	1,391.00	1,391,000
SBテクノロジー	500	3,490.00	1,745,000
トーセ	400	797.00	318,800
オービックビジネスコンサルタント	1,500	6,910.00	10,365,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,900	3,725.00	25,702,500
アイティフォー	1,800	966.00	1,738,800
東計電算	200	4,210.00	842,000
エクスネット	200	985.00	197,000
大塚商会	8,200	5,300.00	43,460,000
サイボウズ	1,800	2,767.00	4,980,600
電通国際情報サービス	1,900	3,950.00	7,505,000
ACCESS	1,400	777.00	1,087,800
デジタルガレージ	2,700	3,775.00	10,192,500
EMシステムズ	2,100	981.00	2,060,100
ウェザーニューズ	500	5,170.00	2,585,000
CIJ	1,000	880.00	880,000
ビジネスエンジニアリング	200	3,210.00	642,000
日本エンタープライズ	1,500	234.00	351,000
WOWOW	700	2,845.00	1,991,500
スカラ	1,000	847.00	847,000
インテリジェント ウェイブ	900	730.00	657,000
IMAGICA GROUP	1,300	402.00	522,600
ネットワンシステムズ	5,800	3,815.00	22,127,000

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	3,095.00	4,023,500	
マーベラス	2,300	1,002.00	2,304,600	
エイベックス	2,600	1,321.00	3,434,600	
日本ユニシス	4,700	4,015.00	18,870,500	
兼松エレクトロニクス	800	4,015.00	3,212,000	
都築電気	500	1,693.00	846,500	
TBSホールディングス	9,200	1,925.00	17,710,000	
日本テレビホールディングス	12,600	1,153.00	14,527,800	
朝日放送グループホールディングス	1,500	698.00	1,047,000	
テレビ朝日ホールディングス	4,200	1,879.00	7,891,800	
スカパーJSATホールディングス	9,900	475.00	4,702,500	
テレビ東京ホールディングス	1,200	2,330.00	2,796,000	
日本BS放送	500	1,159.00	579,500	
ビジョン	1,900	969.00	1,841,100	
スマートパリュウ	400	929.00	371,600	
USEN-NEXT HOLDINGS	600	1,936.00	1,161,600	
ワイヤレスゲート	600	677.00	406,200	
コネクシオ	900	1,396.00	1,256,400	
日本通信	11,800	184.00	2,171,200	
クロップス	300	744.00	223,200	
日本電信電話	202,100	2,740.00	553,754,000	
KDDI	110,200	3,260.00	359,252,000	
ソフトバンク	137,400	1,343.50	184,596,900	
光通信	1,600	22,220.00	35,552,000	
エムティーアイ	1,500	823.00	1,234,500	
GMOインターネット	5,400	3,105.00	16,767,000	
ファイバーゲート	500	2,162.00	1,081,000	
アйдママーケティングコミュニケーション	500	448.00	224,000	
KADOKAWA	4,100	3,490.00	14,309,000	
学研ホールディングス	2,000	1,675.00	3,350,000	
ゼンリン	3,000	1,186.00	3,558,000	
昭文社ホールディングス	700	463.00	324,100	
インプレスホールディングス	1,300	187.00	243,100	
アイネット	800	1,599.00	1,279,200	
松竹	1,000	14,240.00	14,240,000	

東宝	8,900	3,950.00	35,155,000
東映	600	17,490.00	10,494,000
エヌ・ティ・ティ・データ	40,300	1,510.00	60,853,000
ピー・シー・エー	300	4,650.00	1,395,000
ビジネスブレイン太田昭和	500	1,603.00	801,500
D T S	3,400	2,098.00	7,133,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,400	5,900.00	37,760,000
シーイーシー	1,600	1,479.00	2,366,400
カブコン	7,100	7,200.00	51,120,000
アイ・エス・ピー	700	1,387.00	970,900
ジャステック	1,000	1,211.00	1,211,000
S C S K	3,500	5,560.00	19,460,000
日本システムウエア	500	2,181.00	1,090,500
アイネス	1,500	1,424.00	2,136,000
T K C	1,300	7,190.00	9,347,000
富士ソフト	1,600	5,210.00	8,336,000
N S D	4,900	2,042.00	10,005,800
コナミホールディングス	5,500	6,620.00	36,410,000
福井コンピュータホールディングス	600	3,820.00	2,292,000
J B C Cホールディングス	1,000	1,590.00	1,590,000
ミロク情報サービス	1,300	2,080.00	2,704,000
ソフトバンクグループ	120,000	8,664.00	1,039,680,000
ハウスイ	100	1,004.00	100,400
高千穂交易	600	1,219.00	731,400
オルパヘルスケアホールディングス	200	1,515.00	303,000
伊藤忠食品	400	5,270.00	2,108,000
エレマテック	1,400	1,002.00	1,402,800
J A L U X	400	1,400.00	560,000
あらた	1,200	4,615.00	5,538,000
トーメンデバイス	200	3,650.00	730,000
東京エレクトロン デバイス	500	3,515.00	1,757,500
フィールズ	1,200	518.00	621,600
双日	83,800	248.00	20,782,400
アルフレッサ ホールディングス	16,900	2,017.00	34,087,300
横浜冷凍	4,000	874.00	3,496,000
神栄	200	1,803.00	360,600

ラサ商事	800	900.00	720,000	
アルコニックス	1,600	1,680.00	2,688,000	
神戸物産	10,500	3,035.00	31,867,500	
ハイパー	200	534.00	106,800	
あい ホールディングス	2,200	2,042.00	4,492,400	
ディーブイエックス	500	1,018.00	509,000	
ダイワボウホールディングス	1,300	8,890.00	11,557,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,600	2,175.00	7,830,000	
ラクト・ジャパン	700	2,666.00	1,866,200	
グリムス	300	1,717.00	515,100	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,900	797.00	2,311,300	
八洲電機	1,200	980.00	1,176,000	
メディアスホールディングス	900	799.00	719,100	
レスターホールディングス	1,600	2,160.00	3,456,000	
ジューテックホールディングス	300	1,035.00	310,500	
大光	600	669.00	401,400	
OCHIホールディングス	400	1,313.00	525,200	
TOKAIホールディングス	8,000	976.00	7,808,000	
黒谷	400	752.00	300,800	
Cominix	300	763.00	228,900	
三洋貿易	1,500	1,000.00	1,500,000	
ビューティガレージ	200	2,445.00	489,000	
ウイン・パートナーズ	1,100	1,126.00	1,238,600	
ミタチ産業	500	600.00	300,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,400	6,110.00	14,664,000	
明治電機工業	500	1,570.00	785,000	
デリカフーズホールディングス	500	619.00	309,500	
スターティアホールディングス	300	1,026.00	307,800	
コメダホールディングス	3,300	1,891.00	6,240,300	
ピーバンドットコム	200	1,161.00	232,200	
アセンテック	300	1,966.00	589,800	
富士興産	500	1,139.00	569,500	
協栄産業	200	1,345.00	269,000	
小野建	1,400	1,241.00	1,737,400	
南陽	300	1,648.00	494,400	
佐島電機	1,000	775.00	775,000	

エコトレーディング	300	655.00	196,500	
伯東	900	1,178.00	1,060,200	
コンドーテック	1,200	1,073.00	1,287,600	
中山福	900	548.00	493,200	
ナガイレーベン	2,000	3,020.00	6,040,000	
三菱食品	1,700	2,851.00	4,846,700	
松田産業	1,100	1,893.00	2,082,300	
第一興商	2,300	3,510.00	8,073,000	
メディバルホールディングス	16,400	2,041.00	33,472,400	
S P K	700	1,251.00	875,700	
萩原電気ホールディングス	600	2,567.00	1,540,200	
アズワン	1,000	16,480.00	16,480,000	
スズデン	500	1,230.00	615,000	
尾家産業	400	1,273.00	509,200	
シモジマ	900	1,379.00	1,241,100	
ドウシシャ	1,400	1,975.00	2,765,000	
小津産業	300	1,906.00	571,800	
高速	900	1,499.00	1,349,100	
たけびし	500	1,582.00	791,000	
リックス	300	1,525.00	457,500	
丸文	1,300	551.00	716,300	
ハビネット	1,300	1,644.00	2,137,200	
橋本総業ホールディングス	300	2,587.00	776,100	
日本ライフライン	4,500	1,533.00	6,898,500	
タカショー	1,000	797.00	797,000	
マルカ	500	1,910.00	955,000	
I D O M	4,100	634.00	2,599,400	
進和	900	2,118.00	1,906,200	
エスケイジャパン	300	466.00	139,800	
ダイترون	600	1,645.00	987,000	
シークス	1,900	1,663.00	3,159,700	
田中商事	500	699.00	349,500	
オーハシテクニカ	800	1,412.00	1,129,600	
白銅	500	1,421.00	710,500	
ダイコー通産	100	1,589.00	158,900	
伊藤忠商事	106,200	3,130.00	332,406,000	

丸紅	158,000	718.50	113,523,000	
高島	200	1,662.00	332,400	
長瀬産業	8,500	1,568.00	13,328,000	
蝶理	1,000	1,572.00	1,572,000	
豊田通商	16,900	4,280.00	72,332,000	
三共生興	2,300	470.00	1,081,000	
兼松	5,700	1,340.00	7,638,000	
ツカモトコーポレーション	300	1,586.00	475,800	
三井物産	131,400	2,037.00	267,661,800	
日本紙パルプ商事	900	3,515.00	3,163,500	
カメイ	2,000	1,204.00	2,408,000	
東都水産	200	3,640.00	728,000	
OUGホールディングス	200	2,815.00	563,000	
スターゼン	600	4,195.00	2,517,000	
山善	5,900	1,003.00	5,917,700	
椿本興業	300	3,490.00	1,047,000	
住友商事	95,800	1,439.00	137,856,200	
内田洋行	600	4,135.00	2,481,000	
三菱商事	99,500	2,707.50	269,396,250	
第一実業	700	4,100.00	2,870,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,800	2,424.00	9,211,200	
西華産業	900	1,357.00	1,221,300	
佐藤商事	1,300	914.00	1,188,200	
菱洋エレクトロ	1,500	3,420.00	5,130,000	
東京産業	1,400	614.00	859,600	
ユアサ商事	1,400	3,215.00	4,501,000	
神鋼商事	400	1,832.00	732,800	
トルク	900	247.00	222,300	
阪和興業	2,800	2,786.00	7,800,800	
正栄食品工業	1,000	3,715.00	3,715,000	
カナデン	1,200	1,275.00	1,530,000	
菱電商事	1,100	1,594.00	1,753,400	
フルサト工業	800	1,295.00	1,036,000	
岩谷産業	3,900	6,970.00	27,183,000	
ナイス	600	1,509.00	905,400	
昭光通商	500	647.00	323,500	

ニチモウ	200	1,844.00	368,800	
極東貿易	400	1,396.00	558,400	
イワキ	2,000	688.00	1,376,000	
三愛石油	3,700	1,125.00	4,162,500	
稲畑産業	3,300	1,481.00	4,887,300	
G S I クレオス	400	1,908.00	763,200	
明和産業	1,400	457.00	639,800	
クワザワホールディングス	500	623.00	311,500	
ヤマエ久野	1,100	1,072.00	1,179,200	
ワキタ	3,200	975.00	3,120,000	
東邦ホールディングス	4,900	1,959.00	9,599,100	
サンゲツ	4,100	1,561.00	6,400,100	
ミツウロコグループホールディングス	2,200	1,375.00	3,025,000	
シナネンホールディングス	600	3,020.00	1,812,000	
伊藤忠エネクス	3,400	1,037.00	3,525,800	
サンリオ	4,300	1,554.00	6,682,200	
サンワテクノス	1,100	1,069.00	1,175,900	
リョーサン	1,700	2,084.00	3,542,800	
新光商事	2,300	746.00	1,715,800	
トーホー	700	1,827.00	1,278,900	
三信電気	800	1,883.00	1,506,400	
東陽テクニカ	1,600	1,200.00	1,920,000	
モスフードサービス	2,000	3,065.00	6,130,000	
加賀電子	1,500	2,339.00	3,508,500	
ソーダニッカ	1,600	528.00	844,800	
立花エレテック	1,100	1,599.00	1,758,900	
フォーバル	700	790.00	553,000	
P A L T A C	2,400	5,570.00	13,368,000	
三谷産業	2,000	443.00	886,000	
太平洋興発	600	640.00	384,000	
西本W i s m e t t a cホールディングス	300	2,461.00	738,300	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,564.00	156,400	
コア商事ホールディングス	300	1,390.00	417,000	
国際紙バルブ商事	3,600	240.00	864,000	
ヤマタネ	800	1,368.00	1,094,400	
丸紅建材リース	100	1,723.00	172,300	

日鉄物産	1,100	3,650.00	4,015,000	
泉州電業	400	3,220.00	1,288,000	
トラスコ中山	3,500	2,644.00	9,254,000	
オートバックスセブン	5,600	1,419.00	7,946,400	
モリト	1,100	609.00	669,900	
加藤産業	2,200	3,475.00	7,645,000	
北恵	400	897.00	358,800	
イノテック	800	1,315.00	1,052,000	
イエローハット	2,900	1,682.00	4,877,800	
J Kホールディングス	1,400	809.00	1,132,600	
日伝	1,400	2,209.00	3,092,600	
北沢産業	1,100	271.00	298,100	
杉本商事	800	2,302.00	1,841,600	
因幡電機産業	4,300	2,483.00	10,676,900	
東テク	500	2,772.00	1,386,000	
ミスミグループ本社	19,000	3,210.00	60,990,000	
アルテック	1,100	280.00	308,000	
タキヒヨー	500	1,902.00	951,000	
蔵王産業	300	1,354.00	406,200	
スズケン	6,400	3,955.00	25,312,000	
ジェコス	1,000	960.00	960,000	
グローセル	1,500	505.00	757,500	
ローソン	3,800	4,850.00	18,430,000	
サンエー	1,300	4,085.00	5,310,500	
カワチ薬品	1,200	3,015.00	3,618,000	
エービーシー・マート	2,400	5,920.00	14,208,000	
ハードオフコーポレーション	600	768.00	460,800	
アスクル	1,600	3,755.00	6,008,000	
ゲオホールディングス	2,700	1,200.00	3,240,000	
アダストリア	2,100	1,899.00	3,987,900	
ジーフット	900	416.00	374,400	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	200	401.00	80,200	
くら寿司	900	6,290.00	5,661,000	
キャンドウ	700	1,866.00	1,306,200	
パルグループホールディングス	1,500	1,472.00	2,208,000	
エディオン	7,000	1,021.00	7,147,000	

サーラコーポレーション	3,100	571.00	1,770,100
ワッツ	700	882.00	617,400
ハローズ	600	3,375.00	2,025,000
フジオフードグループ本社	1,300	1,223.00	1,589,900
あみやき亭	300	2,856.00	856,800
ひらまつ	2,800	145.00	406,000
大黒天物産	400	5,780.00	2,312,000
ハニーズホールディングス	1,300	998.00	1,297,400
ファーマライズホールディングス	400	775.00	310,000
アルペン	1,200	2,358.00	2,829,600
ハブ	400	622.00	248,800
クオールホールディングス	2,200	1,152.00	2,534,400
ジinzホールディングス	800	6,850.00	5,480,000
ビックカメラ	9,000	1,137.00	10,233,000
D C Mホールディングス	9,300	1,082.00	10,062,600
ペッパーフードサービス	1,600	250.00	400,000
Monotaro	10,800	5,230.00	56,484,000
東京一番フーズ	400	575.00	230,000
D Dホールディングス	600	584.00	350,400
きちりホールディングス	400	576.00	230,400
アークランドサービスホールディングス	1,300	2,118.00	2,753,400
J . フロント リテイリング	18,100	863.00	15,620,300
ドトール・日レスホールディングス	2,200	1,562.00	3,436,400
マツモトキヨシホールディングス	6,300	4,285.00	26,995,500
ブロンコビリー	800	2,201.00	1,760,800
Z O Z O	10,400	3,045.00	31,668,000
トレジャー・ファクトリー	400	730.00	292,000
物語コーポレーション	400	11,300.00	4,520,000
ココカラファイン	1,600	7,040.00	11,264,000
三越伊勢丹ホールディングス	26,500	617.00	16,350,500
H a m e e	500	1,782.00	891,000
ウエルシアホールディングス	9,000	3,625.00	32,625,000
クリエイトSDホールディングス	2,600	3,430.00	8,918,000
丸善C H Iホールディングス	1,800	373.00	671,400
ミサワ	300	740.00	222,000
ティーライフ	200	1,164.00	232,800

エー・ピーホールディングス	300	396.00	118,800	
チムニー	500	1,231.00	615,500	
シュッピン	1,000	933.00	933,000	
オイシックス・ラ・大地	1,500	3,290.00	4,935,000	
ネクステージ	2,600	1,393.00	3,621,800	
ジョイフル本田	4,400	1,426.00	6,274,400	
鳥貴族	400	1,471.00	588,400	
ホットランド	1,100	1,213.00	1,334,300	
すかいらくホールディングス	17,000	1,657.00	28,169,000	
SFPホールディングス	900	1,357.00	1,221,300	
綿半ホールディングス	1,100	1,418.00	1,559,800	
ヨシックス	200	2,040.00	408,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,400	1,124.00	4,945,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	800	877.00	701,600	
B E E N O S	700	2,433.00	1,703,100	
あさひ	1,100	1,649.00	1,813,900	
日本調剤	900	1,504.00	1,353,600	
コスモス薬品	1,300	16,250.00	21,125,000	
トーエル	700	831.00	581,700	
オンリー	300	459.00	137,700	
セブン&アイ・ホールディングス	59,400	4,005.00	237,897,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,200	726.00	5,953,200	
ツルハホールディングス	3,300	14,070.00	46,431,000	
サンマルクホールディングス	1,200	1,491.00	1,789,200	
フェリシモ	300	1,327.00	398,100	
トリドールホールディングス	3,800	1,487.00	5,650,600	
T O K Y O B A S E	1,400	462.00	646,800	
ウイルプラスホールディングス	200	808.00	161,600	
J Mホールディングス	1,100	2,113.00	2,324,300	
サツドラホールディングス	200	2,026.00	405,200	
アレンザホールディングス	800	1,290.00	1,032,000	
串カツ田中ホールディングス	400	1,577.00	630,800	
パロックジャパンリミテッド	1,100	759.00	834,900	
クスリのアオキホールディングス	1,400	8,550.00	11,970,000	
力の源ホールディングス	700	591.00	413,700	

スシローグローバルホールディングス	8,300	3,870.00	32,121,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	618.00	927,000	
はるやまホールディングス	700	677.00	473,900	
ノジマ	2,700	2,883.00	7,784,100	
カッパ・クリエイト	2,100	1,502.00	3,154,200	
ライトオン	1,100	604.00	664,400	
ジーンズメイト	500	282.00	141,000	
良品計画	20,200	2,407.00	48,621,400	
三城ホールディングス	1,600	317.00	507,200	
アドヴァン	2,300	1,148.00	2,640,400	
アルビス	600	2,448.00	1,468,800	
コナカ	1,800	309.00	556,200	
ハウス オブ ローゼ	200	1,677.00	335,400	
G-7ホールディングス	900	2,533.00	2,279,700	
イオン北海道	2,000	998.00	1,996,000	
コジマ	2,600	645.00	1,677,000	
ヒマラヤ	500	974.00	487,000	
コーナン商事	2,200	2,896.00	6,371,200	
エコス	600	1,911.00	1,146,600	
ワタミ	1,800	967.00	1,740,600	
マルシェ	400	494.00	197,600	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	33,400	2,278.00	76,085,200	
西松屋チェーン	3,300	1,409.00	4,649,700	
ゼンショーホールディングス	7,300	2,892.00	21,111,600	
幸楽苑ホールディングス	1,000	1,694.00	1,694,000	
ハークスレイ	300	896.00	268,800	
サイゼリヤ	2,300	2,068.00	4,756,400	
V Tホールディングス	6,300	431.00	2,715,300	
魚力	400	1,859.00	743,600	
ポプラ	400	352.00	140,800	
フジ・コーポレーション	400	2,132.00	852,800	
ユナイテッドアローズ	1,600	1,533.00	2,452,800	
ハイデイ日高	2,200	1,705.00	3,751,000	
京都きもの友禅	1,000	211.00	211,000	
コロワイド	5,000	1,828.00	9,140,000	

ピーシーデボコーポレーション	2,000	574.00	1,148,000	
壱番屋	1,100	5,160.00	5,676,000	
トップカルチャー	600	354.00	212,400	
P L A N T	400	739.00	295,600	
スギホールディングス	3,000	7,280.00	21,840,000	
薬王堂ホールディングス	700	2,606.00	1,824,200	
ヴィア・ホールディングス	1,900	248.00	471,200	
スクロール	2,300	894.00	2,056,200	
ヨンドシーホールディングス	1,500	1,917.00	2,875,500	
木曽路	2,000	2,397.00	4,794,000	
S R S ホールディングス	1,800	835.00	1,503,000	
千趣会	2,800	323.00	904,400	
タカキュー	1,300	150.00	195,000	
リテールパートナーズ	2,000	1,364.00	2,728,000	
ケーヨー	3,100	757.00	2,346,700	
上新電機	1,800	2,838.00	5,108,400	
日本瓦斯	2,300	5,060.00	11,638,000	
ロイヤルホールディングス	2,600	1,818.00	4,726,800	
東天紅	100	899.00	89,900	
いなげや	1,900	1,757.00	3,338,300	
島忠	2,900	5,480.00	15,892,000	
チヨダ	1,600	891.00	1,425,600	
ライフコーポレーション	1,200	3,280.00	3,936,000	
リンガーハット	1,900	2,363.00	4,489,700	
M r M a x H D	2,100	742.00	1,558,200	
テンアライド	1,400	332.00	464,800	
A O K I ホールディングス	3,000	537.00	1,611,000	
オークワ	2,400	1,261.00	3,026,400	
コメリ	2,300	2,944.00	6,771,200	
青山商事	3,100	616.00	1,909,600	
しまむら	1,800	11,600.00	20,880,000	
はせがわ	800	289.00	231,200	
高島屋	11,100	937.00	10,400,700	
松屋	3,100	828.00	2,566,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,200	705.00	5,076,000	
近鉄百貨店	600	3,115.00	1,869,000	

丸井グループ	13,900	1,785.00	24,811,500
アクシアル リテイリング	1,300	5,110.00	6,643,000
井筒屋	900	201.00	180,900
イオン	58,400	3,361.00	196,282,400
イズミ	3,100	3,755.00	11,640,500
平和堂	3,100	2,171.00	6,730,100
フジ	1,800	1,996.00	3,592,800
ヤオコー	1,700	6,710.00	11,407,000
ゼビオホールディングス	1,800	861.00	1,549,800
ケーズホールディングス	14,600	1,438.00	20,994,800
Olympicグループ	800	918.00	734,400
日産東京販売ホールディングス	2,300	256.00	588,800
シルバーライフ	200	2,108.00	421,600
一家ダイニングプロジェクト	200	544.00	108,800
Genky DrugStores	700	3,995.00	2,796,500
ナルミヤ・インターナショナル	300	965.00	289,500
ブックオフグループホールディングス	900	842.00	757,800
ギフト	100	1,991.00	199,100
アインホールディングス	1,900	6,510.00	12,369,000
元気寿司	400	2,421.00	968,400
ヤマダホールディングス	46,200	539.00	24,901,800
アークランドサカモト	2,400	1,548.00	3,715,200
ニトリホールディングス	6,600	21,735.00	143,451,000
グルメ軒屋	1,100	970.00	1,067,000
愛眼	1,200	229.00	274,800
ケーユーホールディングス	800	834.00	667,200
吉野家ホールディングス	5,000	2,137.00	10,685,000
松屋フーズホールディングス	700	3,500.00	2,450,000
サガミホールディングス	2,000	1,185.00	2,370,000
関西スーパーマーケット	1,300	1,132.00	1,471,600
王将フードサービス	1,100	5,810.00	6,391,000
プレナス	1,700	1,950.00	3,315,000
ミニストップ	1,100	1,419.00	1,560,900
アークス	3,100	2,307.00	7,151,700
パローホールディングス	3,400	2,470.00	8,398,000
藤久	300	787.00	236,100

