

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年4月27日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	つみたてバランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

**第一部【証券情報】****（１）【ファンドの名称】**

つみたてバランスファンド（以下「ファンド」といいます。）

**（２）【内国投資信託受益証券の形態等】**

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

**（３）【発行（売出）価額の総額】**

1兆円を上限とします。

**（４）【発行（売出）価格】**

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

**（５）【申込手数料】**

ありません。

**（６）【申込単位】**

販売会社にお問い合わせください。

**（７）【申込期間】**

2021年4月28日から2021年10月26日までとします。

- ・上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

**（８）【申込取扱場所】**

販売会社につきましては、委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先 りそなアセットマネジメント株式会社 電話番号：0120-223351 （受付時間は営業日の午前9時～午後5時） ホームページ アドレス：https://www.resona-am.co.jp/
---

**（９）【払込期日】**

- ・取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する期日までに販売会社に支払うものとして。

- ・申込期間における各取得申込受付日の発行価額の総額(設定総額)は、販売会社によって、追加設定が行なわれる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込金額は、販売会社にお支払いいただきます。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は、株式会社証券保管振替機構とします。

(12) 【その他】

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

## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

ファンドの基本的性格

## 1) 商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
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			
債券 一般 公債 社債	年4回	北米	ファミリーファンド	あり	日経 225
	年6回 (隔月)	欧州			
その他債券 クレジット属性 ( )	年12回 (毎月)	アジア			TOPIX
	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 (合成ベンチマーク)
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、不動産投信) (資産配分固定型)))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

（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）（資産配分固定型））））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

#### <商品分類の定義>

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

##### 4. 独立した区分

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

#### <補足として使用する商品分類>

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

#### <属性区分の定義>

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1) 株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

## (2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

## (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

## (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

## (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

## 2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## 4. 投資形態による属性区分

ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資され

るものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。

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

#### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

#### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

#### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

### ファンドの特色

**1** 国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券(リート)を実質的な主要投資対象とし、以下の指数を「基本的資産配分」で組み合わせた合成ベンチマーク\*1に連動する投資成果を目指します。

- 合成ベンチマークへの連動性を高めるため、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ETF(上場投資信託証券)を活用することがあります。

実質的な投資対象	合成ベンチマークを構成する指数*2	基本的資産配分
国内株式	東証株価指数(TOPIX、配当込み)	30%
先進国株式	MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)	20%
新興国株式	MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)	5%
国内債券	NOMURA-BPI総合	20%
先進国債券	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	5%
新興国債券	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)	5%
国内リート	東証REIT指数(配当込み)	10%
先進国リート	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%

\*1 合成ベンチマークは、合成ベンチマークを構成する指数および基本的資産配分をもとに委託会社が計算したものです。

\*2 合成ベンチマークを構成する指数については、「合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について」をご参照ください。



## 2 以下のマザーファンドを通じて、国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券への投資を行います。

- 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
実質的な投資対象	株式	<b>RM国内株式マザーファンド</b> 【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)	<b>RM先進国株式マザーファンド</b> 【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)	<b>RM新興国株式マザーファンド</b> 【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)
	債券	<b>RM国内債券マザーファンド</b> 【主要投資対象】 国内の債券 【対象指数】 NOMURA-BPI総合	<b>RM先進国債券マザーファンド</b> 【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)	<b>RM新興国債券マザーファンド</b> 【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IVERSIFアイド(円換算ベース)
	リート	<b>RM国内リートマザーファンド</b> 【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)	<b>RM先進国リートマザーファンド</b> 【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)	—

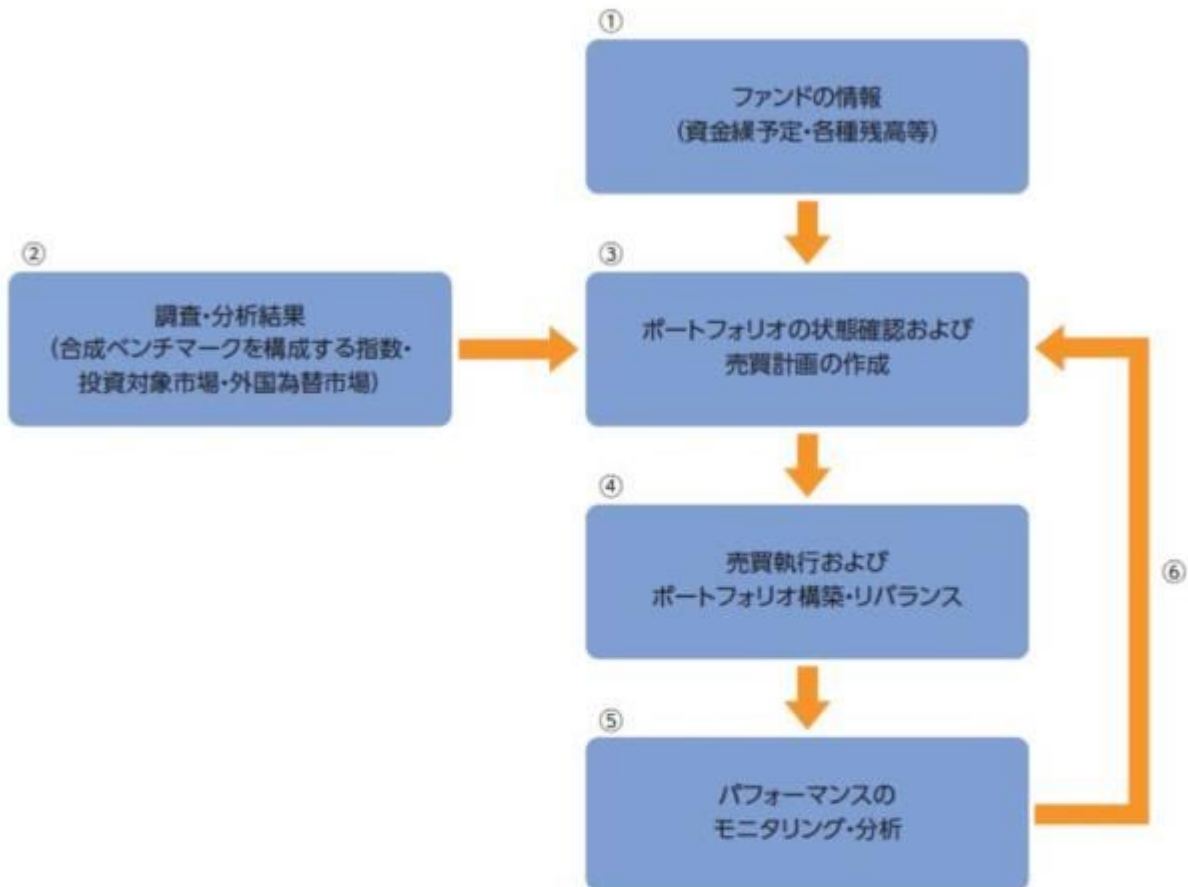
## 3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