ベルク	700	5,780.00	4,046,000	
大庄	800	976.00	780,800	
ファーストリテイリング	2,000	94,000.00	188,000,000	
サンドラッグ	5,700	4,050.00	23,085,000	
サクスパー ホールディングス	1,300	561.00	729,300	
ヤマザワ	400	1,739.00	695,600	
やまや	300	2,173.00	651,900	
ペルーナ	3,300	1,183.00	3,903,900	
島根銀行	400	661.00	264,400	
じもとホールディングス	1,000	817.00	817,000	
めぶきフィナンシャルグループ	79,000	210.00	16,590,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,100	1,115.00	2,341,500	
九州フィナンシャルグループ	33,300	424.00	14,119,200	
ゆうちょ銀行	43,100	899.00	38,746,900	
富山第一銀行	3,600	289.00	1,040,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	86,800	393.00	34,112,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,100	653.00	6,595,300	
関西みらいフィナンシャルグループ	10,100	517.00	5,221,700	
三十三フィナンシャルグループ	1,400	1,263.00	1,768,200	
第四北越フィナンシャルグループ	2,600	2,231.00	5,800,600	
ひろぎんホールディングス	22,400	622.00	13,932,800	
新生銀行	11,200	1,329.00	14,884,800	
あおぞら銀行	9,100	1,946.00	17,708,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,039,800	480.00	499,104,000	
りそなホールディングス	166,700	372.60	62,112,420	
三井住友トラスト・ホールディングス	28,700	3,170.00	90,979,000	
三井住友フィナンシャルグループ	105,100	3,316.00	348,511,600	
千葉銀行	50,700	585.00	29,659,500	
群馬銀行	29,200	325.00	9,490,000	
武蔵野銀行	2,300	1,547.00	3,558,100	
千葉興業銀行	4,200	240.00	1,008,000	
筑波銀行	6,400	181.00	1,158,400	
七十七銀行	5,100	1,374.00	7,007,400	
青森銀行	1,200	2,426.00	2,911,200	
秋田銀行	1,000	1,389.00	1,389,000	
山形銀行	1,700	1,012.00	1,720,400	

岩手銀行	1,000	1,951.00	1,951,000	
東邦銀行	13,600	203.00	2,760,800	
東北銀行	700	1,094.00	765,800	
みちのく銀行	1,000	1,012.00	1,012,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,800	1,922.00	24,601,600	
静岡銀行	37,000	774.00	28,638,000	
十六銀行	1,900	1,881.00	3,573,900	
スルガ銀行	15,600	317.00	4,945,200	
八十二銀行	36,700	338.00	12,404,600	
山梨中央銀行	1,800	795.00	1,431,000	
大垣共立銀行	3,000	2,010.00	6,030,000	
福井銀行	1,300	1,907.00	2,479,100	
北國銀行	1,500	2,508.00	3,762,000	
清水銀行	600	1,702.00	1,021,200	
富山銀行	300	2,821.00	846,300	
滋賀銀行	3,000	1,964.00	5,892,000	
南都銀行	2,500	1,702.00	4,255,000	
百五銀行	13,700	290.00	3,973,000	
京都銀行	5,400	5,640.00	30,456,000	
紀陽銀行	5,400	1,372.00	7,408,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,100	951.00	9,605,100	
山陰合同銀行	9,000	490.00	4,410,000	
中国銀行	13,100	822.00	10,768,200	
鳥取銀行	500	1,116.00	558,000	
伊予銀行	21,700	614.00	13,323,800	
百十四銀行	1,600	1,483.00	2,372,800	
四国銀行	2,300	666.00	1,531,800	
阿波銀行	2,500	2,215.00	5,537,500	
大分銀行	900	2,040.00	1,836,000	
宮崎銀行	1,000	2,219.00	2,219,000	
佐賀銀行	900	1,314.00	1,182,600	
沖縄銀行	1,400	2,700.00	3,780,000	
琉球銀行	3,500	740.00	2,590,000	
セブン銀行	50,800	230.00	11,684,000	
みずほフィナンシャルグループ	206,500	1,392.50	287,551,250	
高知銀行	600	696.00	417,600	

山口フィナンシャルグループ	19,000	609.00	11,571,000	
長野銀行	500	1,246.00	623,000	
名古屋銀行	1,100	2,707.00	2,977,700	
北洋銀行	22,900	212.00	4,854,800	
愛知銀行	500	2,861.00	1,430,500	
中京銀行	600	1,917.00	1,150,200	
大光銀行	500	1,268.00	634,000	
愛媛銀行	2,100	971.00	2,039,100	
トマト銀行	600	1,023.00	613,800	
京葉銀行	6,500	407.00	2,645,500	
栃木銀行	7,400	172.00	1,272,800	
北日本銀行	500	1,891.00	945,500	
東和銀行	2,700	669.00	1,806,300	
福島銀行	1,400	210.00	294,000	
大東銀行	800	634.00	507,200	
トモニホールディングス	11,800	306.00	3,610,800	
フィデアホールディングス	14,900	108.00	1,609,200	
池田泉州ホールディングス	17,500	151.00	2,642,500	
F P G	4,700	498.00	2,340,600	
ジャパンインベストメントアドバイザー	800	1,182.00	945,600	
マーキュリアインベストメント	600	727.00	436,200	
S B Iホールディングス	17,500	2,700.00	47,250,000	
日本アジア投資	1,300	240.00	312,000	
ジャフコ グループ	2,300	5,450.00	12,535,000	
大和証券グループ本社	122,000	499.10	60,890,200	
野村ホールディングス	267,500	563.00	150,602,500	
岡三証券グループ	13,000	404.00	5,252,000	
丸三証券	4,500	524.00	2,358,000	
東洋証券	5,500	143.00	786,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	17,500	323.00	5,652,500	
光世証券	400	639.00	255,600	
水戸証券	4,400	268.00	1,179,200	
いちよし証券	2,800	506.00	1,416,800	
松井証券	8,700	820.00	7,134,000	
マネックスグループ	11,200	516.00	5,779,200	
極東証券	2,000	763.00	1,526,000	

岩井コスモホールディングス	1,400	1,450.00	2,030,000	
藍澤証券	2,700	807.00	2,178,900	
マネーパートナーズグループ	1,600	215.00	344,000	
スパークス・グループ	7,000	297.00	2,079,000	
小林洋行	500	272.00	136,000	
かんぽ生命保険	5,400	2,219.00	11,982,600	
S O M P Oホールディングス	28,600	4,223.00	120,777,800	
アニコム ホールディングス	5,100	1,157.00	5,900,700	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	39,700	3,112.00	123,546,400	
第一生命ホールディングス	86,000	1,636.00	140,696,000	
東京海上ホールディングス	53,700	5,409.00	290,463,300	
T & Dホールディングス	45,400	1,253.00	56,886,200	
アドバンスクリエイト	300	1,857.00	557,100	
全国保証	4,300	4,515.00	19,414,500	
ジェイリース	400	670.00	268,000	
イントラスト	500	817.00	408,500	
日本モーゲージサービス	600	1,225.00	735,000	
C a s a	500	992.00	496,000	
アルヒ	2,400	1,722.00	4,132,800	
プレミアグループ	800	2,374.00	1,899,200	
クレディセゾン	10,600	1,218.00	12,910,800	
芙蓉総合リース	1,600	7,220.00	11,552,000	
みずほリース	2,300	3,255.00	7,486,500	
東京センチュリー	3,100	9,220.00	28,582,000	
日本証券金融	6,700	520.00	3,484,000	
アイフル	23,200	265.00	6,148,000	
リコーリース	1,200	3,120.00	3,744,000	
イオンフィナンシャルサービス	9,300	1,299.00	12,080,700	
アコム	30,600	467.00	14,290,200	
ジャックス	1,700	1,929.00	3,279,300	
オリエントコーポレーション	41,100	122.00	5,014,200	
日立キャピタル	3,600	2,659.00	9,572,400	
オリックス	94,300	1,737.00	163,799,100	
三菱UFJリース	38,600	530.00	20,458,000	
九州リースサービス	700	616.00	431,200	

日本取引所グループ	43,600	2,656.50	115,823,400	
イー・ギャランティ	1,700	2,342.00	3,981,400	
アサックス	800	731.00	584,800	
NECキャピタルソリューション	600	1,973.00	1,183,800	
いちご	19,300	284.00	5,481,200	
日本駐車場開発	15,100	137.00	2,068,700	
スター・マイカ・ホールディングス	800	1,144.00	915,200	
ADワークスグループ	2,900	156.00	452,400	
ヒューリック	32,200	1,132.00	36,450,400	
三栄建築設計	600	1,827.00	1,096,200	
野村不動産ホールディングス	9,200	2,225.00	20,470,000	
三重交通グループホールディングス	3,100	483.00	1,497,300	
サムティ	2,200	1,632.00	3,590,400	
ディア・ライフ	2,100	439.00	921,900	
コーセーアールイー	400	664.00	265,600	
日本商業開発	1,000	1,709.00	1,709,000	
プレサンスコーポレーション	2,500	1,486.00	3,715,000	
THEグローバル社	700	253.00	177,100	
ハウスコム	300	1,350.00	405,000	
日本管理センター	800	1,197.00	957,600	
サンセイランディック	400	737.00	294,800	
エストラスト	200	711.00	142,200	
フージャースホールディングス	3,000	672.00	2,016,000	
オープンハウス	4,800	4,205.00	20,184,000	
東急不動産ホールディングス	41,300	568.00	23,458,400	
飯田グループホールディングス	12,700	2,373.00	30,137,100	
イーランド	200	835.00	167,000	
ムゲンエステート	900	453.00	407,700	
ビーロッド	700	619.00	433,300	
ファーストブラザーズ	300	989.00	296,700	
ハウズドゥ	700	1,218.00	852,600	
シーアールイー	400	1,320.00	528,000	
プロパティエージェント	200	1,340.00	268,000	
ケイアイスター不動産	500	2,685.00	1,342,500	
アグレ都市デザイン	200	683.00	136,600	
グッドコムアセット	700	1,316.00	921,200	

ジェイ・エス・ピー	300	3,580.00	1,074,000	
テンポイノベーション	300	897.00	269,100	
グローバル・リンク・マネジメント	300	716.00	214,800	
パーク24	8,200	1,965.00	16,113,000	
パラカ	400	1,597.00	638,800	
三井不動産	73,900	2,054.50	151,827,550	
三菱地所	106,500	1,645.50	175,245,750	
平和不動産	2,800	3,690.00	10,332,000	
東京建物	15,000	1,452.00	21,780,000	
ダイビル	3,900	1,215.00	4,738,500	
京阪神ビルディング	2,400	1,687.00	4,048,800	
住友不動産	34,200	3,089.00	105,643,800	
テオーシー	3,000	724.00	2,172,000	
東京楽天地	200	4,340.00	868,000	
レオパレス21	19,900	149.00	2,965,100	
スターツコーポレーション	2,100	2,723.00	5,718,300	
フジ住宅	1,800	633.00	1,139,400	
空港施設	1,500	479.00	718,500	
明和地所	800	583.00	466,400	
ゴールドクレスト	1,200	1,687.00	2,024,400	
エスリード	600	1,525.00	915,000	
日神グループホールディングス	2,200	421.00	926,200	
日本エスコン	2,800	789.00	2,209,200	
タカラレーベン	7,000	317.00	2,219,000	
A V A N T I A	900	863.00	776,700	
イオンモール	7,600	1,713.00	13,018,800	
毎日コムネット	400	676.00	270,400	
ファースト住建	600	1,078.00	646,800	
ランド	83,500	9.00	751,500	
カチタス	3,800	3,370.00	12,806,000	
トーセイ	2,100	991.00	2,081,100	
穴吹興産	300	1,626.00	487,800	
サンフロンティア不動産	2,100	889.00	1,866,900	
エフ・ジェー・ネクスト	1,300	1,025.00	1,332,500	
インテリックス	400	552.00	220,800	
ランドビジネス	500	333.00	166,500	

サンネクスタグループ	500	945.00	472,500
グランディハウス	1,200	423.00	507,600
日本空港ビルデング	4,900	5,700.00	27,930,000
明豊ファシリティワークス	700	636.00	445,200
日本工営	1,000	2,718.00	2,718,000
L I F U L L	5,100	366.00	1,866,600
ミクシィ	2,800	2,523.00	7,064,400
ジェイエイシーリクルートメント	1,000	1,908.00	1,908,000
日本M&Aセンター	11,300	5,940.00	67,122,000
メンバーズ	400	2,695.00	1,078,000
中広	200	322.00	64,400
UTグループ	2,300	3,315.00	7,624,500
アイティメディア	600	2,199.00	1,319,400
タケエイ	1,600	1,410.00	2,256,000
E・Jホールディングス	600	1,020.00	612,000
ビーネックスグループ	1,800	1,225.00	2,205,000
コシダカホールディングス	3,500	417.00	1,459,500
アルトナー	400	899.00	359,600
パソナグループ	1,600	1,943.00	3,108,800
C D S	400	1,387.00	554,800
リンクアンドモチベーション	2,700	554.00	1,495,800
G C A	1,900	704.00	1,337,600
エス・エム・エス	4,600	4,155.00	19,113,000
サニーサイドアップグループ	500	619.00	309,500
パーソルホールディングス	14,700	1,965.00	28,885,500
リニカル	700	790.00	553,000
クックパッド	4,600	312.00	1,435,200
エスクリ	500	312.00	156,000
アイ・ケイ・ケイ	700	607.00	424,900
学情	500	1,340.00	670,000
スタジオアリス	700	2,023.00	1,416,100
シミックホールディングス	700	1,513.00	1,059,100
エプコ	400	948.00	379,200
N J S	400	1,998.00	799,200
総合警備保障	5,900	5,230.00	30,857,000
カカクコム	10,900	2,961.00	32,274,900

アイロムグループ	500	1,845.00	922,500	
セントケア・ホールディング	1,000	1,038.00	1,038,000	
サイネックス	200	702.00	140,400	
ルネサンス	800	937.00	749,600	
ディップ	2,000	2,575.00	5,150,000	
デジタルホールディングス	1,000	1,917.00	1,917,000	
新日本科学	1,600	739.00	1,182,400	
ツクイホールディングス	3,500	597.00	2,089,500	
キャリアデザインセンター	300	912.00	273,600	
ベネフィット・ワン	5,400	3,170.00	17,118,000	
エムスリー	32,500	10,565.00	343,362,500	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	264.00	316,800	
プラス	200	475.00	95,000	
アウトソーシング	8,400	1,341.00	11,264,400	
ウェルネット	1,500	457.00	685,500	
ワールドホールディングス	500	1,967.00	983,500	
ディー・エヌ・エー	6,200	1,956.00	12,127,200	
博報堂D Yホールディングス	20,500	1,472.00	30,176,000	
ぐるなび	2,600	546.00	1,419,600	
タカミヤ	1,600	560.00	896,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,200	854.00	1,024,800	
ファンコミュニケーションズ	4,000	409.00	1,636,000	
ライク	500	2,004.00	1,002,000	
ビジネス・ブレークスルー	600	456.00	273,600	
エスプール	3,800	920.00	3,496,000	
WDBホールディングス	700	2,637.00	1,845,900	
手間いらず	100	4,855.00	485,500	
ティア	900	414.00	372,600	
C D G	200	1,512.00	302,400	
バリューコマース	1,000	3,230.00	3,230,000	
インフォマート	14,900	930.00	13,857,000	
J Pホールディングス	4,600	285.00	1,311,000	
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	2,000	1,024.00	2,048,000	
レッグス	400	1,656.00	662,400	
プレステージ・インターナショナル	5,500	917.00	5,043,500	

アミューズ	800	2,532.00	2,025,600	
ドリームインキュベータ	400	1,286.00	514,400	
クイック	900	1,113.00	1,001,700	
T A C	900	267.00	240,300	
ケネディクス	12,700	747.00	9,486,900	
電通グループ	16,600	3,160.00	52,456,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	600	582.00	349,200	
ぴあ	400	2,907.00	1,162,800	
イオンファンタジー	600	2,161.00	1,296,600	
シーティーエス	1,700	940.00	1,598,000	
ネクシィーズグループ	400	913.00	365,200	
H . U . グループホールディングス	4,100	3,160.00	12,956,000	
アルプス技研	1,300	2,147.00	2,791,100	
サニックス	2,600	351.00	912,600	
ダイオーズ	300	955.00	286,500	
日本空調サービス	1,500	736.00	1,104,000	
オリエンタルランド	15,700	16,230.00	254,811,000	
ダスキン	3,700	2,822.00	10,441,400	
明光ネットワークジャパン	1,900	586.00	1,113,400	
ファルコホールディングス	800	1,615.00	1,292,000	
秀英予備校	300	427.00	128,100	
田谷	300	546.00	163,800	
ラウンドワン	4,100	876.00	3,591,600	
リゾートトラスト	6,800	1,497.00	10,179,600	
ビー・エム・エル	1,900	3,670.00	6,973,000	
ワタベウェディング	200	282.00	56,400	
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,402.00	3,645,200	
リソー教育	6,700	301.00	2,016,700	
早稲田アカデミー	600	991.00	594,600	
ユー・エス・エス	16,500	2,100.00	34,650,000	
東京個別指導学院	500	669.00	334,500	
サイバーエージェント	9,100	7,590.00	69,069,000	
楽天	68,600	970.00	66,542,000	
クリーク・アンド・リバー社	800	1,177.00	941,600	
モーニングスター	1,600	490.00	784,000	
テー・オー・ダブリュー	2,400	275.00	660,000	

山田コンサルティンググループ	1,000	980.00	980,000	
セントラルスポーツ	500	2,138.00	1,069,000	
フルキャストホールディングス	1,300	1,708.00	2,220,400	
エン・ジャパン	2,600	3,145.00	8,177,000	
リソルホールディングス	200	3,805.00	761,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,900	8,440.00	24,476,000	
アトラ	300	336.00	100,800	
インターワークス	300	366.00	109,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	19,130.00	11,478,000	
K e e P e r 技研	1,100	2,069.00	2,275,900	
ファーストロジック	300	798.00	239,400	
三機サービス	300	990.00	297,000	
G u n o s y	900	749.00	674,100	
デザインワン・ジャパン	500	215.00	107,500	
イー・ガーディアン	600	3,160.00	1,896,000	
リブセンス	800	243.00	194,400	
ジャパンマテリアル	4,500	1,596.00	7,182,000	
ベクトル	1,800	1,378.00	2,480,400	
ウチヤマホールディングス	700	339.00	237,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,398.00	1,817,400	
キャリアリンク	500	2,574.00	1,287,000	
I B J	1,200	834.00	1,000,800	
アサント	600	1,602.00	961,200	
N・フィールド	1,000	864.00	864,000	
バリューHR	600	1,781.00	1,068,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,200	5,230.00	6,276,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	600	2,131.00	1,278,600	
E R Iホールディングス	400	614.00	245,600	
アビスト	200	2,946.00	589,200	
シグマクシス	1,000	1,782.00	1,782,000	
ウィルグループ	1,000	1,057.00	1,057,000	
エスクロー・エージェンツ・ジャパン	2,200	291.00	640,200	
メドピア	700	8,400.00	5,880,000	
レアジョブ	100	2,412.00	241,200	
リクルートホールディングス	105,500	4,673.00	493,001,500	
エラン	2,000	1,662.00	3,324,000	

土木管理総合試験所	700	342.00	239,400
ネットマーケティング	600	721.00	432,600
日本郵政	120,700	835.80	100,881,060
ベルシステム24ホールディングス	2,500	1,913.00	4,782,500
鎌倉新書	1,100	895.00	984,500
S MN	300	802.00	240,600
一蔵	200	350.00	70,000
L I T A L I C O	500	3,890.00	1,945,000
グローバルキッズCOMPANY	300	962.00	288,600
エアトリ	800	1,470.00	1,176,000
アトラエ	400	2,723.00	1,089,200
ストライク	600	4,755.00	2,853,000
ソラスト	4,100	1,649.00	6,760,900
セラク	500	1,896.00	948,000
インソース	1,200	1,951.00	2,341,200
ベйкаレント・コンサルティング	900	18,560.00	16,704,000
Orchestra Holdings	300	2,215.00	664,500
アイモバイル	500	1,286.00	643,000
キャリアインデックス	600	555.00	333,000
MS - Japan	500	1,156.00	578,000
船場	300	864.00	259,200
グレイステクノロジー	700	6,470.00	4,529,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	3,400	2,629.00	8,938,600
フルテック	200	1,397.00	279,400
グリーンズ	400	465.00	186,000
ツナググループ・ホールディングス	300	318.00	95,400
GameWith	400	572.00	228,800
ソウルドアウト	400	1,624.00	649,600
MS & Consulting	300	555.00	166,500
エル・ティー・エス	100	4,115.00	411,500
ミダック	200	3,135.00	627,000
日総工産	1,000	818.00	818,000
キュービーネットホールディングス	600	1,390.00	834,000
RPAホールディングス	1,100	632.00	695,200
スプリックス	400	803.00	321,200

マネジメントソリューションズ	700	1,934.00	1,353,800	
プロレド・パートナーズ	200	3,710.00	742,000	
and factory	100	757.00	75,700	
テノ・ホールディングス	100	1,250.00	125,000	
フロンティア・マネジメント	200	2,363.00	472,600	
ピアラ	100	2,090.00	209,000	
コプロ・ホールディングス	100	3,935.00	393,500	
ギークス	200	1,589.00	317,800	
カーブスホールディングス	4,000	816.00	3,264,000	
フォーラムエンジニアリング	800	924.00	739,200	
ダイレクトマーケティングミックス	600	3,490.00	2,094,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	700	656.00	459,200	
リログループ	8,100	2,541.00	20,582,100	
東祥	900	1,519.00	1,367,100	
エイチ・アイ・エス	2,100	1,739.00	3,651,900	
ラックランド	400	2,389.00	955,600	
共立メンテナンス	2,400	3,395.00	8,148,000	
イチネンホールディングス	1,600	1,253.00	2,004,800	
建設技術研究所	900	2,520.00	2,268,000	
スペース	1,000	790.00	790,000	
長大	600	1,581.00	948,600	
燦ホールディングス	600	1,144.00	686,400	
スバル興業	100	8,980.00	898,000	
東京テアトル	600	1,269.00	761,400	
タナベ経営	300	1,358.00	407,400	
ナガワ	500	9,910.00	4,955,000	
よみうりランド	300	6,030.00	1,809,000	
東京都競馬	1,000	4,460.00	4,460,000	
常磐興産	600	1,346.00	807,600	
カナモト	2,600	2,278.00	5,922,800	
東京ドーム	6,000	1,297.00	7,782,000	
西尾レントオール	1,400	2,226.00	3,116,400	
アゴーラ・ホスピタリティー・グループ	8,200	23.00	188,600	
トランス・コスモス	1,400	2,650.00	3,710,000	
乃村工藝社	6,300	806.00	5,077,800	
藤田観光	600	1,457.00	874,200	

KNT - CTホールディングス	900	923.00	830,700	
日本管財	1,600	2,012.00	3,219,200	
トーカイ	1,400	1,992.00	2,788,800	
白洋舎	200	2,405.00	481,000	
セコム	15,600	9,470.00	147,732,000	
セントラル警備保障	700	3,450.00	2,415,000	
丹青社	2,800	764.00	2,139,200	
メイテック	1,800	5,230.00	9,414,000	
応用地質	1,700	1,299.00	2,208,300	
船井総研ホールディングス	3,000	2,300.00	6,900,000	
進学会ホールディングス	600	479.00	287,400	
オオバ	1,000	734.00	734,000	
いであ	400	1,775.00	710,000	
学究社	400	1,325.00	530,000	
ベネッセホールディングス	4,900	2,040.00	9,996,000	
イオンディライト	1,800	2,726.00	4,906,800	
ナック	800	924.00	739,200	
ダイセキ	2,500	3,230.00	8,075,000	
ステップ	500	1,540.00	770,000	
合 計	16,340,400		39,757,682,500	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,797,173,967
コール・ローン	322,531,535
株式	67,279,123,884
投資証券	1,461,682,991
派生商品評価勘定	380,232,941
未収入金	154,703,000
未収配当金	47,662,731
差入委託証拠金	3,790,328,784
流動資産合計	85,233,439,833
資産合計	85,233,439,833
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,668,642
未払解約金	96,282,000
未払利息	874
その他未払費用	1
流動負債合計	97,951,517
負債合計	97,951,517
純資産の部	
元本等	
元本	53,970,185,829
剰余金	
剰余金又は欠損金()	31,165,302,487
元本等合計	85,135,488,316
純資産合計	85,135,488,316
負債純資産合計	85,233,439,833

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月28日
期首元本額	40,465,219,618円
期中追加設定元本額	63,567,187,120円
期中一部解約元本額	50,062,220,909円
期末元本額	53,970,185,829円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,902,849,412円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,460,819,835円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,752,507,172円
DCりそな グローバルバランス	50,787,586円
つみたてバランスファンド	1,467,771,171円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	843,463,974円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	434,589,358円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	260,684,865円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	37,955,470円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	26,960,815円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,929,008円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	18,337,110円
リスクコントロール・オープン	44,304,753円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	149,863,613円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	55,270,573円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	21,509,121,776円
Smart-i 先進国株式インデックス	4,294,463,552円
Smart-i 8資産バランス 安定型	136,723,311円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	315,210,195円
Smart-i 8資産バランス 成長型	336,666,625円

りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,100,939,318円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,116,113,240円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,234,910,116円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	736,871,952円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,864,511,815円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	311,278,815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)	6,783,721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)	223,700,231円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,205,908,561円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	57,887,886円
2. 計算日における受益権の総数	53,970,185,829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	1.5775円
(10,000口当たり純資産額)	(15,775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

2021年 1月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用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

2021年 1月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	8,543,473,599
投資証券	65,335,529
合計	8,478,138,070

(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)

(2021年 1月25日現在)

(単位：円)

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	15,376,010,210	-	15,753,550,643	377,540,433
合計		15,376,010,210	-	15,753,550,643	377,540,433

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2021年 1月25日現在)

(単位: 円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	379,010,559	-	380,038,940	1,028,381
	米ドル	270,613,382	-	271,307,790	694,408
	カナダドル	15,475,375	-	15,433,740	41,635
	ユーロ	33,007,525	-	33,235,310	227,785
	英ポンド	17,297,629	-	17,336,200	38,571
	スイスフラン	9,914,377	-	9,971,350	56,973
	スウェーデンク ローナ	2,445,814	-	2,464,470	18,656
	デンマーククロー ネ	4,066,537	-	4,094,590	28,053
	オーストラリアド ル	13,661,540	-	13,632,300	29,240
	ニュージーランド ドル	5,431,565	-	5,453,100	21,535
	香港ドル	7,096,815	-	7,110,090	13,275
	売建	628,466,205	-	628,470,720	4,515
	米ドル	473,672,460	-	473,672,460	-
	カナダドル	24,417,536	-	24,416,340	1,196
	ユーロ	53,197,981	-	53,201,770	3,789
	英ポンド	30,551,715	-	30,551,500	215
	スイスフラン	20,174,740	-	20,177,320	2,580

	スウェーデンク ローナ	2,814,975	-	2,814,750	225
	デンマーククロー ネ	4,722,386	-	4,723,220	834
	オーストラリアド ル	10,744,682	-	10,745,460	778
	香港ドル	8,169,730	-	8,167,900	1,830
	合計	1,007,476,764	-	1,008,509,660	1,023,866

(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	22.17	159,291.45	
	CABOT OIL & GAS CORP	5,423	18.54	100,542.42	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	66.00	165,924.00	
	CHEVRON CORP	26,491	91.73	2,430,019.43	
	CONOCOPHILLIPS	18,076	42.69	771,664.44	
	DEVON ENERGY CORP	8,400	17.80	149,520.00	
	EOG RESOURCES INC	7,783	54.86	426,975.38	
	EXXON MOBIL CORP	58,218	47.43	2,761,279.74	
	HALLIBURTON CO	11,937	19.24	229,667.88	

HESS CORP	4,079	59.93	244,454.47
KINDER MORGAN INC	27,151	15.32	415,953.32
MARATHON PETROLEUM CORP	8,739	45.75	399,809.25
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	13,724	21.49	294,928.76
ONEOK INC	6,554	42.84	280,773.36
PHILLIPS 66	5,838	72.55	423,546.90
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,424	131.16	317,931.84
SCHLUMBERGER LTD	18,563	24.41	453,122.83
VALERO ENERGY CORP	5,488	59.45	326,261.60
WILLIAMS COS INC	16,239	21.60	350,762.40
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,096	283.60	878,025.60
ALBEMARLE CORP	1,582	173.71	274,809.22
AMCOR PLC	23,330	11.09	258,729.70
AVERY DENNISON CORP	928	156.68	145,399.04
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	27.57	46,483.02
BALL CORP	4,409	90.74	400,072.66
CELANESE CORP	1,759	131.40	231,132.60
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	43.40	128,333.80
CORTEVA INC	10,203	42.06	429,138.18
CROWN HOLDINGS INC	1,510	93.74	141,547.40
DOW INC	9,910	57.50	569,825.00
DUPONT DE NEMOURS INC	9,759	81.09	791,357.31
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	106.22	199,587.38
ECOLAB INC	3,609	212.39	766,515.51
FMC CORP	1,927	114.45	220,545.15
FREEMPORT-MCMORAN INC	19,809	30.49	603,976.41
INTERNATIONAL PAPER CO	5,534	51.63	285,720.42
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1,182	115.81	136,887.42
LINDE PLC	7,260	251.48	1,825,744.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,676	91.48	336,280.48
MARTIN MARIETTA MATERIALS	926	309.60	286,689.60
MOSAIC CO/THE	3,288	28.33	93,149.04
NEWMONT CORP	10,613	61.75	655,352.75
NUCOR CORP	4,490	54.78	245,962.20
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	140.40	184,204.80

PPG INDUSTRIES INC	3,178	137.82	437,991.96
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	86.97	125,758.62
SEALED AIR CORP	1,397	45.50	63,563.50
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,149	732.17	841,263.33
STEEL DYNAMICS INC	2,352	38.70	91,022.40
VULCAN MATERIALS CO	1,832	158.37	290,133.84
WESTROCK CO	3,862	46.67	180,239.54
3M CO	7,994	169.04	1,351,305.76
ALLEGION PLC	1,026	113.61	116,563.86
AMETEK INC	3,087	117.35	362,259.45
BOEING CO/THE	7,426	205.84	1,528,567.84
CARRIER GLOBAL CORP	11,040	39.51	436,190.40
CATERPILLAR INC	7,524	191.94	1,444,156.56
CUMMINS INC	1,966	247.00	485,602.00
DEERE & CO	4,154	305.17	1,267,676.18
DOVER CORP	2,147	125.32	269,062.04
EATON CORP PLC	5,290	124.43	658,234.70
EMERSON ELECTRIC CO	7,898	83.73	661,299.54
FASTENAL CO	7,657	47.72	365,392.04
FORTIVE CORP	4,092	69.32	283,657.44
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	92.57	174,216.74
GENERAC HOLDINGS INC	936	277.61	259,842.96
GENERAL DYNAMICS CORP	3,232	152.77	493,752.64
GENERAL ELECTRIC CO	121,691	11.11	1,351,987.01
HEICO CORP	647	128.70	83,268.90
HEICO CORP-CLASS A	819	113.65	93,079.35
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,692	202.25	1,960,207.00
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	26.76	156,653.04
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	167.64	101,254.56
IDEX CORP	1,126	196.54	221,304.04
ILLINOIS TOOL WORKS	4,425	203.46	900,310.50
INGERSOLL-RAND INC	5,287	45.23	239,131.01
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	111.01	197,042.75
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	58.10	162,680.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	27.41	63,043.00

JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,914	52.35	518,997.90
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,858	183.80	525,300.40
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	293.15	137,780.50
LOCKHEED MARTIN CORP	3,495	339.88	1,187,880.60
MASCO CORP	3,079	57.52	177,104.08
NORDSON CORP	746	191.99	143,224.54
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,082	298.16	620,769.12
OTIS WORLDWIDE CORP	5,512	64.88	357,618.56
OWENS CORNING	1,611	84.55	136,210.05
PACCAR INC	4,610	98.85	455,698.50
PARKER HANNIFIN CORP	1,716	275.17	472,191.72
PENTAIR PLC	2,474	57.98	143,442.52
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	21,167	67.58	1,430,465.86
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,550	265.97	412,253.50
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,378	419.22	577,685.16
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	57.84	97,286.88
SMITH (A.O.) CORP	1,507	57.76	87,044.32
SNAP-ON INC	772	177.98	137,400.56
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,069	175.21	362,509.49
SUNRUN INC	1,550	86.39	133,904.50
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	550	389.17	214,043.50
TEXTRON INC	3,103	49.73	154,312.19
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,195	152.67	487,780.65
TRANSDIGM GROUP INC	689	576.40	397,139.60
UNITED RENTALS INC	983	258.59	254,193.97
WABTEC CORP	2,696	80.47	216,947.12
WW GRAINGER INC	677	393.49	266,392.73
XYLEM INC	2,684	102.60	275,378.40
CINTAS CORP	1,181	324.48	383,210.88
COPART INC	2,853	114.59	326,925.27
COSTAR GROUP INC	524	896.05	469,530.20
EQUIFAX INC	1,644	178.74	293,848.56
IHS MARKIT LTD	5,054	88.09	445,206.86
REPUBLIC SERVICES INC	3,015	94.40	284,616.00
ROBERT HALF INTL INC	1,565	68.31	106,905.15

ROLLINS INC	3,021	37.02	111,837.42
TRANSUNION	2,592	91.91	238,230.72
VERISK ANALYTICS INC	2,060	192.76	397,085.60
WASTE CONNECTIONS INC	3,522	102.96	362,625.12
WASTE MANAGEMENT INC	5,564	115.36	641,863.04
AMERCO	106	474.62	50,309.72
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	97.80	145,330.80
CSX CORP	10,702	87.64	937,923.28
DELTA AIR LINES INC	1,316	40.00	52,640.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	2,507	93.77	235,081.39
FEDEX CORP	3,480	254.08	884,198.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	146.14	170,399.24
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	217.58	285,682.54
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	43.71	45,633.24
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,384	244.22	826,440.48
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,297	204.61	265,379.17
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	47.39	104,494.95
UBER TECHNOLOGIES INC	12,797	54.31	695,005.07
UNION PACIFIC CORP	9,382	207.13	1,943,293.66
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,792	158.99	1,556,830.08
XPO LOGISTICS INC	977	117.13	114,436.01
APTIV PLC	3,602	139.49	502,442.98
AUTOLIV INC	743	88.50	65,755.50
BORGWARNER INC	3,548	42.80	151,854.40
FORD MOTOR CO	52,187	11.52	601,194.24
GENERAL MOTORS CO	17,042	55.40	944,126.80
LEAR CORP	775	167.08	129,487.00
TESLA INC	10,210	846.64	8,644,194.40
DR HORTON INC	4,656	77.71	361,817.76
GARMIN LTD	1,968	123.83	243,697.44
HASBRO INC	1,788	97.48	174,294.24
LENNAR CORP-A	3,733	84.62	315,886.46
LULULEMON ATHLETICA INC	1,638	346.37	567,354.06
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	149.77	84,470.28
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	24.80	137,243.20

NIKE INC -CL B	17,217	139.35	2,399,188.95
NVR INC	54	4,485.91	242,239.14
PELOTON INTERACTIVE INC-A	2,689	159.75	429,567.75
PULTEGROUP INC	3,683	48.89	180,061.87
VF CORP	4,481	83.86	375,776.66
WHIRLPOOL CORP	714	198.21	141,521.94
ARAMARK	2,216	35.46	78,579.36
CARNIVAL CORP	6,635	20.22	134,159.70
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	355	1,494.18	530,433.90
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	121.98	219,076.08
DOMINO'S PIZZA INC	590	380.37	224,418.30
DRAFTKINGS INC - CL A	2,552	52.53	134,056.56
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,758	104.96	394,439.68
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	54.18	277,672.50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,715	122.90	456,573.50
MCDONALD'S CORP	10,270	213.38	2,191,412.60
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	16.36	58,896.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	31.39	220,577.53
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,461	71.96	177,093.56
STARBUCKS CORP	16,209	103.91	1,684,277.19
VAIL RESORTS INC	557	271.59	151,275.63
WYNN RESORTS LTD	1,017	107.45	109,276.65
YUM! BRANDS INC	4,053	107.09	434,035.77
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,874	94.43	1,026,831.82
ALPHABET INC-CL A	4,117	1,892.56	7,791,669.52
ALPHABET INC-CL C	4,114	1,901.05	7,820,919.70
ALTICE USA INC- A	4,447	36.12	160,625.64
CABLE ONE INC	68	2,045.01	139,060.68
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,998	646.69	1,292,086.62
COMCAST CORP-CLASS A	62,734	48.68	3,053,891.12
DISCOVERY INC - A	1,722	37.49	64,557.78
DISCOVERY INC-C	3,336	32.89	109,721.04
DISH NETWORK CORP-A	3,674	30.72	112,865.28
ELECTRONIC ARTS INC	3,889	146.00	567,794.00
FACEBOOK INC-A	32,918	274.50	9,035,991.00

FOX CORP - CLASS A	3,877	30.16	116,930.32
FOX CORP- CLASS B	1,836	29.17	53,556.12
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	200.52	225,785.52
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	24.58	144,382.92
LIBERTY BROADBAND-A	223	153.65	34,263.95
LIBERTY BROADBAND-C	2,173	154.57	335,880.61
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	40.63	87,476.39
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	40.38	70,947.66
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	40.53	38,341.38
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	72.28	177,447.40
MATCH GROUP INC	3,380	141.00	476,580.00
NETFLIX INC	6,074	565.17	3,432,842.58
NEWS CORP - CLASS A	5,861	18.57	108,838.77
OMNICOM GROUP	3,237	62.57	202,539.09
PINTEREST INC- CLASS A	6,698	73.08	489,489.84
ROKU INC	1,447	422.85	611,863.95
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.97	62,010.39
SNAP INC - A	12,546	53.57	672,089.22
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,602	204.66	327,865.32
TWITTER INC	10,694	48.06	513,953.64
VIACOMCBS INC - CLASS B	8,010	45.58	365,095.80
WALT DISNEY CO/THE	24,844	172.78	4,292,546.32
ZILLOW GROUP INC - A	904	152.05	137,453.20
ZILLOW GROUP INC - C	1,987	145.82	289,744.34
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	163.76	153,443.12
AMAZON.COM INC	5,817	3,292.23	19,150,901.91
AUTOZONE INC	311	1,227.16	381,646.76
BEST BUY CO INC	3,104	114.93	356,742.72
BOOKING HOLDINGS INC	566	2,066.24	1,169,491.84
BURLINGTON STORES INC	893	252.25	225,259.25
CARMAX INC	2,353	118.64	279,159.92
CARVANA CO	902	273.47	246,669.94
CHEWY INC - CLASS A	1,090	105.08	114,537.20
DOLLAR GENERAL CORP	3,308	206.21	682,142.68
DOLLAR TREE INC	3,180	107.88	343,058.40

EBAY INC	9,836	56.46	555,340.56
ETSY INC	1,722	213.59	367,801.98
EXPEDIA GROUP INC	1,958	136.52	267,306.16
GENUINE PARTS CO	1,957	101.64	198,909.48
HOME DEPOT INC	14,748	284.00	4,188,432.00
LKQ CORP	2,845	37.15	105,691.75
LOWE'S COS INC	10,409	172.40	1,794,511.60
MERCADOLIBRE INC	587	1,965.05	1,153,484.35
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	983	457.31	449,535.73
POOL CORP	578	369.31	213,461.18
ROSS STORES INC	4,714	113.33	534,237.62
TARGET CORP	6,913	191.91	1,326,673.83
TJX COMPANIES INC	16,596	66.91	1,110,438.36
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,677	155.62	260,974.74
ULTA BEAUTY INC	726	299.92	217,741.92
WAYFAIR INC- CLASS A	864	299.94	259,148.16
COSTCO WHOLESALE CORP	6,083	362.30	2,203,870.90
KROGER CO	10,508	33.56	352,648.48
SYSCO CORP	6,442	75.19	484,373.98
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,956	47.45	472,412.20
WALMART INC	19,472	146.33	2,849,337.76
ALTRIA GROUP INC	25,841	41.83	1,080,929.03
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,379	52.82	389,758.78
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,118	72.84	299,955.12
BUNGE LTD	1,423	68.60	97,617.80
CAMPBELL SOUP CO	1,995	46.58	92,927.10
COCA-COLA CO/THE	56,069	48.49	2,718,785.81
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,797	47.85	133,836.45
CONAGRA BRANDS INC	6,526	34.38	224,363.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,218	226.91	503,286.38
GENERAL MILLS INC	7,972	55.97	446,192.84
HERSHEY CO/THE	1,965	148.20	291,213.00
HORMEL FOODS CORP	4,355	45.41	197,760.55
JM SMUCKER CO/THE	1,257	114.24	143,599.68
KELLOGG CO	3,449	58.30	201,076.70

KEURIG DR PEPPER INC	8,271	31.47	260,288.37
KRAFT HEINZ CO/THE	8,943	32.91	294,314.13
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	78.15	166,850.25
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,284	91.87	301,701.08
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	50.52	141,203.40
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	19,830	56.25	1,115,437.50
MONSTER BEVERAGE CORP	5,211	88.20	459,610.20
PEPSICO INC	19,035	138.59	2,638,060.65
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21,507	80.68	1,735,184.76
TYSON FOODS INC-CL A	3,944	66.52	262,354.88
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	84.92	273,697.16
CLOROX COMPANY	1,647	202.35	333,270.45
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,289	78.19	882,686.91
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,127	249.83	781,218.41
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	132.21	585,558.09
PROCTER & GAMBLE CO/THE	34,093	130.00	4,432,090.00
ABBOTT LABORATORIES	24,356	112.84	2,748,331.04
ABIOMED INC	494	347.90	171,862.60
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,007	534.08	537,818.56
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,255	107.76	242,998.80
ANTHEM INC	3,497	314.09	1,098,372.73
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,716	79.51	533,989.16
BECTON DICKINSON AND CO	4,044	258.75	1,046,385.00
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,762	37.03	694,756.86
CARDINAL HEALTH INC	4,308	55.39	238,620.12
CENTENE CORP	7,685	61.51	472,704.35
CERNER CORP	4,098	79.90	327,430.20
CIGNA CORP	5,108	223.42	1,141,229.36
COOPER COS INC/THE	727	380.00	276,260.00
CVS HEALTH CORP	18,157	74.12	1,345,796.84
DANAHER CORP	8,807	238.04	2,096,418.28
DAVITA INC	1,175	119.59	140,518.25
DENTSPLY SIRONA INC	3,218	57.23	184,166.14
DEXCOM INC	1,222	370.12	452,286.64
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,153	85.52	697,244.56

HCA HEALTHCARE INC	3,581	166.97	597,919.57
HENRY SCHEIN INC	2,103	69.13	145,380.39
HOLOGIC INC	3,815	75.70	288,795.50
HUMANA INC	1,738	405.18	704,202.84
IDEXX LABORATORIES INC	1,129	492.86	556,438.94
INSULET CORP	967	290.30	280,720.10
INTUITIVE SURGICAL INC	1,625	744.08	1,209,130.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,325	228.90	303,292.50
MASIMO CORP	701	263.68	184,839.68
MCKESSON CORP	2,170	185.01	401,471.70
MEDTRONIC PLC	18,512	116.58	2,158,128.96
MOLINA HEALTHCARE INC	807	223.12	180,057.84
NOVOCURE LTD	1,266	169.10	214,080.60
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,978	124.46	246,181.88
RESMED INC	1,937	215.52	417,462.24
STERIS PLC	1,157	188.76	218,395.32
STRYKER CORP	4,699	239.93	1,127,431.07
TELADOC HEALTH INC	1,474	263.00	387,662.00
TELEFLEX INC	632	386.44	244,230.08
UNITEDHEALTH GROUP INC	13,033	347.55	4,529,619.15
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	129.10	136,587.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,342	175.47	235,480.74
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,787	288.69	515,889.03
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	995	300.09	298,589.55
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,759	161.01	444,226.59
10X GENOMICS INC-CLASS A	892	187.00	166,804.00
ABBVIE INC	24,246	110.86	2,687,911.56
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,121	126.33	520,605.93
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,965	159.73	473,599.45
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,684	172.38	290,287.92
AMGEN INC	8,068	253.50	2,045,238.00
AVANTOR INC	6,265	30.52	191,207.80
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	594.83	146,328.18
BIOGEN INC	2,151	269.44	579,565.44
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	87.99	231,765.66

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	31,024	64.56	2,002,909.44
CATALENT INC	2,108	116.82	246,256.56
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	30.46	165,336.88
ELI LILLY & CO	11,862	206.14	2,445,232.68
EXACT SCIENCES CORP	2,304	150.00	345,600.00
GILEAD SCIENCES INC	17,383	66.94	1,163,618.02
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,200	77.73	248,736.00
ILLUMINA INC	1,933	406.25	785,281.25
INCYTE CORP	2,513	97.89	245,997.57
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,802	61.75	111,273.50
IQVIA HOLDINGS INC	2,542	185.59	471,769.78
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	168.65	126,993.45
JOHNSON & JOHNSON	36,055	163.55	5,896,795.25
MERCK & CO. INC.	34,728	80.98	2,812,273.44
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	321	1,234.72	396,345.12
MODERNA INC	3,691	131.02	483,594.82
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	116.91	112,701.24
PERKINELMER INC	1,624	151.91	246,701.84
PERRIGO CO PLC	1,855	43.29	80,302.95
PFIZER INC	76,299	36.55	2,788,728.45
PPD INC	1,772	34.90	61,842.80
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,458	537.78	784,083.24
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	51.16	84,516.32
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	98.24	79,869.12
SEAGEN INC	1,643	182.75	300,258.25
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	12.55	160,878.45
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,436	514.60	2,797,365.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,629	237.59	862,214.11
VIATRIS INC	17,737	17.43	309,155.91
WATERS CORP	843	273.62	230,661.66
ZOETIS INC	6,586	163.33	1,075,691.38
BANK OF AMERICA CORP	106,922	31.55	3,373,389.10
CITIGROUP INC	28,659	61.33	1,757,656.47
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	38.39	217,863.25
FIFTH THIRD BANCORP	10,229	30.90	316,076.10

FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,273	156.53	355,792.69
HUNTINGTON BANCSHARES INC	14,642	13.84	202,645.28
JPMORGAN CHASE & CO	41,718	133.79	5,581,451.22
KEYCORP	12,976	18.20	236,163.20
M & T BANK CORP	1,846	143.16	264,273.36
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,541	152.57	845,390.37
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	17.74	226,486.58
SVB FINANCIAL GROUP	685	480.15	328,902.75
TRUIST FINANCIAL CORP	18,676	51.18	955,837.68
US BANCORP	18,811	45.86	862,672.46
WELLS FARGO & CO	53,908	31.90	1,719,665.20
ALLY FINANCIAL INC	5,678	40.61	230,583.58
AMERICAN EXPRESS CO	9,575	126.14	1,207,790.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	211.79	354,960.04
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	46.43	72,198.65
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	10,702	41.93	448,734.86
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	19,252	232.92	4,484,175.84
BLACKROCK INC	2,122	735.05	1,559,776.10
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	8,940	65.03	581,368.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,102	105.34	642,784.68
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	33.40	41,750.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	95.20	117,952.80
CME GROUP INC	5,056	184.04	930,506.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,228	92.27	390,117.56
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	26.92	150,698.16
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	320.23	167,480.29
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	26.47	72,474.86
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,581	289.39	1,325,695.59
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,216	111.92	807,614.72
INVESCO LTD	5,927	20.97	124,289.19
KKR & CO INC	6,932	40.20	278,666.40
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	509.70	265,044.00
MOODY'S CORP	2,233	266.70	595,541.10
MORGAN STANLEY	18,743	74.13	1,389,418.59
MSCI INC	1,140	411.88	469,543.20

NASDAQ INC	1,746	140.42	245,173.32
NORTHERN TRUST CORP	2,987	94.60	282,570.20
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	102.04	173,774.12
S&P GLOBAL INC	3,373	315.14	1,062,967.22
SCHWAB (CHARLES) CORP	21,435	58.40	1,251,804.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	59.40	103,118.40
STATE STREET CORP	4,767	74.17	353,568.39
SYNCHRONY FINANCIAL	7,979	37.37	298,175.23
T ROWE PRICE GROUP INC	3,050	156.21	476,440.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	64.32	47,210.88
VOYA FINANCIAL INC	1,741	57.78	100,594.98
AFLAC INC	9,192	46.43	426,784.56
ALLEGHANY CORP	197	585.38	115,319.86
ALLSTATE CORP	4,209	110.43	464,799.87
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	84.84	65,835.84
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	11,606	40.08	465,168.48
AON PLC	3,057	206.46	631,148.22
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	33.31	203,224.31
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,584	117.84	304,498.56
ASSURANT INC	896	134.90	120,870.40
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	43.29	54,978.30
BROWN & BROWN INC	2,686	47.49	127,558.14
CHUBB LTD	6,327	152.53	965,057.31
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	87.32	151,412.88
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	236.45	90,323.90
EVEREST RE GROUP LTD	550	228.92	125,906.00
FNF GROUP	3,124	39.44	123,210.56
GLOBE LIFE INC	1,521	94.34	143,491.14
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5,383	50.37	271,141.71
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	50.70	104,442.00
LOEWS CORP	2,906	46.49	135,099.94
MARKEL CORP	207	993.80	205,716.60
MARSH & MCLENNAN COS	6,717	111.52	749,079.84
METLIFE INC	10,331	50.86	525,434.66
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	53.46	201,223.44

PROGRESSIVE CORP	8,272	92.31	763,588.32
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,308	82.62	438,546.96
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,021	110.18	112,493.78
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	155.04	87,132.48
TRAVELERS COS INC/THE	3,388	145.84	494,105.92
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,732	206.50	357,658.00
WR BERKLEY CORP	2,140	65.88	140,983.20
CBRE GROUP INC - A	4,736	66.02	312,670.72
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.60	92,460.00
ACCENTURE PLC-CL A	8,750	254.77	2,229,237.50
ADOBE INC	6,583	472.44	3,110,072.52
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	109.06	236,769.26
ANSYS INC	1,132	374.57	424,013.24
AUTODESK INC	3,052	299.17	913,066.84
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,962	161.98	965,724.76
AVALARA INC	1,064	163.91	174,400.24
BLACK KNIGHT INC	2,282	82.30	187,808.60
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	95.93	147,828.13
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,673	148.94	249,176.62
CADENCE DESIGN SYS INC	3,685	137.42	506,392.70
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	105.14	202,815.06
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	129.40	215,321.60
CITRIX SYSTEMS INC	1,705	126.75	216,108.75
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,240	83.47	186,972.80
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,112	80.56	572,942.72
COUPA SOFTWARE INC	887	341.90	303,265.30
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1,914	223.52	427,817.28
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	162.26	115,529.12
DATADOG INC - CLASS A	1,771	105.00	185,955.00
DOCUSIGN INC	2,288	255.15	583,783.20
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	22.16	59,721.20
DYNATRACE INC	2,449	45.07	110,376.43
EPAM SYSTEMS INC	745	359.69	267,969.05
FAIR ISAAC CORP	389	496.16	193,006.24
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,567	129.08	1,105,828.36

FISERV INC	7,910	107.28	848,584.80
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	267.41	298,696.97
FORTINET INC	1,600	151.23	241,968.00
GARTNER INC	1,196	160.41	191,850.36
GLOBAL PAYMENTS INC	4,167	187.52	781,395.84
GODADDY INC - CLASS A	2,217	83.75	185,673.75
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	123.71	112,328.68
HUBSPOT INC	629	393.48	247,498.92
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,287	118.61	1,457,361.07
INTUIT INC	3,606	374.85	1,351,709.10
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	151.50	127,714.50
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	112.05	219,954.15
MASTERCARD INC-CLASS A	12,242	328.99	4,027,495.58
MICROSOFT CORP	98,226	225.95	22,194,164.70
MONGODB INC	644	384.12	247,373.28
NORTONLIFELOCK INC	6,268	20.67	129,559.56
OKTA INC	1,540	264.00	406,560.00
ORACLE CORP	27,510	60.36	1,660,503.60
PALO ALTO NETWORKS INC	1,280	364.62	466,713.60
PAYCHEX INC	4,283	86.87	372,064.21
PAYCOM SOFTWARE INC	719	409.80	294,646.20
PAYPAL HOLDINGS INC	15,303	252.00	3,856,356.00
PTC INC	1,603	130.88	209,800.64
RINGCENTRAL INC-CLASS A	975	384.52	374,907.00
SALESFORCE.COM INC	12,489	225.77	2,819,641.53
SERVICENOW INC	2,649	541.09	1,433,347.41
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,137	42.65	219,093.05
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	285.68	108,558.40
SPLUNK INC	2,092	170.90	357,522.80
SQUARE INC - A	5,144	222.88	1,146,494.72
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	67.51	209,145.98
SYNOPSYS INC	1,988	270.14	537,038.32
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	546	812.96	443,876.16
TWILIO INC - A	1,834	392.01	718,946.34
TYLER TECHNOLOGIES INC	585	424.40	248,274.00

VERISIGN INC	1,385	194.75	269,728.75
VISA INC-CLASS A SHARES	23,094	202.02	4,665,449.88
VMWARE INC-CLASS A	1,126	134.50	151,447.00
WESTERN UNION CO	5,513	22.06	121,616.78
WIX.COM LTD	747	249.49	186,369.03
WORKDAY INC-CLASS A	2,288	235.53	538,892.64
ZENDESK INC	1,677	150.81	252,908.37
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,398	383.40	919,393.20
ZSCALER INC	963	217.36	209,317.68
AMPHENOL CORP-CL A	3,944	132.24	521,554.56
APPLE INC	233,699	139.07	32,500,519.93
ARISTA NETWORKS INC	777	311.21	241,810.17
ARROW ELECTRONICS INC	902	104.89	94,610.78
CDW CORP/DE	2,130	135.32	288,231.60
CISCO SYSTEMS INC	58,210	44.77	2,606,061.70
COGNEX CORP	1,928	84.37	162,665.36
CORNING INC	10,238	37.60	384,948.80
DELL TECHNOLOGIES -C	3,296	75.94	250,298.24
F5 NETWORKS INC	916	204.32	187,157.12
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19,254	12.14	233,743.56
HP INC	19,172	25.27	484,476.44
IPG PHOTONICS CORP	558	251.00	140,058.00
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	25.04	113,506.32
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,546	145.16	369,577.36
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,283	173.71	396,579.93
NETAPP INC	2,471	64.76	160,021.96
SEAGATE TECHNOLOGY	3,159	60.00	189,540.00
TE CONNECTIVITY LTD	4,399	128.39	564,787.61
TRIMBLE INC	3,417	70.76	241,786.92
WESTERN DIGITAL CORP	4,100	50.71	207,911.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	793	408.84	324,210.12
AT&T INC	98,260	28.93	2,842,661.80
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	25.14	32,832.84
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	24.79	86,839.37
LUMEN TECHNOLOGIES INC	12,971	11.17	144,886.07

T-MOBILE US INC	7,827	130.36	1,020,327.72
VERIZON COMMUNICATIONS INC	56,968	57.47	3,273,950.96
AES CORP	9,870	27.10	267,477.00
ALLIANT ENERGY CORP	3,704	49.41	183,014.64
AMEREN CORPORATION	3,331	72.88	242,763.28
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,546	82.08	537,295.68
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,418	160.91	389,080.38
ATMOS ENERGY CORP	1,353	89.09	120,538.77
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	21.44	146,220.80
CMS ENERGY CORP	3,883	58.41	226,806.03
CONSOLIDATED EDISON INC	4,473	68.83	307,876.59
DOMINION ENERGY INC	11,742	72.29	848,829.18
DTE ENERGY COMPANY	2,584	121.91	315,015.44
DUKE ENERGY CORP	10,265	90.29	926,826.85
EDISON INTERNATIONAL	5,098	59.30	302,311.40
ENTERGY CORP	2,701	93.97	253,812.97
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	45.46	112,058.90
EVERGY INC	2,522	53.80	135,683.60
EVERSOURCE ENERGY	4,479	87.41	391,509.39
EXELON CORP	12,893	42.54	548,468.22
FIRSTENERGY CORP	8,044	31.27	251,535.88
NEXTERA ENERGY INC	27,024	84.21	2,275,691.04
NISOURCE INC	4,230	21.93	92,763.90
NRG ENERGY INC	3,312	41.53	137,547.36
OGE ENERGY CORP	2,970	31.36	93,139.20
P G & E CORP	21,589	11.72	253,023.08
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	77.09	117,639.34
PPL CORP	10,335	27.82	287,519.70
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,746	58.36	393,696.56
SEMPRA ENERGY	3,870	121.45	470,011.50
SOUTHERN CO/THE	14,774	60.14	888,508.36
UGI CORP	3,091	37.18	114,923.38
VISTRA CORP	4,854	21.34	103,584.36
WEC ENERGY GROUP INC	4,196	87.38	366,646.48
XCEL ENERGY INC	6,948	64.76	449,952.48

	ADVANCED MICRO DEVICES	16,160	92.79	1,499,486.40	
	ANALOG DEVICES INC	4,806	155.58	747,717.48	
	APPLIED MATERIALS INC	12,609	106.33	1,340,714.97	
	BROADCOM INC	5,520	465.02	2,566,910.40	
	ENPHASE ENERGY INC	1,709	212.07	362,427.63	
	INTEL CORP	58,306	56.66	3,303,617.96	
	KLA CORP	2,030	305.01	619,170.30	
	LAM RESEARCH CORP	2,014	563.85	1,135,593.90	
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,745	52.62	460,161.90	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,781	93.62	353,977.22	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,220	150.13	483,418.60	
	MICRON TECHNOLOGY INC	15,347	82.28	1,262,751.16	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	609	396.91	241,718.19	
	NVIDIA CORP	8,445	548.50	4,632,082.50	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,648	172.30	628,550.40	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	37.29	202,325.37	
	QORVO INC	1,631	180.66	294,656.46	
	QUALCOMM INC	15,483	162.42	2,514,748.86	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,194	161.27	353,826.38	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	716	321.12	229,921.92	
	TERADYNE INC	2,370	137.95	326,941.50	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	12,577	172.81	2,173,431.37	
	XILINX INC	3,193	142.94	456,407.42	
	米ドル 小計	4,247,578		464,089,745.50 (48,191,079,172)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	15.75	38,808.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,284	30.96	504,152.64	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	7.47	77,217.39	
	ENBRIDGE INC	28,581	44.16	1,262,136.96	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	25.61	73,679.97	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	13.29	46,129.59	
	KEYERA CORP	2,259	25.23	56,994.57	
	PARKLAND CORP	1,790	39.63	70,937.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	35.33	305,109.88	
	SUNCOR ENERGY INC	20,962	22.53	472,273.86	

TC ENERGY CORP	12,551	56.39	707,750.89
AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	89.94	307,684.74
B2GOLD CORP	10,119	6.43	65,065.17
BARRICK GOLD CORP	23,822	29.85	711,086.70
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	60.44	101,116.12
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	23.54	216,874.02
FRANCO-NEVADA CORP	2,617	157.07	411,052.19
KINROSS GOLD CORP	19,092	8.94	170,682.48
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	51.10	160,505.10
LUNDIN MINING CORP	7,300	12.32	89,936.00
NUTRIEN LTD	7,998	67.06	536,345.88
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	38.42	78,761.00
SSR MINING INC	2,800	22.25	62,300.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	26.07	193,022.28
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,261	51.47	322,253.67
YAMANA GOLD INC	9,288	6.60	61,300.80
CAE INC	3,196	29.92	95,624.32
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	88.81	125,754.96
WSP GLOBAL INC	1,340	118.17	158,347.80
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	39.68	124,396.80
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	80.23	145,136.07
THOMSON REUTERS CORP	2,714	103.72	281,496.08
AIR CANADA	840	22.09	18,555.60
CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,995	136.00	1,359,320.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,833	431.71	791,324.43
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,285	96.79	414,745.15
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	33.34	60,012.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	76.44	315,391.44
QUEBECOR INC -CL B	1,274	30.53	38,895.22
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	22.27	127,629.37
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	170.88	159,431.04
DOLLARAMA INC	3,451	51.57	177,968.07
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,716	37.95	444,622.20
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	36.05	94,739.40
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	63.35	133,921.90

METRO INC	4,107	57.06	234,345.42
WESTON (GEORGE) LTD	817	93.26	76,193.42
SAPUTO INC	3,667	35.86	131,498.62
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	33.92	111,155.84
CANOPY GROWTH CORP	3,659	42.97	157,227.23
BANK OF MONTREAL	8,502	97.60	829,795.20
BANK OF NOVA SCOTIA	16,021	69.40	1,111,857.40
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,942	111.06	659,918.52
NATIONAL BANK OF CANADA	4,616	73.55	339,506.80
ROYAL BANK OF CANADA	19,705	107.36	2,115,528.80
TORONTO-DOMINION BANK	25,036	73.58	1,842,148.88
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,959	48.91	878,374.69
CI FINANCIAL CORP	775	16.58	12,849.50
IGM FINANCIAL INC	81	35.37	2,864.97
ONEX CORPORATION	908	69.55	63,151.40
TMX GROUP LTD	540	123.64	66,765.60
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	451.53	147,198.78
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	30.31	131,181.68
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	58.72	73,634.88
INTACT FINANCIAL CORP	2,057	145.24	298,758.68
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,548	24.15	641,134.20
POWER CORP OF CANADA	8,338	30.89	257,560.82
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,077	60.73	490,516.21
FIRSTSERVICE CORP	671	173.19	116,210.49
BLACKBERRY LTD	1,407	17.86	25,129.02
CGI INC	3,488	100.53	350,648.64
CONSTELLATION SOFTWARE INC	275	1,624.05	446,613.75
OPEN TEXT CORP	4,289	59.59	255,581.51
SHOPIFY INC - CLASS A	1,503	1,522.54	2,288,377.62
BCE INC	2,440	54.74	133,565.60
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	61.51	318,191.23
TELUS CORP	4,085	26.44	108,007.40
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	21.98	196,677.04
ALTAGAS LTD	2,930	19.72	57,779.60
ATCO LTD -CLASS I	863	37.50	32,362.50

	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	74.66	153,500.96
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	32.11	31,692.57
	EMERA INC	4,109	53.25	218,804.25
	FORTIS INC	6,487	52.11	338,037.57
	HYDRO ONE LTD	4,991	30.13	150,378.83
	NORTHLAND POWER INC	3,252	49.74	161,754.48
	カナダドル 小計	515,241		28,226,970.05 (2,305,296,643)
ユーロ	ENI SPA	35,538	8.54	303,565.59
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.80	65,208.00
	NESTE OYJ	5,733	62.18	356,477.94
	OMV AG	1,475	36.54	53,896.50
	REPSOL SA	21,728	8.45	183,645.05
	TENARIS SA	5,062	6.29	31,839.98
	TOTAL SE	35,015	36.22	1,268,243.30
	VOPAK	762	42.06	32,049.72
	AIR LIQUIDE SA	6,642	132.05	877,076.10
	AKZO NOBEL	2,659	86.06	228,833.54
	ARCELORMITTAL	11,383	18.64	212,201.88
	ARKEMA	822	95.56	78,550.32
	BASF SE	12,913	66.45	858,068.85
	COVESTRO AG	2,528	55.88	141,264.64
	CRH PLC	10,365	36.12	374,383.80
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	27.01	48,428.93
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,085	48.08	52,166.80
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	65.00	140,660.00
	KONINKLIJKE DSM NV	2,331	147.00	342,657.00
	LANXESS AG	745	64.30	47,903.50
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	41.32	164,288.32
	SOLVAY SA	925	98.28	90,909.00
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	16.13	140,632.66
	SYMRISE AG	1,815	101.20	183,678.00
	UMICORE	2,388	47.56	113,573.28
	UPM-KYMMENE OYJ	8,076	31.18	251,809.68
	VOESTALPINE AG	2,425	31.69	76,848.25

(Right)ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS	2,875	0.42	1,225.03
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	27.00	77,625.00
AIRBUS SE	7,861	88.83	698,292.63
ALSTOM	3,998	47.62	190,384.76
BOUYGUES SA	3,499	34.09	119,280.91
BRENTAG AG	2,419	67.82	164,056.58
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	11.20	182,313.60
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7,237	42.60	308,296.20
DASSAULT AVIATION SA	11	874.50	9,619.50
EIFFAGE	1,313	76.50	100,444.50
FERROVIAL SA	7,014	20.18	141,542.52
GEA GROUP AG	1,676	30.08	50,414.08
HOCHTIEF AG	17	82.95	1,410.15
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	62.95	129,047.50
KION GROUP AG	740	76.60	56,684.00
KNORR-BREMSE AG	1,136	115.40	131,094.40
KONE OYJ-B	4,561	65.14	297,103.54
LEGRAND SA	3,715	79.84	296,605.60
MTU AERO ENGINES AG	831	206.50	171,601.50
PRYSMIAN SPA	2,867	28.00	80,276.00
RATIONAL AG	80	824.00	65,920.00
SAFRAN SA	4,327	110.55	478,349.85
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,324	125.35	918,063.40
SIEMENS AG-REG	10,651	132.00	1,405,932.00
SIEMENS ENERGY AG	5,006	31.80	159,190.80
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	35.74	81,987.56
THALES SA	1,768	75.50	133,484.00
VINCI SA	7,391	80.46	594,679.86
WARTSILA OYJ ABP	2,705	8.70	23,544.32
BUREAU VERITAS SA	4,564	22.27	101,640.28
RANDSTAD NV	1,871	53.66	100,397.86
TELEPERFORMANCE	832	289.80	241,113.60
WOLTERS KLUWER	3,691	69.74	257,410.34
ADP	314	94.05	29,531.70
AENA SME SA	1,045	130.70	136,581.50

ATLANTIA SPA	8,066	13.25	106,874.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	10.10	14,210.70
DEUTSCHE POST AG-REG	13,231	42.73	565,360.63
GETLINK	4,655	13.01	60,561.55
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,522	71.35	322,644.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	54.20	33,549.80
CONTINENTAL AG	1,647	118.70	195,498.90
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,398	59.11	673,735.78
FAURECIA	800	43.67	34,936.00
FERRARI NV	1,758	174.85	307,386.30
MICHELIN (CGDE)	2,383	111.45	265,585.35
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	60.00	106,500.00
RENAULT SA	3,099	34.42	106,667.58
STELLANTIS NV	15,421	13.20	203,557.20
STELLANTIS NV	16,479	13.24	218,181.96
VALEO SA	3,692	31.63	116,777.96
VOLKSWAGEN AG	462	180.00	83,160.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,502	165.36	413,730.72
ADIDAS AG	2,705	279.50	756,047.50
ESSILORLUXOTTICA	3,854	122.50	472,115.00
HERMES INTERNATIONAL	437	875.60	382,637.20
KERING	1,018	544.00	553,792.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,853	511.50	1,970,809.50
MONCLER SPA	2,414	48.67	117,489.38
PUMA SE	1,586	85.42	135,476.12
SEB SA	151	160.30	24,205.30
ACCOR SA	2,330	29.57	68,898.10
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,314	160.80	372,091.20
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	36.99	29,813.94
SODEXO	1,088	76.80	83,558.40
BOLLORE	3,240	3.51	11,398.32
PUBLICIS GROUPE	3,613	43.18	156,009.34
SCOUT24 AG	1,621	66.10	107,148.10
SES	2,232	7.30	16,302.52
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	85.18	93,272.10

VIVENDI	11,862	26.56	315,054.72
DELIVERY HERO SE	1,926	137.10	264,054.60
HELLOFRESH SE	2,219	68.85	152,778.15
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,775	25.59	378,092.25
JUST EAT TAKEAWAY	1,952	95.92	187,235.84
PROSUS NV	6,873	99.16	681,526.68
ZALANDO SE	2,148	98.20	210,933.60
CARREFOUR SA	7,042	14.71	103,623.03
COLRUYT SA	290	50.40	14,616.00
JERONIMO MARTINS	5,217	14.40	75,124.80
KESKO OYJ-B SHS	4,478	21.86	97,889.08
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	14,664	23.64	346,656.96
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,177	54.78	557,496.06
DANONE	8,264	54.56	450,883.84
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	8.81	79,449.39
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	75.90	138,138.00
HEINEKEN NV	3,455	88.08	304,316.40
JDE PEET'S BV	1,184	32.16	38,077.44
KERRY GROUP PLC-A	2,069	113.60	235,038.40
PERNOD RICARD SA	2,853	153.10	436,794.30
REMY COINTREAU	264	145.90	38,517.60
BEIERSDORF AG	1,128	91.58	103,302.24
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	78.75	123,007.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	88.78	212,716.88
L'OREAL	3,494	296.30	1,035,272.20
AMPLIFON SPA	2,059	33.58	69,141.22
BIOMERIEUX	402	123.60	49,687.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	131.40	32,193.00
DIASORIN SPA	256	175.00	44,800.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	69.32	204,909.92
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,777	38.33	221,432.41
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,089	45.63	551,681.51
ORPEA	501	117.45	58,842.45
SARTORIUS AG-VORZUG	502	377.60	189,555.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,463	44.61	154,501.74

ARGENX SE	674	254.60	171,600.40
BAYER AG-REG	12,953	52.66	682,104.98
EUROFINS SCIENTIFIC	1,530	78.00	119,340.00
GALAPAGOS NV	507	89.56	45,406.92
GRIFOLS SA	3,329	24.60	81,893.40
IPSEN	158	72.00	11,376.00
MERCK KGAA	1,798	140.30	252,259.40
ORION OYJ-CLASS B	739	38.58	28,510.62
QIAGEN N.V.	2,679	44.97	120,474.63
RECORDATI SPA	830	42.93	35,631.90
SANOFI	15,691	81.46	1,278,188.86
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	329.80	146,431.20
UCB SA	2,009	87.58	175,948.22
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.33	31,711.59
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	91,083	4.00	364,514.16
BANCO SANTANDER SA	240,521	2.58	620,784.70
BNP PARIBAS	14,918	43.08	642,742.03
CAIXABANK S.A	52,513	2.05	107,756.67
COMMERZBANK AG	13,866	5.78	80,173.21
CREDIT AGRICOLE SA	16,523	9.92	163,941.20
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	26.03	102,063.63
FINECOBANK SPA	7,003	13.30	93,174.91
ING GROEP NV-CVA	51,310	7.71	395,600.10
INTESA SANPAOLO	223,051	1.88	420,272.69
KBC GROEP NV	3,531	59.30	209,388.30
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.41	50,824.08
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	17.07	20,757.12
SOCIETE GENERALE SA	12,059	16.34	197,044.06
UNICREDIT SPA	29,529	7.74	228,820.22
AMUNDI SA	618	65.05	40,200.90
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,465	8.96	246,196.26
DEUTSCHE BOERSE AG	2,564	133.10	341,268.40
EURAZEO	403	57.80	23,293.40
EXOR NV	1,318	64.74	85,327.32
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	84.38	166,988.02

NATIXIS	3,105	3.15	9,780.75
SOFINA	168	274.50	46,116.00
WENDEL	294	99.35	29,208.90
AEGON NV	16,557	3.49	57,883.27
AGEAS	2,765	43.86	121,272.90
ALLIANZ SE-REG	5,820	196.70	1,144,794.00
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	14.51	232,247.06
AXA SA	26,166	19.21	502,701.19
CNP ASSURANCES	1,015	13.40	13,601.00
HANNOVER RUECK SE	718	133.60	95,924.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,879	230.40	432,921.60
NN GROUP NV	4,060	35.68	144,860.80
POSTE ITALIANE SPA	5,374	8.26	44,432.23
SAMPO OYJ-A SHS	6,490	35.69	231,628.10
SCOR SE	1,565	26.78	41,910.70
AROUNDTOWN SA	10,475	5.84	61,215.90
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,911	41.64	204,494.04
LEG IMMOBILIEN AG	1,031	119.68	123,390.08
VONOVIA SE	7,029	55.18	387,860.22
ADYEN NV	239	1,919.00	458,641.00
AMADEUS IT GROUP SA	6,112	54.84	335,182.08
ATOS SE	1,599	63.44	101,440.56
BECHTLE AG	414	176.00	72,864.00
CAPGEMINI SA	2,213	123.40	273,084.20
DASSAULT SYSTEMES SA	1,805	165.00	297,825.00
EDENRED	3,764	46.60	175,402.40
NEMETSCHEK SE	536	60.50	32,428.00
NEXI SPA	7,091	15.05	106,755.00
SAP SE	14,429	104.84	1,512,736.36
TEAMVIEWER AG	2,285	42.93	98,095.05
WORLDLINE SA	3,094	72.98	225,800.12
NOKIA OYJ	76,089	3.39	257,979.75
ALTICE EUROPE NV	7,300	5.35	39,055.00
CELLNEX TELECOM SA	4,483	50.32	225,584.56
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	47,340	15.08	713,887.20

ELISA OYJ	2,152	47.12	101,402.24	
ILIAD SA	98	158.65	15,547.70	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	9.34	23,088.48	
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.63	155,027.98	
ORANGE	28,127	9.58	269,681.67	
PROXIMUS	918	17.36	15,936.48	
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.35	25,762.98	
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.39	28,333.49	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.29	28,978.95	
TELEFONICA SA	69,076	3.63	251,229.41	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	36.68	28,096.88	
E.ON SE	30,402	8.70	264,497.40	
EDF	10,409	12.38	128,915.46	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,111	5.30	196,985.18	
ELIA GROUP SA/NV	345	102.60	35,397.00	
ENAGAS SA	2,667	17.90	47,739.30	
ENDESA SA	4,803	21.92	105,281.76	
ENEL SPA	113,841	8.34	950,003.14	
ENGIE	25,193	13.11	330,406.19	
FORTUM OYJ	6,395	21.14	135,190.30	
IBERDROLA SA	83,775	11.66	976,816.50	
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	19.28	89,613.44	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	15.89	77,996.76	
RWE AG	8,723	36.83	321,268.09	
SNAM SPA	32,585	4.35	141,875.09	
SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	17.03	98,734.86	
TERNA SPA	16,305	5.98	97,569.12	
UNIPER SE	2,857	29.82	85,195.74	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,568	22.35	191,494.80	
VERBUND AG	797	80.25	63,959.25	
ASML HOLDING NV	5,862	462.90	2,713,519.80	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	18,294	34.79	636,448.26	
STMICROELECTRONICS NV	8,739	32.60	284,891.40	
ユーロ 小計	2,496,251		57,543,228.38	(7,271,737,770)

英bond	BP PLC	284,061	2.90	823,776.90	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	57,449	14.20	815,775.80	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	52,102	13.59	708,378.79	
	ANGLO AMERICAN PLC	16,694	26.27	438,634.85	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	15.04	64,994.40	
	BHP GROUP PLC	28,186	21.13	595,570.18	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	64.24	140,878.32	
	EVRAZ PLC	3,072	5.15	15,820.80	
	FRESNILLO PLC	2,896	10.91	31,595.36	
	GLENCORE PLC	138,176	2.70	374,180.60	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	29.95	53,999.85	
	MONDI PLC	5,627	18.30	102,974.10	
	RIO TINTO PLC	15,750	58.76	925,470.00	
	ASHTED GROUP PLC	6,287	38.32	240,917.84	
	BAE SYSTEMS PLC	43,957	4.79	210,597.98	
	BUNZL PLC	4,790	24.08	115,343.20	
	DCC PLC	1,401	58.26	81,622.26	
	FERGUSON PLC	3,075	91.28	280,686.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	76,613	1.75	134,417.50	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107,239	1.02	110,402.55	
	SMITHS GROUP PLC	3,824	14.95	57,168.80	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	116.65	98,919.20	
	EXPERIAN PLC	12,198	26.36	321,539.28	
	INTERTEK GROUP PLC	1,825	55.94	102,090.50	
	RELX PLC	25,710	18.69	480,648.45	
	RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.26	109,855.10	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	6.93	84,022.77	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	44.52	66,690.96	
	BURBERRY GROUP PLC	5,808	17.59	102,191.76	
	PERSIMMON PLC	5,194	27.16	141,069.04	
	TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.59	69,006.44	
	COMPASS GROUP PLC	24,300	13.94	338,863.50	
	ENTAIN PLC	6,950	12.80	88,960.00	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	47.47	119,244.64	
	WHITBREAD PLC	2,921	31.21	91,164.41	

AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.74	65,068.34
INFORMA PLC	17,619	5.15	90,878.80
PEARSON PLC	7,332	7.15	52,423.80
WPP PLC	19,572	7.94	155,401.68
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.29	41,118.40
KINGFISHER PLC	29,802	2.73	81,359.46
NEXT PLC	1,878	79.14	148,624.92
OCADO GROUP PLC	6,371	26.90	171,379.90
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.46	68,491.32
TESCO PLC	132,370	2.41	320,203.03
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.86	42,978.94
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	22.54	112,113.96
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	32,021	27.38	876,895.08
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	22.68	41,640.48
DIAGEO PLC	32,550	29.08	946,716.75
IMPERIAL BRANDS PLC	14,237	16.49	234,839.31
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,941	62.74	623,698.34
UNILEVER PLC	36,228	43.78	1,586,061.84
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	16.53	200,536.48
ASTRAZENECA PLC	18,127	77.77	1,409,736.79
GLAXOSMITHKLINE PLC	69,675	13.80	961,654.35
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	25.18	34,043.36
BARCLAYS PLC	231,567	1.43	331,279.75
HSBC HOLDINGS PLC	281,727	4.07	1,147,614.93
LLOYDS BANKING GROUP PLC	943,785	0.34	328,154.04
NATWEST GROUP PLC	73,118	1.55	113,698.49
STANDARD CHARTERED PLC	39,789	4.61	183,785.39
3I GROUP PLC	14,053	11.44	160,766.32
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	16.50	50,622.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,254	91.20	387,964.80
M&G PLC	41,949	1.95	81,800.55
SCHRODERS PLC	1,161	34.80	40,402.80
ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	11.88	92,070.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	32,937	3.07	101,413.02

	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	29.55	81,114.75
	AVIVA PLC	60,743	3.49	212,053.81
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	3.20	62,847.57
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,505	2.65	221,371.75
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.95	60,847.50
	PRUDENTIAL PLC	34,888	13.95	486,687.60
	RSA INSURANCE GROUP PLC	16,473	6.76	111,489.26
	AVEVA GROUP PLC	700	38.30	26,810.00
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	6.07	92,185.09
	HALMA PLC	4,416	25.78	113,844.48
	BT GROUP PLC	129,623	1.34	174,926.23
	VODAFONE GROUP PLC	360,190	1.27	458,665.94
	NATIONAL GRID PLC	46,737	8.75	409,322.64
	SEVERN TRENT PLC	2,734	23.40	63,975.60
	SSE PLC	14,351	15.47	222,009.97
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	9.32	73,084.88
	英ポンド 小計	4,024,883		22,694,146.62 (3,225,065,176)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.46	55,455.78
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	838.00	65,364.00
	GIVAUDAN-REG	124	3,605.00	447,020.00
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	7,141	50.18	358,335.38
	SIKA AG-REG	1,908	247.60	472,420.80
	ABB LTD-REG	24,382	26.71	651,243.22
	GEBERIT AG-REG	504	557.00	280,728.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	237.20	50,998.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	235.70	109,129.10
	ADECCO SA-REG	2,354	58.32	137,285.28
	SGS SA-REG	90	2,739.00	246,510.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	844	205.40	173,357.60
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6,992	85.46	597,536.32
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	257.20	105,452.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	50.15	12,587.65
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,026.00	85,092.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	15	8,010.00	120,150.00

	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	86,600.00	86,600.00	
	NESTLE SA-REG	39,531	101.02	3,993,421.62	
	ALCON INC	6,601	65.46	432,101.46	
	SONOVA HOLDING AG-REG	840	224.40	188,496.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	1,038.50	120,466.00	
	LONZA GROUP AG-REG	985	599.20	590,212.00	
	NOVARTIS AG-REG	30,528	85.93	2,623,271.04	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,649	318.45	3,072,724.05	
	VIFOR PHARMA AG	638	125.05	79,781.90	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	94.80	25,880.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,933	12.18	401,123.94	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	55.84	199,292.96	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	259	1,077.50	279,072.50	
	UBS GROUP AG-REG	48,789	13.15	641,575.35	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	154.90	101,924.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	426.10	156,804.80	
	SWISS RE AG	4,010	81.34	326,173.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,123	369.20	783,811.60	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	86.15	96,229.55	
	TEMENOS GROUP AG-REG	737	112.90	83,207.30	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,319	91.94	213,208.86	
	SWISSCOM AG-REG	414	469.40	194,331.60	
	スイスフラン 小計	235,120		18,658,375.66 (2,188,814,048)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	239.00	262,661.00	
	BOLIDEN AB	4,039	297.00	1,199,583.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	9,468	146.00	1,382,328.00	
	ALFA LAVAL AB	4,566	236.40	1,079,402.40	
	ASSA ABLOY AB-B	13,841	210.10	2,907,994.10	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,124	470.50	4,292,842.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	5,552	409.60	2,274,099.20	
	EPIROC AB-A	9,564	163.30	1,561,801.20	
	EPIROC AB-B	4,649	151.00	701,999.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	197.00	288,408.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,889	294.20	1,438,343.80	

	SANDVIK AB	15,627	219.00	3,422,313.00	
	SKANSKA AB-B SHS	4,937	225.50	1,113,293.50	
	SKF AB-B SHARES	4,538	234.80	1,065,522.40	
	VOLVO AB-B SHS	20,302	217.40	4,413,654.80	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	130.55	500,398.15	
	ELECTROLUX AB-SER B	3,653	206.80	755,440.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	108.85	308,807.45	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,877	872.00	1,636,744.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	182.65	1,751,796.15	
	ICA GRUPPEN AB	1,462	414.70	606,291.40	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	621.20	1,241,778.80	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,201	261.60	2,145,381.60	
	NORDEA BANK ABP	43,708	70.92	3,099,771.36	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,883	92.80	2,216,342.40	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	86.70	1,994,533.50	
	SWEDBANK AB - A SHARES	13,356	164.20	2,193,055.20	
	EQT AB	2,344	226.40	530,681.60	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	287.80	493,289.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	275.10	647,310.30	
	INVESTOR AB-B SHS	6,250	625.00	3,906,250.00	
	KINNEVIK AB - B	3,881	417.15	1,618,959.15	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	452.20	416,024.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	432.00	683,856.00	
	ERICSSON LM-B SHS	39,493	97.30	3,842,668.90	
	HEXAGON AB-B SHS	3,933	766.40	3,014,251.20	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	115.10	854,502.40	
	TELIA CO AB	31,100	36.30	1,128,930.00	
	スウェーデンクローナ 小計	352,059		62,991,308.56 (788,021,270)	
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	14,162	163.00	2,308,406.00	
	NORSK HYDRO ASA	20,202	39.39	795,756.78	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	387.60	1,074,427.20	
	ADEVINTA ASA	3,943	130.30	513,772.90	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	280.00	154,560.00	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	329.30	383,634.50	

	MOWI ASA	5,643	188.40	1,063,141.20	
	ORKLA ASA	11,182	83.94	938,617.08	
	DNB ASA	13,159	169.00	2,223,871.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	208.00	556,192.00	
	TELENOR ASA	9,278	144.95	1,344,846.10	
	ノルウェークローネ 小計	84,732		11,357,224.76 (138,785,286)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	529.40	644,809.20	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	356.60	1,188,904.40	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,554.00	329,466.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	1,463.00	3,958,878.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	13,240.00	516,360.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	14,335.00	1,419,165.00	
	DSV PANALPINA A S	2,852	980.80	2,797,241.60	
	PANDORA A/S	1,659	630.00	1,045,170.00	
	CARLSBERG AS-B	1,603	931.00	1,492,393.00	
	AMBU A/S-B	1,526	238.90	364,561.40	
	COLOPLAST-B	1,680	916.00	1,538,880.00	
	DEMANT A/S	550	239.80	131,890.00	
	GN STORE NORD A/S	1,892	483.80	915,349.60	
	GENMAB A/S	907	2,643.00	2,397,201.00	
	H LUNDBECK A/S	120	224.40	26,928.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	23,899	444.50	10,623,105.50	
	DANSKE BANK A/S	9,894	113.45	1,122,474.30	
TRYG A/S	694	204.40	141,853.60		
ORSTED A/S	2,606	1,253.50	3,266,621.00		
	デンマーククローネ 小計	57,407		33,921,251.60 (576,322,064)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	30.75	92,619.00	
	OIL SEARCH LTD	32,812	4.35	142,732.20	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	5.11	134,944.88	
	SANTOS LTD	26,550	7.21	191,425.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	27.63	9,863.91	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	26.56	361,455.04	
	BHP GROUP LTD	41,230	46.13	1,901,939.90	

BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	17.01	106,414.56
EVOLUTION MINING LTD	16,140	4.62	74,566.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,433	24.32	569,890.56
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	37.78	251,463.68
NEWCREST MINING LTD	11,374	26.76	304,368.24
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	13.43	99,073.11
ORICA LTD	6,263	15.86	99,331.18
RIO TINTO LTD	5,096	119.32	608,054.72
SOUTH32 LTD	74,829	2.77	207,276.33
CIMIC GROUP LTD	682	25.94	17,691.08
BRAMBLES LTD	17,428	10.68	186,131.04
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.90	89,840.40
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	4.85	42,195.00
SYDNEY AIRPORT	22,505	5.89	132,554.45
TRANSURBAN GROUP	37,559	13.40	503,290.60
ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	31.25	284,656.25
CROWN RESORTS LTD	773	9.94	7,683.62
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	4.18	88,753.94
REA GROUP LTD	563	142.79	80,390.77
SEEK LTD	3,309	28.47	94,207.23
WESFARMERS LTD	15,132	53.41	808,200.12
COLES GROUP LTD	18,622	18.16	338,175.52
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,961	40.76	691,330.36
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	13.03	67,352.07
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	9.32	65,706.00
COCHLEAR LTD	1,060	197.90	209,774.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	62.70	172,425.00
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	35.10	255,177.00
CSL LTD	6,304	274.60	1,731,078.40
AUST AND NZ BANKING GROUP	37,603	24.64	926,537.92
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	24,511	85.09	2,085,640.99
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	46,101	24.12	1,111,956.12
WESTPAC BANKING CORP	47,676	21.78	1,038,383.28
AMP LTD	36,656	1.55	57,000.08
ASX LTD	3,256	71.61	233,162.16

	MACQUARIE GROUP LTD	4,578	137.10	627,643.80	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	47.73	74,315.61	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	5.00	176,455.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.95	99,173.10	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	24,270	8.45	205,081.50	
	SUNCORP GROUP LTD	19,255	10.45	201,214.75	
	LENDLEASE GROUP	8,292	12.50	103,650.00	
	AFTERPAY LTD	2,984	141.33	421,728.72	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	14.49	81,201.96	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	33.20	53,120.00	
	XERO LTD	1,891	136.99	259,048.09	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.20	231,555.20	
	TPG TELECOM LTD	287	7.45	2,138.15	
	AGL ENERGY LTD	7,599	11.78	89,516.22	
	APA GROUP	13,816	9.47	130,837.52	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.70	2,442.90	
	オーストラリアドル 小計	956,860		19,233,835.53 (1,542,553,609)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.36	164,054.40	
	A2 MILK CO LTD	7,857	10.90	85,641.30	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	35.10	232,923.60	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	15.71	86,499.26	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.83	110,803.69	
	MERCURY NZ LTD	7,200	7.30	52,560.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	8.08	185,508.72	
	ニュージーランドドル 小計	95,365		917,990.97 (68,583,105)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,000	56.50	2,203,500.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	21,500	121.60	2,614,400.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	20.15	604,500.00	
	MTR CORP	19,500	43.60	850,200.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	59.05	1,889,600.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	30.65	950,150.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	8.54	17,080.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	12.26	63,752.00	

	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	24.15	531,300.00	
	WH GROUP LTD	152,000	6.52	991,040.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	16.84	60,624.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	24.30	1,069,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	143.90	1,712,410.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,200	510.50	8,780,600.00	
	AIA GROUP LTD	168,200	100.40	16,887,280.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	40.75	1,630,000.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	26.20	765,040.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	20.80	561,600.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	32.30	449,486.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	37.10	964,600.00	
	SINO LAND CO	18,000	10.42	187,560.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	109.00	2,147,300.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	49.50	207,900.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	23.50	117,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	41.95	964,850.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.16	335,280.00	
	PCCW LTD	4,000	4.38	17,520.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	43.35	190,740.00	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	72.70	1,744,800.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.69	238,390.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	156,874	11.28	1,769,538.72	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	41.35	744,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	124.90	199,840.00	
	香港ドル 小計	1,077,990		52,461,881.52 (702,989,212)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.64	107,160.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.84	46,080.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	4.24	111,512.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.88	71,104.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	5.43	136,836.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,500	26.17	641,165.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,800	10.62	486,396.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,600	23.70	393,420.00	

	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	10.09	116,035.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	3.40	169,320.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.51	22,530.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.60	15,960.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	20.30	83,230.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.48	305,288.00	
	シンガポールドル 小計	443,800		2,706,036.00	(211,747,317)
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	4,122	17.45	71,928.90	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	431.00	164,211.00	
	BANK HAPOALIM BM	18,231	23.90	435,720.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	20.87	374,073.88	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	13.37	100,529.03	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	80.10	113,261.40	
	AZRIELI GROUP	234	203.10	47,525.40	
	NICE SYSTEMS LTD	960	874.90	839,904.00	
	イスラエルシュケル 小計	50,785		2,147,154.51	(68,129,212)
	合 計	14,638,071		67,279,123,884	(67,279,123,884)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(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	8,437	136,173.18	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	295,807.68	
		AMERICAN TOWER CORP	6,152	1,377,555.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	134,152.92	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	321,058.77	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,200	200,860.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	113,625.40	
		CROWN CASTLE INTL CORP	6,024	957,334.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	505,936.92	

	DUKE REALTY CORP	5,513	221,843.12	
	EQUINIX INC	1,170	843,757.20	
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	154,719.60	
	EQUITY RESIDENTIAL	5,175	318,573.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	970	236,146.50	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,920	221,587.20	
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	229,549.08	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	151,309.06	
	INVITATION HOMES INC	7,683	230,643.66	
	IRON MOUNTAIN INC	4,068	122,650.20	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	127,360.04	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,702	228,374.36	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	83,810.10	
	PROLOGIS INC	10,311	1,043,679.42	
	PUBLIC STORAGE	2,131	474,765.49	
	REALTY INCOME CORP	4,769	285,376.96	
	REGENCY CENTERS CORP	1,514	71,052.02	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	411,792.10	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	406,596.42	
	SUN COMMUNITIES INC	1,389	204,099.66	
	UDR INC	3,355	131,214.05	
	VENTAS INC	5,547	272,524.11	
	VEREIT INC	2,220	79,276.20	
	VICI PROPERTIES INC	7,940	209,536.60	
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	47,716.10	
	WELLTOWER INC	5,753	362,841.71	
	WEYERHAEUSER CO	10,330	343,059.30	
	WP CAREY INC	2,436	163,869.72	
	米ドル 小計	169,000	11,720,227.77 (1,217,028,451)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	48,697.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	26,851.50	
	カナダドル 小計	2,480	75,548.50 (6,170,045)	
ユーロ	COVIVIO	522	35,704.80	
		569	66,629.90	

	GECINA SA			
	KLEPIERRE	1,289	21,861.44	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	129,880.14	
	ユーロ 小計	4,661	254,076.28	(32,107,619)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	60,904.80	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	42,168.26	
	SEGRE PLC	18,596	181,162.23	
	英ポンド 小計	39,086	284,235.29	(40,392,677)
オーストラリアドル	DEXUS	13,745	126,179.10	
	GOODMAN GROUP	23,275	413,131.25	
	GPT GROUP	32,860	143,598.20	
	MIRVAC GROUP	63,099	159,640.47	
	SCENTRE GROUP	83,252	238,100.72	
	STOCKLAND	29,890	135,700.60	
	VICINITY CENTRES	42,168	65,149.56	
	オーストラリアドル 小計	288,289	1,281,499.90	(102,776,291)
香港ドル	LINK REIT	31,300	2,151,875.00	
	香港ドル 小計	31,300	2,151,875.00	(28,835,125)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	129,269.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	169,084.80	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	50,140.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	77,770.00	
	SUNTEC REIT	8,500	13,005.00	
	シンガポールドル 小計	185,460	439,268.80	(34,372,783)
	合計		1,461,682,991	(1,461,682,991)

(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 592銘柄	97.5%		70.2%
	投資証券 37銘柄		2.5%	1.8%
カナダドル	株式 86銘柄	99.7%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.3%	0.0%
ユーロ	株式 235銘柄	99.6%		10.6%
	投資証券 4銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式 86銘柄	98.8%		4.7%
	投資証券 3銘柄		1.2%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.2%
スウェーデンクローナ	株式 38銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 19銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	93.8%		2.2%
	投資証券 7銘柄		6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 33銘柄	96.1%		1.0%
	投資証券 1銘柄		3.9%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.0%		0.3%
	投資証券 5銘柄		14.0%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,154,304,402
コール・ローン	67,768,477
株式	11,503,556,613
投資証券	9,245,907
派生商品評価勘定	207,568,478
未収配当金	2,070,130
差入委託証拠金	947,628,783
流動資産合計	13,892,142,790
資産合計	
13,892,142,790	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	156,507
未払解約金	35,568,000
未払利息	183
その他未払費用	1
流動負債合計	35,724,691
負債合計	
35,724,691	
純資産の部	
元本等	
元本	8,352,954,743
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,503,463,356
元本等合計	13,856,418,099
純資産合計	
13,856,418,099	
負債純資産合計	
13,892,142,790	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月28日
期首元本額	7,682,410,355円
期中追加設定元本額	7,723,340,015円
期中一部解約元本額	7,052,795,627円
期末元本額	8,352,954,743円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	515,406,963円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	968,977,413円
りそなラップ型ファンド(成長型)	957,416,691円
DCりそな グローバルバランス	8,925,591円
つみたてバランスファンド	357,193,819円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	295,856,310円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	153,540,142円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	91,586,088円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,141,960円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	9,063,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,454,328円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,111,418円
リスクコントロール・オープン	6,667,110円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	87,528,566円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	13,968,701円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,140,237,769円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,130,924,356円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,522,240円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	103,545,348円
Smart-i 8資産バランス 成長型	116,502,402円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	331,999,735円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	338,419,501円

りそな・リスクコントロールファンド2019-10	197,492,813円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	117,869,840円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	296,238,342円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	49,372,789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)	991,422円
2. 計算日における受益権の総数	8,352,954,743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	1.6589円
(10,000口当たり純資産額)	(16,589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

2021年 1月25日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用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

2021年 1月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,431,919,028
投資証券		2,382,723
合計		2,429,536,305

(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)

(2021年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,118,429,456	-	2,325,841,548	207,412,092
	合計	2,118,429,456	-	2,325,841,548	207,412,092

(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)

(2021年 1月25日現在)

(単位: 円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	36,627	-	35,881	746
	米ドル	36,627	-	35,881	746
	売建	36,627	-	36,002	625
	ブラジルリアル	36,627	-	36,002	625
	合計	73,254	-	71,883	121

(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

			評価額	
--	--	--	-----	--

通貨	銘柄	株式数	単価	金額	備考
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	79,958	5.70	455,760.60	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,577	76.14	424,632.78	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,253	179.80	225,289.40	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	16,741	6.50	108,950.42	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	4.59	67,577.74	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,326	40.30	134,037.80	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	3.49	6,631.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	10.49	33,494.57	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	8,612	34.99	301,333.88	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,840	29.24	53,801.60	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	15.20	35,659.20	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	875	98.75	86,406.25	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	17.63	56,416.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,085	71.02	77,056.70	
	51JOB INC-ADR	300	68.88	20,664.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,600	33.04	185,024.00	
	NIO INC - ADR	16,900	61.95	1,046,955.00	
	XPENG INC - ADR	2,200	56.39	124,058.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	1,000	92.00	92,000.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,200	48.00	105,600.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	2,050	169.11	346,675.50	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	5,100	76.00	387,600.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,350	58.72	314,152.00	
	AUTOHOME INC-ADR	820	110.37	90,503.40	
	BAIDU INC - SPON ADR	3,650	252.75	922,537.50	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,500	133.75	200,625.00	
	DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	12.81	20,496.00	
	HUYA INC-ADR	900	24.03	21,627.00	
	IQIYI INC-ADR	3,700	20.62	76,294.00	
	JOYY INC	720	91.00	65,520.00	
	MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	26.00	43,966.00	
	MOMO INC-SPON ADR	1,950	15.72	30,654.00	
NETEASE INC-ADR	5,510	116.76	643,347.60		
SINA CORP	630	43.08	27,140.40		

	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,600	27.02	124,292.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	630	42.96	27,064.80	
	YANDEX NV-A	4,000	66.44	265,760.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	24,830	258.62	6,421,534.60	
	BAOZUN INC-SPN ADR	900	34.80	31,320.00	
	JD.COM INC-ADR	11,420	94.91	1,083,872.20	
	PINDUODUO INC-ADR	5,000	171.89	859,450.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	6,450	33.58	216,591.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	6,100	29.41	179,401.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	5,297	15.54	82,315.38	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	37.36	70,199.44	
	BEIGENE LTD-ADR	600	374.50	224,700.00	
	HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	900	34.13	30,717.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	900	181.76	163,584.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	18,976	3.95	75,050.08	
	CREDICORP LTD	844	154.84	130,684.96	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	35,132	14.27	501,333.64	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.94	20,897.44	
	LUFAX HOLDING LTD	2,100	15.45	32,445.00	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	49.58	24,790.00	
	KE HOLDINGS INC	1,200	71.45	85,740.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.79	8,023.68	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,200	112.82	135,384.00	
	GLOBANT SA	521	207.12	107,909.52	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	53.81	48,429.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,000	9.05	63,350.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	6.28	5,463.60	
	米ドル 小計	382,918		17,852,789.68	(1,853,833,680)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	189,600	12.34	2,339,664.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	42,200	90.21	3,806,862.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	316.00	584,600.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	46.44	659,448.00	
	ALFA S.A.B.-A	34,600	13.04	451,184.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	61.17	452,658.00	

	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,100	205.66	1,048,866.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	319.17	967,085.10	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	162.04	445,610.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	33,900	34.32	1,163,448.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	73.99	162,778.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	70,200	60.27	4,230,954.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	94.53	453,744.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	49.01	259,753.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	92.45	716,025.25	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,100	146.90	3,834,090.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	231.86	661,960.30	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	20,400	42.16	860,064.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	35.82	591,030.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	34,800	107.72	3,748,656.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	30,800	19.22	591,976.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	452,000	14.29	6,459,080.00	
	TELESITES SAB DE CV	19,700	21.43	422,171.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	74.79	463,698.00	
	メキシコペソ 小計	1,034,230		35,375,404.65 (184,305,858)	
ブラジルリアル	COSAN SA	2,000	77.00	154,000.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	49,500	27.73	1,372,635.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	63,200	27.09	1,712,088.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	21.91	227,864.00	
	BRADSPAR SA -PREF	3,300	70.87	233,871.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	33.98	336,402.00	
	GERDAU SA-PREF	15,200	25.36	385,472.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,200	28.73	293,046.00	
	SUZANO SA	10,207	64.36	656,922.52	
	VALE SA	48,800	93.17	4,546,696.00	
	WEG SA	11,550	88.97	1,027,603.50	
	CCR SA	13,400	12.51	167,634.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	8,010	67.51	540,755.10	
	RUMO SA	17,100	20.85	356,535.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,700	40.46	109,242.00	

B2W CIA DIGITAL	2,800	89.31	250,068.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	11,200	24.77	277,424.00	
LOJAS RENNER S.A.	9,800	41.02	401,996.00	
MAGAZINE LUIZA SA	39,000	25.99	1,013,610.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	9,600	20.90	200,640.00	
VIA VAREJO SA	15,900	14.19	225,621.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	19.04	57,120.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	75.41	128,197.00	
RAIA DROGASIL SA	14,000	25.04	350,560.00	
AMBEV SA	63,100	15.15	955,965.00	
BRF SA	5,900	20.69	122,071.00	
JBS SA	13,600	24.51	333,336.00	
NATURA &CO HOLDING SA	12,000	49.33	591,960.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	17.38	298,936.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,000	97.54	585,240.00	
HYPERA SA	4,000	34.65	138,600.00	
BANCO BRADESCO S.A.	18,120	21.92	397,190.40	
BANCO BRADESCO SA-PREF	58,890	25.01	1,472,838.90	
BANCO DO BRASIL S.A.	10,700	33.69	360,483.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	40.60	178,640.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,200	29.27	1,879,134.00	
ITAUSA SA	59,400	10.88	646,272.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	27,800	58.55	1,627,690.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,400	92.88	315,792.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	28.42	278,516.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	4,358	39.94	174,058.52	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	20.38	44,836.00	
TOTVS SA	7,200	30.07	216,504.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	5,600	44.14	247,184.00	
TIM SA	9,000	13.23	119,070.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	30.58	103,972.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	30.24	148,176.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,119	13.80	194,842.20	
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	65.31	71,841.00	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	40.98	204,900.00	

	CPFL ENERGIA SA	2,300	30.48	70,104.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	47.66	95,320.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	43.33	98,575.75	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,900	22.00	261,800.00	
	ブラジルリアル 小計	836,329		27,259,849.89	(517,391,950)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	8,110.00	46,186,450.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	2,110.00	31,276,530.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,512	40,890.00	61,825,680.00	
	FALABELLA SA	10,992	2,663.40	29,276,092.80	
	CENCOSUD SA	18,824	1,383.70	26,046,768.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,935.00	10,297,225.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,990.00	5,671,500.00	
	BANCO DE CHILE	601,649	76.00	45,725,324.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	594	30,600.00	18,176,400.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	38.00	36,545,512.00	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,165.00	6,063,825.00	
	COLBUN SA	83,944	127.19	10,676,837.36	
	ENEL AMERICAS SA	443,665	113.10	50,178,511.50	
	ENEL CHILE SA	369,172	57.81	21,341,833.32	
	チリペソ 小計	2,522,384		399,288,489.78	(56,938,538)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,354.00	167,190,496.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	31,160.00	79,208,720.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,980	31,800.00	190,164,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	24,360.00	63,043,680.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	26,000.00	172,718,000.00	
	コロンビアペソ 小計	88,777		672,324,896.00	(19,833,584)
ユーロ	OPAP SA	2,135	10.50	22,417.50	
	JUMBO SA	1,515	12.91	19,558.65	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	12.62	41,545.04	
	ユーロ 小計	6,942		83,521.19	(10,554,572)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	3,050	16.88	51,499.25	

	英ポンド 小計	3,050		51,499.25 (7,318,558)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	106.80	187,434.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	14.85	337,703.85
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	18.39	145,464.90
	KOC HOLDING AS	8,691	22.02	191,375.82
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	7.81	132,770.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	12.89	70,895.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	158.70	84,269.70
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,969	74.05	442,004.45
	AKBANK T.A.S.	43,035	6.72	289,195.20
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	9.76	309,596.96
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	6.66	166,759.74
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	3.11	92,093.32
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	11.11	133,975.49
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	16.56	316,146.96
	トルコリラ 小計	230,654		2,899,685.39 (40,624,592)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	672.00	503,328.00
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	67.10	472,719.50
	CEZ AS	2,147	528.00	1,133,616.00
	チェココルナ 小計	9,941		2,109,663.50 (10,210,771)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,238.00	12,150,102.00
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	8,160.00	16,532,160.00
	OTP BANK PLC	2,819	13,600.00	38,338,400.00
	ハンガリーフォリント 小計	10,274		67,020,662.00 (23,691,804)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,010	59.68	239,316.80
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	19,031	5.84	111,179.10
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,815	187.85	340,947.75
	LPP SA	19	7,865.00	149,435.00
	CD PROJEKT SA	857	250.10	214,335.70
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	30.82	98,377.44
	ALLEGRO.EU SA	3,100	72.70	225,370.00

	DINO POLSKA SA	707	270.20	191,031.40
	BANK PEKAO SA	2,676	65.26	174,635.76
	PKO BANK POLSKI SA	11,255	29.67	333,935.85
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	193.90	104,318.20
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,829	30.59	239,489.11
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.26	29,415.74
	PGE SA	9,929	7.00	69,582.43
	ポーランドズロチ 小計	69,657		2,521,370.28 (70,194,948)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	8.85	247,800.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	330,000	3.96	1,306,800.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	43,000	15.36	660,480.00
	CNOOC LTD	239,000	7.80	1,864,200.00
	PETROCHINA CO LTD-H	268,000	2.53	678,040.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	6.52	91,280.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	2.60	171,600.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	48.50	848,750.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	26,000	7.05	183,300.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	5.62	269,760.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	9.97	478,560.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	8.88	319,680.00
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	14.32	214,800.00
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	6.62	145,640.00
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	11.96	239,200.00
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	17.12	162,640.00
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	8.85	115,050.00
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	74,000	9.62	711,880.00
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	7.34	322,960.00
	BOC AVIATION LTD	3,500	63.45	222,075.00
	CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.69	103,320.00
	CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	38.30	804,300.00
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	13.36	173,680.00
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	3.79	166,760.00
	CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	4.62	138,600.00
	CITIC LTD	77,000	6.14	472,780.00

FOSUN INTERNATIONAL LTD	34,500	11.86	409,170.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	29.15	233,200.00
HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	8,000	3.75	30,000.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	23.50	188,000.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	26,000	21.25	552,500.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	18.40	235,520.00
ZHUZHOU CRRR TIMES ELECTRI-H	6,700	42.95	287,765.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	11.02	215,992.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	7,250	36.50	264,625.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	41,000	4.77	195,570.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	19,000	68.30	1,297,700.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	9.48	189,600.00
AIR CHINA LTD-H	30,000	5.39	161,700.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.78	115,600.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	11.14	200,520.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.20	109,200.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	39,000	10.40	405,600.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	5.63	101,340.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.89	177,800.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15,500	13.20	204,600.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.69	120,420.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	6.47	219,980.00
BYD CO LTD-H	8,500	254.60	2,164,100.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	8.52	272,640.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	7,600	56.50	429,400.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	80,000	32.00	2,560,000.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	43,000	26.15	1,124,450.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	40,000	8.08	323,200.00
MINTH GROUP LTD	10,000	38.80	388,000.00
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	16,000	20.35	325,600.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	15,000	136.90	2,053,500.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	3.83	206,820.00
HAIER SMART HOME CO LTD-H	28,800	35.50	1,022,400.00
LI NING CO LTD	28,500	50.50	1,439,250.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,300	154.80	1,749,240.00

CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	17.10	102,600.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	11,000	17.62	193,820.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.31	87,720.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10,000	67.05	670,500.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	27.50	68,750.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.00	140,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,200	54.90	230,580.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	75,600	691.00	52,239,600.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	28.10	224,800.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	1.18	164,020.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	3,000	168.00	504,000.00	
MEITUAN	47,500	380.20	18,059,500.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	13.96	201,024.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	12.48	174,720.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,000	49.60	396,800.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	7.60	239,400.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	113.67	125,037.00	
CHINA FEIHE LTD	16,000	24.80	396,800.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	37,000	46.30	1,713,100.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	20,000	69.20	1,384,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.74	144,570.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	7,000	84.50	591,500.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	13.60	353,600.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	75.90	455,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	9.02	135,300.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.40	388,800.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	136.00	816,000.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	9,000	55.40	498,600.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	24.90	99,600.00	
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	14.92	59,680.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	54,000	27.80	1,501,200.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	17.22	344,400.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	11,000	58.55	644,050.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	92.15	663,480.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	15.04	481,280.00	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	14.04	158,652.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	17,600	19.14	336,864.00	
3SBIO INC	13,000	7.62	99,060.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	258.00	154,800.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	10.22	163,520.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.41	48,510.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.98	95,520.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	124,000	8.60	1,066,400.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	11.02	198,360.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	189.10	359,290.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	16,000	45.45	727,200.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	13,500	99.60	1,344,600.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	3.91	68,425.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	170.00	357,000.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	37.85	227,100.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	142,250	7.98	1,135,155.00	
SSY GROUP LTD	10,000	4.65	46,500.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	3,624	204.00	739,296.00	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	40,500	121.30	4,912,650.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	2.93	1,125,120.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,059,000	2.71	2,869,890.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	111,000	4.37	485,070.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	4.35	171,825.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	115,000	3.48	400,200.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,273,000	6.06	7,714,380.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	3.30	155,100.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	52,500	58.95	3,094,875.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	4.68	351,468.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.44	61,920.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	810,000	5.04	4,082,400.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.27	658,750.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.54	161,700.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	10.94	153,160.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	5.20	291,200.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.96	98,880.00	

CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,600	23.05	405,680.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,500	18.92	539,220.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.07	234,030.00
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	12.24	190,944.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	7.30	318,280.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	13.38	232,812.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	100,000	17.40	1,740,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	37,800	34.75	1,313,550.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	15.42	376,248.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	10,700	31.20	333,840.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.52	317,520.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	86,000	6.02	517,720.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	78,500	97.50	7,653,750.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	5,200	44.05	229,060.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	10.10	181,800.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	7.82	109,480.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	15.68	376,320.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	74,000	3.86	285,640.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	53,500	18.68	999,380.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	5.38	80,700.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	33.50	1,474,000.00
CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	29.55	653,055.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	7.13	299,460.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	106,000	10.12	1,072,720.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	11.48	172,200.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	9.93	262,152.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,000	22.40	268,800.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	4.11	152,070.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	11.68	163,520.00
LOGAN GROUP CO LTD	19,000	12.76	242,440.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,000	44.50	1,112,500.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	68.65	82,380.00
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	7.42	178,080.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.73	141,960.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	16,000	24.00	384,000.00

	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	36,000	32.80	1,180,800.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	20,000	18.00	360,000.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	104,000	1.56	162,240.00	
	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	5.00	60,000.00	
	CHINA YOUZAN LTD	204,000	4.00	816,000.00	
	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	34,000	33.45	1,137,300.00	
	KINGSOFT CORP LTD	10,000	61.90	619,000.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	18.82	244,660.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,500	45.35	430,825.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	9,000	56.00	504,000.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	9,500	32.85	312,075.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	13.58	224,070.00	
	LENOVO GROUP LTD	92,000	9.27	852,840.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	9,700	216.20	2,097,140.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	188,000	29.80	5,602,400.00	
	ZTE CORP-H	8,800	22.20	195,360.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	614,000	1.19	730,660.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	26.35	158,100.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.28	190,240.00	
	CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.91	210,100.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	36,200	29.55	1,069,710.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	49,000	12.60	617,400.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.74	102,660.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	40.55	486,600.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	8.70	226,200.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,900	126.60	1,379,940.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	38,000	13.94	529,720.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	2.93	152,360.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	52,000	7.13	370,760.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	52.55	262,750.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	19.06	991,120.00	
	香港ドル 小計	11,412,624		195,070,349.00	(2,613,942,676)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	50,000	3.26	163,000.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	20.20	58,580.00	

PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	30,700	7.35	225,645.00	
PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	8.69	145,123.00	
GAMUDA BHD	21,000	3.53	74,130.00	
HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	7.97	60,572.00	
SIME DARBY BERHAD	33,100	2.26	74,806.00	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.20	67,080.00	
MISC BHD	17,600	6.39	112,464.00	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.40	29,920.00	
GENTING BHD	32,900	4.00	131,600.00	
GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.40	78,240.00	
FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	31.24	65,604.00	
GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.66	28,980.00	
IOI CORP BHD	32,500	4.36	141,700.00	
KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	23.48	150,272.00	
NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	138.00	138,000.00	
PPB GROUP BERHAD	8,220	18.84	154,864.80	
QL RESOURCES BHD	17,150	6.00	102,900.00	
SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	4.98	151,392.00	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	12.32	291,984.00	
IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.20	165,360.00	
KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	4.19	69,554.00	
SUPERMAX CORP BHD	19,217	6.53	125,487.01	
TOP GLOVE CORP BHD	66,500	6.25	415,625.00	
AMMB HOLDINGS BHD	23,400	3.34	78,156.00	
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	80,200	3.98	319,196.00	
HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	17.56	126,432.00	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	16.68	30,024.00	
MALAYAN BANKING BHD	53,700	8.00	429,600.00	
PUBLIC BANK BERHAD	39,100	21.66	846,906.00	
RHB BANK BHD	18,100	5.34	96,654.00	
AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.46	105,184.00	
DIGI.COM BHD	39,700	4.00	158,800.00	
MAXIS BHD	30,200	4.93	148,886.00	
TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	6.00	110,400.00	
PETRONAS GAS BHD	10,400	16.56	172,224.00	

	TENAGA NASIONAL BHD	29,400	9.78	287,532.00	
	マレーシアリングット 小計	905,387		6,132,876.81 (157,369,618)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	20,000	111.50	2,230,000.00	
	PTT PCL-NVDR	154,400	39.50	6,098,800.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	55.50	732,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	36.75	606,375.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	61.25	2,009,000.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	10,800	393.00	4,244,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	59,300	59.75	3,543,175.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	8.25	738,375.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	9.65	1,018,075.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.68	291,096.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	26.25	1,275,750.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	32.25	665,156.25	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	14.00	1,233,400.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	35.50	585,750.00	
	CP ALL PCL-NVDR	79,400	58.00	4,605,200.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	28.25	1,601,775.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	34.50	224,250.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	14.20	690,120.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	132,600	21.10	2,797,860.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	125.00	750,000.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	39.75	532,650.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	122.50	955,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	21,300	129.00	2,747,700.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	12.20	305,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	94.50	935,550.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	21.10	386,130.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	63.50	520,700.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	65.50	497,800.00		
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	66.25	596,250.00		
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	52.75	1,550,850.00		
LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	8.10	780,840.00		
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,100	544.00	2,774,400.00		

	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,600	177.00	2,938,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	57.75	1,651,650.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	9,700	33.25	322,525.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.32	282,532.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	51.75	491,625.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	187.00	748,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	61.75	1,105,325.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	79.25	578,525.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	32,200	33.75	1,086,750.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	50.75	568,400.00	
	タイパーツ 小計	1,541,325		58,298,059.25	(201,711,285)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	43.45	1,014,992.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	809.50	3,068,005.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	555.00	865,800.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,131	72.95	2,927,556.45	
	SM INVESTMENTS CORP	3,185	1,035.00	3,296,475.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	128.50	1,503,450.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	186.70	1,297,565.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	38.45	365,275.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,280	149.00	1,978,720.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	81.00	2,139,210.00	
	BDO UNIBANK INC	28,100	111.10	3,121,910.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	46.60	1,286,719.20	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.30	623,500.00	
	AYALA LAND INC	105,400	39.45	4,158,030.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	4.02	393,960.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	128,800	37.60	4,842,880.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,060.00	927,000.00	
	PLDT INC	980	1,390.00	1,362,200.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	26.00	416,000.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	285.00	894,900.00	
	フィリピンペソ 小計	693,348		36,484,147.65	(78,805,758)
インドネシアル	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,350.00	203,715,000.00	

ピア

UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	25,175.00	556,367,500.00	
BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	1,020.00	385,050,000.00	
INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	13,000.00	349,700,000.00	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	15,200.00	352,640,000.00	
MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,420.00	388,410,000.00	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	12,150.00	391,230,000.00	
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	250,800	6,700.00	1,680,360,000.00	
ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,595.00	79,750,000.00	
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	108,300	6,350.00	687,705,000.00	
GUDANG GARAM TBK PT	6,600	40,850.00	269,610,000.00	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	9,475.00	309,832,500.00	
INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	6,675.00	321,735,000.00	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	7,275.00	732,592,500.00	
KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,615.00	365,797,500.00	
BANK CENTRAL ASIA TBK PT	132,200	35,400.00	4,679,880,000.00	
BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	230,800	7,200.00	1,661,760,000.00	
BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	6,275.00	662,012,500.00	
BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	740,200	4,720.00	3,493,744,000.00	
SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,000.00	347,300,000.00	
TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	665,000	3,390.00	2,254,350,000.00	
PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,680.00	220,920,000.00	
インドネシアルピア 小計	3,969,600		20,394,461,500.00 (150,919,015)	
韓国ウォン				
GS HOLDINGS	490	39,050.00	19,134,500.00	
S-OIL CORP	483	73,000.00	35,259,000.00	
SK INNOVATION CO LTD	750	278,000.00	208,500,000.00	
HANWHA SOLUTIONS CORP	1,444	56,700.00	81,874,800.00	
HYUNDAI STEEL CO	1,255	44,700.00	56,098,500.00	
KOREA ZINC CO LTD	121	427,000.00	51,667,000.00	
KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	190,500.00	41,529,000.00	
LG CHEM LTD	607	975,000.00	591,825,000.00	
LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	494,000.00	43,472,000.00	
LOTTE CHEMICAL CORP	239	289,000.00	69,071,000.00	
POSCO	989	261,000.00	258,129,000.00	
POSCO CHEMICAL CO LTD	286	139,500.00	39,897,000.00	

SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	410,500.00	45,155,000.00	
CJ CORP	193	106,000.00	20,458,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	27,500.00	14,135,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	580	33,200.00	19,256,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	2,846	13,400.00	38,136,400.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	42,550.00	35,699,450.00	
HANWHA CORPORATION	800	34,500.00	27,600,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	44,400.00	38,539,200.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	266,000.00	29,260,000.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	31,000.00	31,000,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	105,000.00	58,485,000.00	
LG CORP	1,224	107,000.00	130,968,000.00	
LOTTE CORP	242	36,400.00	8,808,800.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,073	146,000.00	156,658,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	13,350.00	32,106,750.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	6,770.00	46,760,390.00	
SK HOLDINGS CO LTD	454	328,000.00	148,912,000.00	
S-1 CORPORATION	228	84,300.00	19,220,400.00	
CJ LOGISTICS	135	171,000.00	23,085,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	211,000.00	46,209,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	34,950.00	33,377,250.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	5,120.00	16,778,240.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	44,050.00	42,552,300.00	
HANON SYSTEMS	2,393	18,000.00	43,074,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	885	350,000.00	309,750,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,979	257,000.00	508,603,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	464	117,500.00	54,520,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	122,000.00	40,992,000.00	
KIA MOTORS CORP	3,506	87,800.00	307,826,800.00	
COWAY CO LTD	531	73,500.00	39,028,500.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	45,800.00	29,953,200.00	
HLB INC	571	90,700.00	51,789,700.00	
LG ELECTRONICS INC	1,352	177,500.00	239,980,000.00	
KANGWON LAND INC	1,387	25,300.00	35,091,100.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	20,050.00	21,052,500.00	

KAKAO CORP	760	463,000.00	351,880,000.00	
NAVER CORP	1,629	343,500.00	559,561,500.00	
NCSOFT CORP	220	989,000.00	217,580,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	127,000.00	34,417,000.00	
PEARL ABYSS CORP	70	271,800.00	19,026,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	163,800.00	18,509,400.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	88,100.00	35,856,700.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	116,000.00	9,280,000.00	
SHINSEGAE INC	109	251,000.00	27,359,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	152,000.00	8,664,000.00	
E-MART INC	257	174,000.00	44,718,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	35,800.00	6,981,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	443,500.00	39,028,000.00	
KT&G CORP	1,569	81,200.00	127,402,800.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	121,500.00	30,496,500.00	
OTTOGI CORPORATION	13	569,000.00	7,397,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	422	238,000.00	100,436,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	64,100.00	27,498,900.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	125	1,562,000.00	195,250,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	709,000.00	21,979,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	852	144,600.00	123,199,200.00	
ALTEOGEN INC	240	147,000.00	35,280,000.00	
CELLTRION INC	1,291	310,000.00	400,210,000.00	
CELLTRION PHARM INC	238	178,000.00	42,364,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	362,000.00	31,494,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	227	794,000.00	180,238,000.00	
SEEGENE INC	240	171,400.00	41,136,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	99,900.00	39,960,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	227	150,500.00	34,163,500.00	
YUHAN CORP	539	72,400.00	39,023,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	4,027	36,350.00	146,381,450.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	8,480.00	21,971,680.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	5,250	44,050.00	231,262,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,544	32,850.00	182,120,400.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	9,520.00	70,571,760.00	

	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	557	86,800.00	48,347,600.00	
	MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,540.00	8,202,180.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,302	9,800.00	42,159,600.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	11,600.00	17,864,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	517	32,200.00	16,647,400.00	
	SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	41,050.00	33,825,200.00	
	DB INSURANCE CO LTD	726	40,000.00	29,040,000.00	
	HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	968	20,950.00	20,279,600.00	
	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	381	180,000.00	68,580,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	77,200.00	74,575,200.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	190	109,500.00	20,805,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	430	202,000.00	86,860,000.00	
	KMW CO LTD	357	78,100.00	27,881,700.00	
	LG DISPLAY CO LTD	3,338	23,550.00	78,609,900.00	
	LG INNOTEK CO LTD	153	200,000.00	30,600,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	724	212,500.00	153,850,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	62,780	86,800.00	5,449,304,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	10,879	77,600.00	844,210,400.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	731	792,000.00	578,952,000.00	
	LG UPLUS CORP	2,330	12,150.00	28,309,500.00	
	SK TELECOM	534	254,000.00	135,636,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,411	24,150.00	82,375,650.00	
	KOREA GAS CORPORATION	525	34,100.00	17,902,500.00	
	SK HYNIX INC	7,250	128,500.00	931,625,000.00	
	韓国ウォン 小計	191,572		16,570,417,100.00 (1,560,933,290)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	15,000	94.50	1,417,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	40.75	1,263,250.00	
	CHINA STEEL CORP	150,000	23.65	3,547,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	45,000	80.70	3,631,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	52,000	90.60	4,711,200.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	70,000	69.20	4,844,000.00	
	TAIWAN CEMENT	61,477	40.60	2,495,966.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	1,145.00	2,290,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	26.40	1,029,600.00	

HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,174	452.50	1,436,235.00	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	35.00	1,104,250.00	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	29.15	641,300.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	22,000	42.00	924,000.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	406.00	820,120.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	185.50	1,127,840.00	
GIANT MANUFACTURING	4,000	285.00	1,140,000.00	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	381.00	762,000.00	
POU CHEN	34,000	28.50	969,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	610.00	2,440,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	266.50	2,132,000.00	
STANDARD FOODS CORP	3,120	54.90	171,288.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	66.70	4,335,500.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	207.00	621,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	17.00	1,217,472.00	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	238,000	19.20	4,569,600.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	140,906	24.30	3,424,015.80	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	130,627	20.40	2,664,790.80	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	107,416	17.45	1,874,409.20	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	149,000	28.60	4,261,400.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	11.10	1,609,444.50	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	118,769	12.70	1,508,366.30	
TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.26	737,762.72	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	118,374	19.50	2,308,293.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	49,000	39.00	1,911,000.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,997	168.00	2,687,496.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	125,920	20.75	2,612,840.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	99,000	40.55	4,014,450.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	176,000	9.04	1,591,040.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	22.55	629,122.45	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	84,000	46.25	3,885,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	8.23	1,274,292.05	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,600	43.10	284,460.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	39.60	375,408.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	291.50	2,040,500.00	

ACER INC	38,000	23.90	908,200.00
ADVANTECH CO LTD	5,299	346.00	1,833,454.00
ASUSTEK COMPUTER INC	9,000	284.50	2,560,500.00
AU OPTRONICS CORP	122,000	14.50	1,769,000.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	204.00	1,836,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	87.70	439,815.50
COMPAL ELECTRONICS	46,000	21.30	979,800.00
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	291.00	7,566,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	75.60	1,058,400.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	165,800	121.50	20,144,700.00
INNOLUX CORP	90,000	13.60	1,224,000.00
INVENTEC CORP	28,000	23.10	646,800.00
LARGAN PRECISION CO LTD	1,350	2,940.00	3,969,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	27,000	53.00	1,431,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	133.50	1,335,000.00
PEGATRON CORP	26,000	77.60	2,017,600.00
QUANTA COMPUTER INC	37,000	82.40	3,048,800.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	46.80	795,600.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	101.00	1,717,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	231.50	1,157,500.00
WISTRON CORP	29,951	30.70	919,495.70
WIWYNN CORP	1,000	868.00	868,000.00
WPG HOLDINGS LTD	17,960	43.45	780,362.00
YAGEO CORPORATION	5,198	608.00	3,160,384.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	117.00	702,000.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	108.50	5,533,500.00
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	60.40	1,449,600.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	21,000	96.70	2,030,700.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	105.00	4,305,000.00
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,855.00	927,500.00
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	716.00	2,148,000.00
MEDIATEK INC	20,000	917.00	18,340,000.00
NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	85.40	1,451,800.00
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	423.00	2,961,000.00
PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	414.00	414,000.00

	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	103.50	1,035,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	496.00	2,976,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	2,650.00	2,650,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	324,000	649.00	210,276,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	146,000	56.50	8,249,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	123.00	1,476,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	457.50	1,830,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	28.00	1,176,000.00	
	新台湾ドル 小計	4,219,600		421,433,723.22 (1,563,519,113)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	8,598	396.05	3,405,237.90	
	COAL INDIA LTD	16,101	133.20	2,144,653.20	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	225.40	1,828,444.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	95.70	2,342,161.80	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	92.75	2,456,947.50	
	PETRONET LNG LTD	7,875	241.40	1,901,025.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	37,549	2,049.60	76,960,430.40	
	ACC LTD	1,105	1,694.85	1,872,809.25	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	257.70	1,994,598.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,129	2,596.65	13,318,217.85	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	773.40	2,041,002.60	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	1,004.00	3,244,928.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,528	239.20	5,149,497.60	
	JSW STEEL LTD	9,306	375.40	3,493,472.40	
	PI INDUSTRIES LTD	1,184	2,154.80	2,551,283.20	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	1,735.25	3,694,347.25	
	SHREE CEMENT LTD	150	23,694.30	3,554,145.00	
	TATA STEEL LTD	9,239	647.00	5,977,633.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,426	5,534.80	7,892,624.80	
	UPL LTD	5,324	566.95	3,018,441.80	
	VEDANTA LTD	19,986	165.55	3,308,682.30	
HAVELLS INDIA LTD	2,780	1,122.65	3,120,967.00		
LARSEN & TOUBRO LTD	9,499	1,362.10	12,938,587.90		
SIEMENS LTD	766	1,663.85	1,274,509.10		
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,672	535.80	3,574,857.60		

CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	428.65	1,760,894.20
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,642.30	2,133,347.70
BAJAJ AUTO LTD	881	4,089.50	3,602,849.50
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	1,678.50	2,039,377.50
BHARAT FORGE LTD	3,030	629.40	1,907,082.00
EICHER MOTORS LTD	1,839	2,972.60	5,466,611.40
HERO MOTOCORP LTD	1,613	3,374.90	5,443,713.70
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,773	798.40	8,601,163.20
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,802	8,048.85	14,504,027.70
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	12,820	156.25	2,003,125.00
MRF LTD	27	92,305.95	2,492,260.65
TATA MOTORS LTD	22,991	289.35	6,652,445.85
PAGE INDUSTRIES LTD	54	29,349.60	1,584,878.40
TITAN CO LTD	4,773	1,491.20	7,117,497.60
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	2,746.20	3,078,490.20
INFO EDGE INDIA LTD	964	5,342.00	5,149,688.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	219.30	2,043,218.10
TRENT LTD	2,541	660.50	1,678,330.50
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,002	2,862.75	5,731,225.50
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,464	3,608.00	5,282,112.00
ITC LTD	39,545	210.70	8,332,131.50
NESTLE INDIA LTD	452	17,589.60	7,950,499.20
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,154	584.75	4,768,051.50
UNITED SPIRITS LTD	3,058	625.05	1,911,402.90
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,519.80	2,560,863.00
DABUR INDIA LTD	7,196	532.95	3,835,108.20
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	790.05	4,250,469.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,853	2,409.35	26,148,675.55
MARICO LTD	7,098	418.75	2,972,287.50
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,300	2,597.90	3,377,270.00
AUROBINDO PHARMA LTD	3,700	923.80	3,418,060.00
BIOCON LTD	5,970	393.75	2,350,687.50
CIPLA LTD	6,268	808.30	5,066,424.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,884	3,544.70	6,678,214.80
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,471	5,036.90	7,409,279.90

IPCA LABORATORIES LTD	1,001	2,044.65	2,046,694.65
LUPIN LTD	2,363	1,079.25	2,550,267.75
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,895	575.20	6,266,804.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,690.35	1,291,368.00
AXIS BANK LTD	29,968	644.50	19,314,376.00
BANDHAN BANK LTD	9,895	314.10	3,108,019.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	22,428	2,589.45	58,076,184.60
ICICI BANK LTD	67,302	533.80	35,925,807.60
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	7,353	1,828.00	13,441,284.00
STATE BANK OF INDIA	22,200	283.70	6,298,140.00
YES BANK LTD	141,484	17.00	2,405,228.00
BAJAJ FINANCE LTD	3,685	4,972.55	18,323,846.75
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	3,101.00	2,201,710.00
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,165.40	2,114,035.60
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,198	1,487.45	1,781,965.10
REC LTD	14,000	140.10	1,961,400.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,150.65	3,149,329.05
BAJAJ FINSERV LTD	521	9,071.00	4,725,991.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,748	687.40	6,013,375.20
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,586	1,438.95	3,721,124.70
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	501.90	1,870,581.30
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,992	862.55	4,305,849.60
DLF LTD	9,206	269.40	2,480,096.40
HCL TECHNOLOGIES LTD	14,482	985.80	14,276,355.60
INFOSYS LTD	44,914	1,340.85	60,222,936.90
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	3,929.45	2,939,228.60
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	12,388	3,303.10	40,918,802.80
TECH MAHINDRA LTD	8,467	980.85	8,304,856.95
WIPRO LTD	14,289	444.75	6,355,032.75
BHARTI AIRTEL LTD	15,312	576.85	8,832,727.20
INDUS TOWERS LTD	2,400	241.45	579,480.00
ADANI GREEN ENERGY LTD	5,600	1,047.85	5,867,960.00
GAIL INDIA LTD	24,471	134.05	3,280,337.55
INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	534.25	2,519,523.00
NTPC LTD	63,698	94.05	5,990,796.90

	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	29,117	194.20	5,654,521.40
	インドルピー 小計	1,037,576		721,477,307.35 (1,031,712,549)
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	19.05	121,920.00
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.47	128,566.97
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.04	99,581.40
	INDUSTRIES QATAR	23,913	12.00	286,956.00
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	4.39	95,678.72
	MASRAF AL RAYAN	44,940	4.40	198,140.46
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	8.95	83,933.10
	QATAR ISLAMIC BANK	15,926	17.00	270,742.00
	QATAR NATIONAL BANK	60,107	18.10	1,087,936.70
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.41	84,477.68
	OOREDOO QPSC	12,412	8.42	104,595.92
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	18.15	146,978.70
	カタールリアル 小計	313,315		2,709,507.65 (77,166,777)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	165.33	462,924.00
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	288.40	472,110.80
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	677	1,625.00	1,100,125.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,636	340.94	1,921,537.84
	GOLD FIELDS LTD	11,992	142.81	1,712,577.52
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	65.21	449,622.95
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	10,824	216.90	2,347,725.60
	KUMBA IRON ORE LTD	703	676.65	475,684.95
	NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	207.76	1,034,644.80
	SASOL LTD	7,017	161.50	1,133,245.50
	SIBANYE STILLWATER LTD	27,980	62.56	1,750,428.80
	BIDVEST GROUP LTD	4,193	156.79	657,420.47
	MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	130.57	797,521.56
	MR PRICE GROUP LTD	2,802	169.19	474,070.38
	NASPERS LTD-N SHS	5,730	3,564.00	20,421,720.00
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,960	40.32	522,547.20
	BID CORP LTD	4,319	271.39	1,172,133.41
CLICKS GROUP LTD	3,433	264.37	907,582.21	

	SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,519	136.63	890,690.97
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	193.79	492,420.39
	TIGER BRANDS LTD	2,099	201.23	422,381.77
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,174	145.08	750,643.92
	ABSA GROUP LTD	9,806	114.92	1,126,905.52
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	941	1,347.08	1,267,602.28
	NEDBANK GROUP LTD	5,252	122.59	643,842.68
	STANDARD BANK GROUP LTD	17,330	124.71	2,161,224.30
	FIRSTRAND LTD	64,793	48.17	3,121,078.81
	REINET INVESTMENTS SCA	2,213	286.42	633,847.46
	REMGRO LTD	7,030	100.25	704,757.50
	DISCOVERY LTD	5,539	129.48	717,189.72
	OLD MUTUAL LTD	59,174	12.86	760,977.64
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	30.20	302,422.80
	SANLAM LTD	21,916	58.10	1,273,319.60
	NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	90.58	540,672.02
	MTN GROUP LTD	20,781	64.33	1,336,841.73
	VODACOM GROUP LTD	7,934	124.02	983,974.68
	南アフリカランド 小計	375,711		55,944,416.78 (383,219,254)
アラブディールハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	33,706	6.63	223,470.78
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	5.02	102,272.46
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	5.04	103,017.60
	EMIRATES NBD PJSC	34,921	11.55	403,337.55
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,331	14.96	558,471.76
	ALDAR PROPERTIES PJSC	51,017	3.48	177,539.16
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.90	58,280.60
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	3.94	193,741.62
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,250	19.50	414,375.00
	アラブディールハム 小計	298,885		2,234,506.53 (63,281,224)
クウェートディ ナール	AGILITY	17,000	0.76	12,920.00
	BOUBYAN BANK K.S.C	13,763	0.57	7,927.48
	GULF BANK	19,790	0.22	4,353.80
	KUWAIT FINANCE HOUSE	55,281	0.70	38,973.10

	NATIONAL BANK OF KUWAIT	85,336	0.86	73,388.96	
	MABANEE CO KPSC	7,369	0.70	5,209.88	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	28,329	0.63	17,932.25	
	クウェートディナール 小計	226,868		160,705.47	(55,256,968)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	5.67	11,340.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.07	48,026.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	18.66	102,630.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.54	2,794.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.40	2,200.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.18	90,706.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	10.92	27,300.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	520	5.45	2,834.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	5.84	1,752.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.08	22,496.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	46.51	41,859.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.89	9,800.99	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.53	7,413.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	52.28	146,384.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	6.65	125,685.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	2.88	2,592.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,800	53.03	95,454.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	16.67	40,008.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	23.90	69,310.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	6.51	44,268.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	18.30	9,150.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	8.65	30,275.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	4.90	6,860.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	36.90	18,450.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	700	115.58	80,906.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	43.23	156,492.60	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	14.64	28,548.00	
	HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.16	3,240.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	19.99	21,989.00	
	HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.69	16,415.00	

INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.18	21,122.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	4.52	15,820.00	
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	10.78	20,482.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	153.37	46,011.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	22.31	6,693.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	139.55	153,505.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	23.93	76,576.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	41.98	71,366.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.07	14,904.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	36.25	123,250.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,568	22.58	35,405.44	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	42.34	59,276.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.52	35,200.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	50.75	40,600.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	16.35	35,970.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	108.66	32,598.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.72	17,856.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	94.94	56,964.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	27.55	60,610.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.60	2,160.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	400	156.62	62,648.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	14.19	15,609.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	26.46	39,690.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.51	3,765.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.64	7,332.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	116.49	267,927.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	96.07	38,428.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	17.39	20,868.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	7.98	18,992.40	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	141.50	84,900.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	96.28	25,032.80	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	8.12	18,676.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	15.43	6,172.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.33	3,332.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	10.83	191,691.00	

AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	24.00	24,000.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	75.47	105,658.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	12.57	37,710.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,100	86.94	95,634.00	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	2,500	35.48	88,700.00	
AVICOPTER PLC-A	500	62.70	31,350.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	50.39	70,546.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.75	17,825.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	20.26	2,026.00	
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.55	3,275.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.98	2,990.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.49	117,486.00	
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	25,300	4.21	106,513.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	4.94	147,212.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,900	408.00	775,200.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	11.58	6,948.00	
EAST GROUP CO LTD-A	3,000	7.24	21,720.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	110.55	168,036.00	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	7.95	3,315.15	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	42.21	42,210.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	174.13	69,652.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	44.44	26,664.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	55.00	16,500.00	
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	11.70	16,380.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	125.65	130,173.40	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	10.87	28,262.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.98	5,364.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	31.10	110,062.90	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.89	15,560.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	41.30	256,060.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.98	16,688.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.48	4,384.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,800	98.80	177,840.00	
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	12.82	16,666.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	98.80	148,200.00	

SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	27.81	36,153.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.28	3,312.00
TBEA CO LTD-A	400	12.96	5,184.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	21.01	18,909.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	19.29	113,811.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	5.61	6,171.00
XIAMEN C & D INC-A	300	8.05	2,415.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	16.82	6,728.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	700	87.28	61,096.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	39.73	79,460.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	108.00	45,360.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	25.75	76,992.50
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	17.69	22,997.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	14.23	2,846.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	11.69	74,816.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.45	19,370.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	96.55	77,240.00
AIR CHINA LTD-A	800	6.97	5,576.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	10,400	5.67	58,968.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.51	5,863.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.59	50,869.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	9,900	15.40	152,460.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.48	71,928.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	13.31	10,648.00
S F HOLDING CO LTD-A	3,500	100.39	351,365.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	71.17	71,170.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.58	4,580.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	7.77	14,763.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.23	8,460.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	49.90	4,990.00
STO EXPRESS CO LTD-A	3,400	9.20	31,280.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	11.77	47,080.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	17.04	19,936.80
BYD CO LTD -A	1,600	242.92	388,672.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	215.00	43,000.00

CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	4,300	20.14	86,602.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	62.56	118,864.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	30.75	43,050.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	28.31	33,972.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	52.00	41,600.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	23.57	162,868.70	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	43.82	4,382.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	22.80	2,280.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	34.15	194,655.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	40.83	4,083.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	77.28	61,824.00	
JOYOUNG CO LTD -A	600	32.68	19,608.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	16.49	14,841.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	145.30	20,342.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	27.58	11,032.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	9.94	61,628.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	68.61	20,583.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	8.71	3,484.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	79.40	23,820.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	37.41	37,410.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	47.25	28,350.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	6.87	7,557.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	15.29	16,513.20	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	12.47	16,211.00	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	22.90	18,320.00	
CHINA FILM CO LTD-A	200	11.72	2,344.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	9.05	1,810.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	11.65	140,965.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	311.89	31,189.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	17.97	3,594.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.07	12,587.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	91.98	120,493.80	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	9.53	10,483.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	8.90	2,670.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	27.39	36,976.50	

WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	33.08	29,772.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	6.46	19,380.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,700	283.00	481,100.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	25.52	5,104.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	11.64	58,200.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	7.34	24,222.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.38	26,280.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	600	99.20	59,520.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	76.99	21,557.20
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	101.66	42,697.20
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	7.10	22,010.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	58.94	41,258.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	232.99	69,897.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	64.70	32,350.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	10.03	5,015.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	70.08	42,048.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	7.17	17,208.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	63.81	25,524.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	139.70	55,880.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	48.87	34,209.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,300	202.99	466,877.00
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	216.08	86,432.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	27.81	25,029.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	61.72	80,236.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	17.20	43,000.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	48.81	117,144.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	46.04	193,368.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	56.68	56,680.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	192.83	269,962.00
JIANGXI ZHENGANG TECH -A	2,000	16.82	33,640.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	67.67	20,301.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	81.40	24,420.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,000	2,079.95	2,079,950.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	239.09	239,090.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,940	81.99	241,050.60

NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	21.79	56,654.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	800	374.56	299,648.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	86.47	34,588.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	56.86	28,430.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	44.85	148,005.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	93.44	9,344.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	18.08	102,332.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,200	295.56	945,792.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	18.59	20,449.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	25.99	33,787.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	24.63	24,630.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	192.90	19,290.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	36.96	22,176.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,521	80.70	284,144.70
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	154.18	15,418.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	41.98	8,396.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	43.78	17,512.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	168.43	33,686.00
GUANGZHOU WONFO BIOTECH C-A	300	95.02	28,506.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	29.36	7,046.40
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	284.36	85,308.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	84.63	32,159.40
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	30.53	15,265.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	19.23	3,846.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	29.96	20,972.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	14.72	7,065.60
OVCTEK CHINA INC-A	300	113.87	34,161.00
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	46.09	27,654.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	19.57	3,914.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	478.18	334,726.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	318.00	31,800.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	14.43	15,007.20
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	25.11	22,599.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	339.00	67,800.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	41.55	44,874.00

BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	143.10	42,930.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	178.01	53,403.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	467.00	186,800.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	40.70	24,420.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	26.34	2,634.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,300	164.00	213,200.00
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	42.15	25,290.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	36.59	3,659.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	30.16	6,032.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	183.90	55,170.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	51.40	40,092.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	19.97	13,979.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	31.10	43,540.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	4,180	112.60	470,668.00
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	16.06	16,060.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	21.00	18,900.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	14.05	22,480.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	42.00	21,000.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	53.01	53,010.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	34.25	22,262.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	22.30	5,798.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	51.74	62,088.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.87	22,823.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	17.78	16,002.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	169.80	101,880.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	35.45	3,545.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,000	27.68	27,680.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	19.05	3,810.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	4.48	9,856.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	11.95	2,390.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	38.82	23,292.00
WUXI APPTTEC CO LTD-A	1,440	176.00	253,440.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	18.30	18,300.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	138.75	152,625.00
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	600	299.55	179,730.00

ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	27.65	33,456.50
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	40.95	72,891.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	74.50	29,800.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.14	157,942.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.79	89,573.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	10.12	15,180.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.17	51,671.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.50	122,400.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.60	84,680.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.44	17,408.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	8.22	73,158.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	37.79	188,950.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.10	71,361.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.58	19,740.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	4.07	142,043.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,300	51.64	893,372.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	5.14	153,172.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.11	26,884.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	5.04	182,448.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	22.93	412,740.00
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	22.03	288,593.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	9.79	189,926.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.24	3,816.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	11.39	17,085.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	8.03	54,604.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	11.70	32,760.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	12.06	36,180.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	26.28	176,076.00
CITIC SECURITIES CO-A	8,600	30.33	260,838.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,500	40.39	100,975.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	11.61	2,322.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	8,420	39.35	331,327.00
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	17.45	55,840.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	8.24	4,120.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.72	62,784.00

GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	16.84	99,356.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	12.72	30,528.00
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	17.62	38,764.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	12.90	59,340.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	17.33	119,577.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.37	4,185.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	12.46	110,894.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	129.33	64,665.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	7.12	2,848.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	18.85	103,675.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	10.80	3,240.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.87	59,429.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	11.32	18,112.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	9.26	27,780.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	3.12	3,744.00
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	10.91	56,732.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.70	11,840.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	3,600	13.60	48,960.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.33	13,325.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.68	3,072.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.98	75,696.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	15.41	66,263.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.02	2,706.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.11	19,418.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	5.62	24,166.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	10.75	5,375.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	13.82	17,966.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	38.02	95,050.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	37.57	165,308.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	4.30	2,580.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	53.00	100,700.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	6.23	21,805.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	8,900	83.80	745,820.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	11.03	15,772.90
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	22.03	15,421.00

CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	12.81	46,116.00
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	29.26	260,414.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.20	2,480.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	44.45	35,560.00
GEMDALE CORP-A	3,300	11.95	39,435.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	5.83	6,996.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	8.09	25,079.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.20	5,040.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	14.83	123,089.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	6.36	3,816.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,400	19.66	27,524.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	17.08	15,372.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.08	3,696.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.48	22,032.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	7.26	22,506.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.85	14,535.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	17.37	69,480.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	30.18	14,486.40
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	31.44	3,144.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	17.28	12,096.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	800	21.28	17,024.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	73.00	14,600.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	18.96	13,272.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	8.04	3,216.00
GLODON CO LTD-A	500	91.35	45,675.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	99.78	68,748.42
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	51.83	51,830.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	30.66	24,528.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	315.00	31,500.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	62.37	24,948.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	148.77	44,631.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	31.60	12,640.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	6.64	5,976.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	47.79	110,299.32
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	28.53	17,118.00

ADDSINO CO LTD -A	1,700	25.80	43,860.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	78.26	70,434.00	
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	51.68	25,840.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	7.13	244,559.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	40.85	28,595.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	18.09	47,034.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	22.79	25,069.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	14.75	56,050.00	
GOERTEK INC -A	2,000	40.94	81,880.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	9.83	21,626.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	11.69	29,225.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.45	3,135.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	107.62	53,810.00	
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	13.41	2,682.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	24.39	24,390.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	29.25	17,550.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	36.30	166,980.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.13	14,099.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	5,533	57.49	318,092.17	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	200	669.00	133,800.00	
NINESTAR CORP-A	100	29.92	2,992.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	11.88	4,752.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	26.25	26,250.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	124.94	34,983.20	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	19.63	19,630.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	35.83	32,247.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	23.71	16,597.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	44.31	31,017.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	16.69	5,007.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	23.67	44,404.92	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	18.37	23,881.00	
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	11.19	12,309.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	126.50	88,550.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	48.21	65,565.60	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	8.66	21,650.00	

WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	19.02	30,432.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	98.00	39,200.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	83.84	25,152.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	24.78	59,472.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	56.10	28,050.00	
ZTE CORP-A	2,700	33.88	91,476.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.98	21,414.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,400	18.91	329,034.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.26	4,238.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.37	3,496.00	
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	2,400	10.61	25,464.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	8.59	56,694.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.04	15,488.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.14	3,598.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.73	3,438.00	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	700	10.41	7,287.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.07	17,501.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	540	209.68	113,227.20	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,000	105.49	105,490.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	26.45	52,900.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	41.30	49,560.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	119.70	311,220.00	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	221.01	44,202.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	34.87	153,428.00	
SG MICRO CORP-A	100	330.39	33,039.00	
SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	146.01	36,502.50	
TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	31.00	71,300.00	
TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	14.25	27,075.00	
TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	28.80	23,040.00	
UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	131.96	65,980.00	
WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	322.50	258,000.00	
WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	9.27	13,905.00	
ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	45.00	40,500.00	
オフショア人民元 小計	1,319,388		31,461,545.91	(503,384,734)

サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	14.18	23,070.86
	SAUDI ARABIAN OIL CO	29,604	34.95	1,034,659.80
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	63.40	74,431.60
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	13.40	50,678.80
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	2,572	90.60	233,023.20
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	18.10	63,350.00
	SAUDI ARABIAN MINING CO	5,424	42.15	228,621.60
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	12,072	102.60	1,238,587.20
	SAUDI CEMENT	1,265	64.60	81,719.00
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	26.25	78,303.75
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	14.32	116,536.16
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	64.40	234,351.60
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	76.80	32,409.60
	JARIR MARKETING CO	611	170.40	104,114.40
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	125.00	50,750.00
	ALMARAI CO	3,167	54.20	171,651.40
	SAVOLA	3,337	40.40	134,814.80
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	115.00	90,390.00
	AL RAJHI BANK	16,412	73.50	1,206,282.00
	ALINMA BANK	12,351	16.38	202,309.38
	ARAB NATIONAL BANK	8,707	20.40	177,622.80
	BANK AL-JAZIRA	5,356	13.56	72,627.36
	BANK ALBILAD	5,393	28.20	152,082.60
	BANQUE SAUDI FRANSI	7,513	33.90	254,690.70
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	19,926	44.55	887,703.30
	RIYAD BANK	16,646	21.12	351,563.52
	SAMBA FINANCIAL GROUP	13,662	31.50	430,353.00
	SAUDI BRITISH BANK	8,978	27.00	242,406.00
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	115.60	92,480.00
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	77.60	51,293.60
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	8.62	33,980.04
	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	9.02	38,740.90
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	29.15	162,773.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	13.62	70,824.00	
SAUDI TELECOM CO	8,115	110.20	894,273.00	

	SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	22.72	280,796.48	
	サウジアラビアリアル 小計	240,409		9,644,266.05	(267,435,497)
	合 計	31,940,764		11,503,556,613	(11,503,556,613)

(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	45,800	1,006,684.00	
		メキシコペソ 小計	45,800	1,006,684.00	(5,244,823)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	584,099.88	
		南アフリカランド 小計	48,594	584,099.88	(4,001,084)
	合 計			9,245,907	(9,245,907)

(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 61銘柄	100.0%		16.0%
メキシコペソ	株式 24銘柄	97.2%		1.6%
	投資証券 1銘柄		2.8%	0.0%
ブラジルリアル	株式 54銘柄	100.0%		4.5%
チリペソ	株式 14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 3銘柄	100.0%		0.1%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%

トルコリラ	株式	14銘柄	100.0%		0.4%
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	14銘柄	100.0%		0.6%
香港ドル	株式	197銘柄	100.0%		22.6%
マレーシアリングット	株式	38銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式	42銘柄	100.0%		1.8%
フィリピンペソ	株式	20銘柄	100.0%		0.7%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%		1.3%
韓国ウォン	株式	106銘柄	100.0%		13.6%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%		13.6%
インドルピー	株式	96銘柄	100.0%		9.0%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%		0.7%
南アフリカランド	株式	36銘柄	99.0%		3.3%
	投資証券	1銘柄		1.0%	0.0%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%		0.5%
クウェートディナール	株式	7銘柄	100.0%		0.5%
オフショア人民元	株式	448銘柄	100.0%		4.4%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%		2.3%

(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）

2021年 1月25日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	407,950,647
投資証券	23,137,777,600
派生商品評価勘定	29,417,250
未収入金	720,632,120
未収配当金	118,804,292
差入委託証拠金	79,222,500
流動資産合計	24,493,804,409
資産合計	24,493,804,409
負債の部	
流動負債	
前受金	31,026,900
未払金	130,572,010
未払解約金	30,137,000
未払利息	1,106
その他未払費用	17
流動負債合計	191,737,033
負債合計	191,737,033
純資産の部	
元本等	
元本	19,216,952,787
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,085,114,589
元本等合計	24,302,067,376
純資産合計	24,302,067,376
負債純資産合計	24,493,804,409

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）

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	

期首	2020年 1月28日
期首元本額	16,608,377,856円
期中追加設定元本額	17,317,627,913円
期中一部解約元本額	14,709,052,982円
期末元本額	19,216,952,787円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	999,648,137円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	656,602,487円
りそなラップ型ファンド(成長型)	530,267,959円
DCりそな グローバルバランス	17,333,705円
つみたてバランスファンド	911,030,444円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	228,455,111円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	117,070,385円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	70,808,447円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	10,260,388円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	7,376,669円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,470,911円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	4,975,434円
リスクコントロール・オープン	2,137,407円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	56,898,122円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,196,817,301円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,279,594,598円
Smart-i Jリートインデックス	2,472,946,146円
Smart-i 8資産バランス 安定型	33,177,565円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	91,876,450円
Smart-i 8資産バランス 成長型	88,554,381円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	218,849,353円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	217,800,344円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	127,102,756円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	75,823,501円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	192,983,598円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	32,219,210円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,180,284,404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)	1,038,263円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,391,549,311円
2. 計算日における受益権の総数	19,216,952,787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	1.2646円
(10,000口当たり純資産額)	(12,646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

2021年 1月25日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

2021年 1月25日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		1,576,852,809
合計		1,576,852,809

(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)

(2021年 1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	531,597,750	-	561,015,000	29,417,250
合計		531,597,750	-	561,015,000	29,417,250

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	392	48,490,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	587	59,580,500	
	S O S i L A 物流リート投資法人	631	79,758,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	827	459,812,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	2,937	277,252,800	
	森ヒルズリート投資法人	2,819	413,265,400	
	産業ファンド投資法人	3,393	654,849,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,280	695,400,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,566	285,168,600	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,203	501,651,000	
	G L P 投資法人	7,500	1,278,750,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,047	308,027,400	
	日本プロロジスリート投資法人	3,632	1,211,272,000	
	星野リゾート・リート投資法人	365	188,340,000	
	O n e リート投資法人	374	97,464,400	
	イオンリート投資法人	2,434	333,701,400	
	ヒューリックリート投資法人	1,932	296,175,600	
	日本リート投資法人	780	276,900,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	15,420	220,197,600	
	積水ハウス・リート投資法人	7,060	521,734,000	
	トーセイ・リート投資法人	531	61,011,900	
	ケネディクス商業リート投資法人	883	220,396,800	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	512	68,966,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	462	51,051,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	7,762	1,187,586,000	
	いちごホテルリート投資法人	420	28,728,000	
	ラサールロジポート投資法人	2,675	439,235,000	
	スターアジア不動産投資法人	2,466	121,080,600	
	マリモ地方創生リート投資法人	225	25,380,000	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	838	444,140,000	
大江戸温泉リート投資法人	387	26,548,200		
投資法人みらい	2,592	103,550,400		
森トラスト・ホテルリート投資法人	520	59,748,000		
三菱地所物流リート投資法人	540	224,640,000		

C R E ロジスティクスファンド投資法人	768	116,352,000	
ザイマックス・リート投資法人	368	37,094,400	
タカラレーベン不動産投資法人	721	68,927,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	931	121,216,200	
日本ビルファンド投資法人	2,701	1,601,693,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,400	1,449,600,000	
日本リテールファンド投資法人	4,509	848,142,900	
オリックス不動産投資法人	4,782	807,679,800	
日本プライムリアルティ投資法人	1,494	536,346,000	
プレミア投資法人	2,168	275,986,400	
東急リアル・エステート投資法人	1,609	265,163,200	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,667	172,201,100	
ユナイテッド・アーバン投資法人	5,133	686,795,400	
森トラスト総合リート投資法人	1,715	228,609,500	
インヴィンシブル投資法人	10,036	349,252,800	
フロンティア不動産投資法人	797	329,559,500	
平和不動産リート投資法人	1,473	192,079,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,568	489,216,000	
福岡リート投資法人	1,241	193,099,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	742	484,526,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,991	155,098,900	
大和証券オフィス投資法人	511	333,172,000	
阪急阪神リート投資法人	1,084	137,884,800	
スターツプロシード投資法人	374	73,004,800	
大和ハウスリート投資法人	3,425	924,065,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,732	408,249,600	
大和証券リビング投資法人	3,134	304,311,400	
ジャパンエクセレント投資法人	2,227	278,597,700	
合計	145,293	23,137,777,600	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2021年 1月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	81,301,509
コール・ローン	24,334,134
株式	16,303,056
投資証券	22,201,672,961
派生商品評価勘定	369,831
未収入金	439,339,758
未収配当金	36,183,184
流動資産合計	22,799,504,433
資産合計	
22,799,504,433	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	10,922
未払解約金	11,841,000
未払利息	66
その他未払費用	1
流動負債合計	11,851,989
負債合計	
11,851,989	
純資産の部	
元本等	
元本	21,976,415,392
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	811,237,052
元本等合計	22,787,652,444
純資産合計	22,787,652,444
負債純資産合計	22,799,504,433

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

2021年 1月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 1月28日
期首元本額	20,554,057,909円
期中追加設定元本額	21,048,096,808円
期中一部解約元本額	19,625,739,325円
期末元本額	21,976,415,392円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	397,667,105円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	579,903,244円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,856,311,025円
DCりそな グローバルバランス	6,880,518円
つみたてバランスファンド	551,267,883円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	318,251,854円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	162,368,764円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	97,202,064円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,940,208円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,114,525円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,872,922円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,841,243円
リスクコントロール・オープン	10,329,749円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	69,657,309円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,194,970,791円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,321,919,288円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,414,505,202円
Smart-i 8資産バランス 安定型	40,504,365円

Smart-i 8資産バランス 安定成長型	112,155,037円
Smart-i 8資産バランス 成長型	126,342,674円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	531,760,524円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	531,564,450円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	310,207,980円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	185,069,154円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	470,339,857円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	78,741,500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）	1,806,940円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	1,570,919,217円
2. 計算日における受益権の総数	21,976,415,392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	1.0369円
(10,000口当たり純資産額)	(10,369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

2021年 1月25日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用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

2021年 1月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 1月25日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 1月25日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	1,886,603	
投資証券	394,424,238	
合計	392,537,635	

(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)

（2021年 1月25日現在）

（単位：円）

--	--	--	--

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	125,037,913	-	125,405,020	367,107
	米ドル	116,148,430	-	116,497,260	348,830
	ユーロ	6,046,833	-	6,065,760	18,927
	英ポンド	2,842,650	-	2,842,000	650
	売建	531,298,932	-	531,307,130	8,198
	米ドル	411,162,444	-	411,166,800	4,356
	カナダドル	7,349,697	-	7,349,400	297
	ユーロ	26,409,720	-	26,411,330	1,610
	英ポンド	27,425,319	-	27,425,300	19
	オーストラリアドル	33,677,280	-	33,679,800	2,520
	ニュージーランドドル	2,241,111	-	2,241,000	111
	香港ドル	8,169,547	-	8,167,900	1,647
	シンガポールドル	14,863,814	-	14,865,600	1,786
	合計		656,336,845	-	656,712,150

(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

			評価額
--	--	--	-----

通貨	銘柄	株式数	単価	金額	備考
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	84,000	2.42	203,280.00	
オーストラリアドル 小計		84,000		203,280.00 (16,303,056)	
合 計		84,000		16,303,056 (16,303,056)	

(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	225,399.33	
		AGREE REALTY CORP	10,042	651,123.28	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,439	207,482.52	
		ALEXANDER'S INC	368	102,922.24	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,932	3,534,158.88	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,604	249,343.92	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,231	968,732.70	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	150,331.68	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	45,334	1,413,060.78	
		AMERICOLD REALTY TRUST	34,542	1,222,786.80	
		APARTMENT INCOME REIT CO	25,128	985,017.60	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,440	122,366.40	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	35,804	472,970.84	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,000	115,100.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,628	3,892,240.44	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	39,090.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	23,914	2,183,348.20	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	29,394	334,209.78	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	49,805	857,642.10	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,484	111,849.00	
		BRT APARTMENTS CORP	877	13,558.42	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,464	1,688,383.20	

CARETRUST REIT INC	16,468	378,928.68	
CENTERSPACE	2,204	161,024.24	
CHATHAM LODGING TRUST	8,481	98,464.41	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	32,420.00	
CITY OFFICE REIT INC	8,644	84,279.00	
CLIPPER REALTY INC	1,350	9,814.50	
COLONY CAPITAL INC	82,849	395,189.73	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,730	278,982.20	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	183,587.04	
COREPOINT LODGING INC	7,200	53,208.00	
CORESITE REALTY CORP	7,203	930,771.66	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,324	507,255.00	
COUSINS PROPERTIES INC	24,951	825,628.59	
CTO REALTY GROWTH INC	900	40,833.00	
CUBESMART	32,964	1,152,751.08	
CYRUSONE INC	20,327	1,443,217.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,437	305,800.56	
DIGITAL REALTY TRUST INC	47,423	6,661,034.58	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,962	181,052.04	
DOUGLAS EMMETT INC	27,666	787,374.36	
DUKE REALTY CORP	62,866	2,529,727.84	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	14,000	320,600.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,660	932,133.60	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,101	218,837.08	
EPR PROPERTIES	12,914	481,563.06	
EQUINIX INC	15,087	10,880,140.92	
EQUITY COMMONWEALTH	20,932	588,817.16	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	28,651	1,813,035.28	
EQUITY RESIDENTIAL	57,958	3,567,894.48	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,144	371,226.24	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,031	2,685,496.95	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,858	2,522,631.78	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	36,044.54	

FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,579	1,025,088.87	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,726	910,319.40	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,736	347,692.80	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	74,513.40	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	36,482	1,506,706.60	
GEO GROUP INC/THE	20,721	173,227.56	
GETTY REALTY CORP	6,175	168,207.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	113,551.64	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	42,122.90	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	98,826.78	
GLOBAL NET LEASE INC	15,387	261,117.39	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,411	729,954.98	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36,762	1,066,833.24	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	90,945	2,744,720.10	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	32,007.26	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,895	710,252.55	
HOST HOTELS & RESORTS INC	118,920	1,714,826.40	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,204	625,489.48	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	16,444	225,611.68	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,229	249,620.67	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,815	741,559.70	
INVITATION HOMES INC	94,837	2,847,006.74	
IRON MOUNTAIN INC	48,685	1,467,852.75	
JBG SMITH PROPERTIES	19,165	601,589.35	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,000	83,190.00	
KILROY REALTY CORP	17,640	1,023,296.40	
KIMCO REALTY CORP	72,834	1,213,414.44	
KITE REALTY GROUP TRUST	14,475	243,324.75	
LEXINGTON REALTY TRUST	47,646	498,853.62	
LIFE STORAGE INC	8,199	1,003,311.63	
LTC PROPERTIES INC	6,749	270,567.41	
MACERICH CO/THE	19,273	274,640.25	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	197,540.15	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	241,500	179,917.50	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	95,869	2,058,307.43	

MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,348	2,596,114.64	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	16,864	298,492.80	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	29,251	1,176,475.22	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,752	391,157.76	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,696	514,015.84	
NETSTREIT CORP	2,174	38,631.98	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	66,828.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,850	167,436.50	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	8,332	204,800.56	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,243	1,375,600.71	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	44,778.00	
PARAMOUNT GROUP INC	28,845	259,605.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	39,454	716,484.64	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,575	463,239.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	35,829	652,446.09	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,718	349,008.26	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	62,197.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	64,980.88	
PRIME US REIT	85,000	70,975.00	
PROLOGIS INC	125,169	12,669,606.18	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,452	473,407.28	
PUBLIC STORAGE	25,747	5,736,174.13	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11,111	711,881.77	
REALTY INCOME CORP	59,337	3,550,726.08	
REGENCY CENTERS CORP	26,579	1,247,352.47	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20,290	291,973.10	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	36,845	344,869.20	
RETAIL VALUE INC	3,515	55,220.65	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	21,996	1,092,761.28	
RLJ LODGING TRUST	28,462	406,437.36	
RPT REALTY	12,940	122,024.20	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,194	612,596.22	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,605	615,254.40	
SAFEHOLD INC	2,502	190,402.20	
SAUL CENTERS INC	2,130	67,158.90	

	SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,386	82,998.26
	SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	315,292.48
	SIMON PROPERTY GROUP INC	55,469	5,296,734.81
	SITE CENTERS CORP	25,914	294,642.18
	SL GREEN REALTY CORP	13,998	879,774.30
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,657	780,382.90
	STAG INDUSTRIAL INC	25,677	797,527.62
	STORE CAPITAL CORP	39,807	1,262,279.97
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	166,790.40
	SUN COMMUNITIES INC	18,197	2,673,867.18
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,190	416,528.00
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,237	203,413.95
	TERRENO REALTY CORP	11,764	671,253.84
	UDR INC	49,795	1,947,482.45
	UMH PROPERTIES INC	7,056	109,368.00
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,201	144,077.46
	URBAN EDGE PROPERTIES	18,861	268,392.03
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	78,629.07
	VENTAS INC	63,296	3,109,732.48
	VEREIT INC	36,787	1,313,663.77
	VICI PROPERTIES INC	90,714	2,393,942.46
	VORNADO REALTY TRUST	26,368	999,347.20
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	2,254	25,808.30
	WASHINGTON REIT	14,167	318,474.16
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,719	476,122.62
	WELLTOWER INC	70,569	4,450,786.83
	WHITESTONE REIT	7,716	65,431.68
	WP CAREY INC	29,605	1,991,528.35
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,627	311,480.49
	米ドル 小計	4,157,413	156,084,047.27 (16,207,767,468)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,612	405,378.40
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,925	117,443.75
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	37,975.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,838	140,087.00

	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,376	736,913.76
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,139	347,379.20
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,714	121,684.78
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	122,996.76
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	140,835.48
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	168,857.71
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	79,736.28
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	277,376.76
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,129	395,138.16
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	23,760	299,851.20
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	171,096.93
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	153,857.55
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	68,490.92
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	61,244.24
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	13,780	181,207.00
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	36,100.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,437	463,969.35
	SLATE GROCERY REIT	4,620	55,763.40
	SLATE OFFICE REIT	4,169	18,135.15
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,590	280,941.60
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,293	181,316.52
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	30,864.00
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,500	128,375.00
	カナダドル 小計	289,863	5,223,015.90 (426,563,708)
ユーロ	AEDIFICA	5,499	544,401.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	30,156	430,929.24
	ALTAREA	659	93,709.80
	BEFIMMO	4,423	152,151.20
	CARE PROPERTY INVEST	4,100	106,190.00
	CARMILA	8,000	88,960.00
	COFINIMMO	4,644	574,927.20
	COVIVIO	8,048	550,483.20
	CROMWELL EUROPEAN REIT	225,700	113,978.50
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	6,310	98,309.80

	GECINA SA	9,126	1,068,654.60
	HAMBORNER REIT AG	11,172	100,782.61
	HIBERNIA REIT PLC	111,215	122,114.07
	ICADE	5,365	313,316.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,951	38,657.03
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	43,462	341,828.63
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	91,268.10
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	107,883.66
	KLEPIERRE	35,026	594,040.96
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	53,238.37
	MERCIALYS	7,081	50,381.31
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	55,027	422,607.36
	MONTEA	1,744	171,784.00
	NSI NV	2,572	88,091.00
	RETAIL ESTATES	1,704	102,751.20
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,321	1,327,897.74
	VASTNED RETAIL NV	2,832	64,144.80
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	21,949	644,422.64
	WERELDHAVE NV	7,169	81,081.39
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,300	117,990.00
	ユーロ 小計	740,985	8,656,975.41 (1,093,981,982)
英ポンド	AEW UK REIT PLC	20,000	15,980.00
	ASSURA PLC	454,400	339,891.20
	BIG YELLOW GROUP PLC	28,298	314,956.74
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	105,045.00
	BRITISH LAND CO PLC	157,255	691,922.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,605	191,167.81
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	105,935	112,291.10
	CUSTODIAN REIT PLC	77,000	67,991.00
	DERWENT LONDON PLC	18,727	588,027.80
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	73,771.61
	GCP STUDENT LIVING PLC	77,427	111,030.31
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	43,363	271,018.75
	HAMMERSON PLC	647,780	131,823.23
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,000	65,400.00

	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	126,145	800,137.73
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	155,203	354,794.05
	LXI REIT PLC	82,361	98,833.20
	NEWRIVER REIT PLC	56,051	46,298.12
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	80,983.20
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	224,444	333,074.89
	RDI REIT PLC	48,350	43,321.60
	REGIONAL REIT LTD	63,471	49,063.08
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,057	296,208.25
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	40,107.41
	SEGRO PLC	201,220	1,960,285.24
	SHAFTESBURY PLC	51,758	271,729.50
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	41,262.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	112,136	119,424.84
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	63,682.99
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	292,379	541,193.52
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	131,710	86,006.63
	UNITE GROUP PLC	68,405	652,925.72
	WORKSPACE GROUP PLC	21,840	157,248.00
	英bond 小計	4,195,523	9,116,896.52 (1,295,602,164)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	74,490	205,592.40
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	79,479.48
	ARENA REIT	64,396	189,968.20
	AVENTUS GROUP	62,000	168,640.00
	BWP TRUST	82,774	355,928.20
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	82,504	250,812.16
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	137,891.16
	CHARTER HALL GROUP	79,767	1,115,940.33
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	87,329	388,614.05
	CHARTER HALL RETAIL REIT	86,920	314,650.40
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	173,350.32
	CROMWELL PROPERTY GROUP	319,051	268,002.84
	DEXUS	186,958	1,716,274.44

	GDI PROPERTY GROUP	88,291	100,651.74
	GOODMAN GROUP	289,070	5,130,992.50
	GPT GROUP	334,068	1,459,877.16
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	172,124.56
	HOME CONSORTIUM	24,000	95,760.00
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	66,745	83,764.97
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	92,161.40
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,989	247,445.55
	IRONGATE GROUP	96,000	118,080.00
	MIRVAC GROUP	675,645	1,709,381.85
	NATIONAL STORAGE REIT	159,326	308,295.81
	RURAL FUNDS GROUP	57,679	142,467.13
	SCENTRE GROUP	891,541	2,549,807.26
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	183,048	437,484.72
	STOCKLAND	409,621	1,859,679.34
	VICINITY CENTRES	662,595	1,023,709.27
	WAYPOINT REIT LTD	132,972	336,419.16
	オーストラリアドル 小計	5,481,698	21,233,246.40 (1,702,906,361)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	222,665.49
	GOODMAN PROPERTY TRUST	189,584	428,459.84
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	270,793	346,615.04
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	317,617.11
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	64,548	212,362.92
	ニュージーランドドル 小計	856,199	1,527,720.40 (114,135,991)
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,541,280.00
	FORTUNE REIT	240,000	1,720,800.00
	LINK REIT	354,400	24,365,000.00
	PROSPERITY REIT	226,000	544,660.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	164,000	613,360.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	1,034,100.00
	香港ドル 小計	1,592,400	29,819,200.00 (399,577,280)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	105,430.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	190,300	131,307.00

	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	544,500	1,704,285.00
	ASCOTT TRUST	320,196	336,205.80
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	778,332	1,774,596.96
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	166,100	235,862.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	129,100	162,666.00
	EC WORLD REIT	50,000	36,250.00
	ESR REIT	403,200	163,296.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	97,722.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	107,400	26,313.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	229,000	593,110.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	70,861.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	456,379	657,185.76
	IREIT GLOBAL	55,000	36,575.00
	KEPPEL DC REIT	219,600	623,664.00
	KEPPEL REIT	292,500	345,150.00
	LENLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	108,498.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	57,791.50
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	374,800	817,064.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	286,300	821,681.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	482,900	975,458.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	350,300	350,300.00
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	403,100	159,224.50
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	66,200	266,786.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	63,239.50
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	75,522.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	165,900	89,586.00
	SPH REIT	161,200	137,826.00
	STARHILL GLOBAL REIT	251,500	130,780.00
	SUNTEC REIT	368,400	563,652.00
	シンガポールドル 小計	8,507,607	11,717,888.02 (916,924,737)
韓国ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	18,840,000.00
	JR REIT XXVII	18,000	92,160,000.00
	LOTTE REIT CO LTD	15,600	82,212,000.00
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,000	62,080,000.00

	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,600	60,286,000.00
	韓国ウォン 小計	62,200	315,578,000.00 (29,727,447)
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	29,265	456,534.00
	イスラエルシェケル 小計	29,265	456,534.00 (14,485,823)
合計			22,201,672,961 (22,201,672,961)

(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%	73.0%
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 30銘柄		99.1%	7.7%
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%	4.1%
韓国ウォン	投資証券 5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。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 1月29日現在です。

【DCりそな グローバルバランス】

【純資産額計算書】

資産総額	759,621,453円
負債総額	2,401,507円
純資産総額（ - ）	757,219,946円
発行済口数	712,139,893口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0633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	82,936,414,795円
負債総額	52,892,580円
純資産総額（ - ）	82,883,522,215円
発行済口数	78,957,497,019口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0497円

RAM先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	31,794,184,536円
負債総額	193,163円
純資産総額（ - ）	31,793,991,373円
発行済口数	29,843,659,568口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0654円

RAM新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	5,200,862,697円
負債総額	22,662,309円
純資産総額（ - ）	5,178,200,388円
発行済口数	4,785,190,591口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0821円

R A M国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	40,601,928,990円
負債総額	991,509,896円
純資産総額（ - ）	39,610,419,094円
発行済口数	30,568,763,730口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2958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	84,412,208,552円
負債総額	95,525,398円
純資産総額（ - ）	84,316,683,154円
発行済口数	54,007,047,797口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5612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	13,621,845,196円
負債総額	17,497,554円
純資産総額（ - ）	13,604,347,642円
発行済口数	8,386,051,051口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6223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	24,524,699,497円
負債総額	28,613,018円
純資産総額（ - ）	24,496,086,479円
発行済口数	18,807,591,573口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3025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	22,581,617,978円
負債総額	36,278,082円
純資産総額（ - ）	22,545,339,896円
発行済口数	21,547,467,973口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0463円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(5) 受益権の再分割

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

定日現在の受益権を均等に再分割できるものとしします。

(6) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年1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（2021年1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。

2021年1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	85	884,543
単位型株式投資信託	6	108,277
合計	91	992,821

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

其他有価証券

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
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【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 4月27日	有価証券届出書
2020年 4月27日	有価証券報告書
2020年10月27日	有価証券届出書
2020年10月27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3月19日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ
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DCりそな グローバルバランスの2020年1月28日から2021年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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、DCりそな グローバルバランスの2021年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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。