## 4 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

- 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。



## 運用プロセスのイメージ



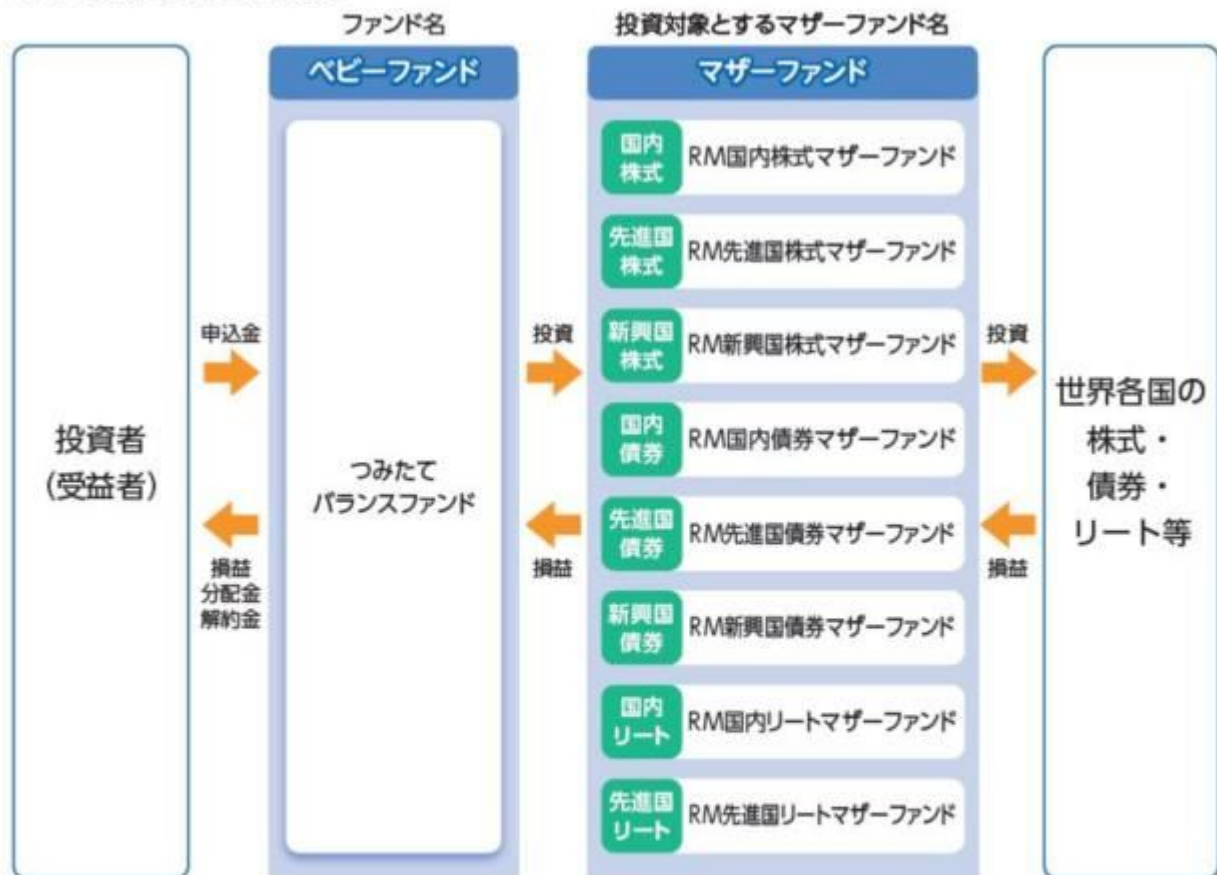
- ① 設定・解約による資金繰予定のほか、各マザーファンド・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
- ② 合成ベンチマークを構成する指数、投資対象となる市場および外国為替市場に関する調査・分析を行います。
- ③ 各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じてマザーファンドの売買計画を作成します。
- ④ 売買執行（マザーファンドの売買）により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
- ⑤ 運用パフォーマンスや合成ベンチマークとの連動性について、モニタリング・分析を行います。
- ⑥ 上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## ■ ファンドの仕組み

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



## ■ 主な投資制限

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

## 分配方針

原則、毎年7月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について

- 「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。
- 「MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。
- 「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。
- 「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。
- 「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。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(J.P. Morgan Securities LLC)が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象とした指数であり、指数に関する著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。
- 「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。
- 「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。

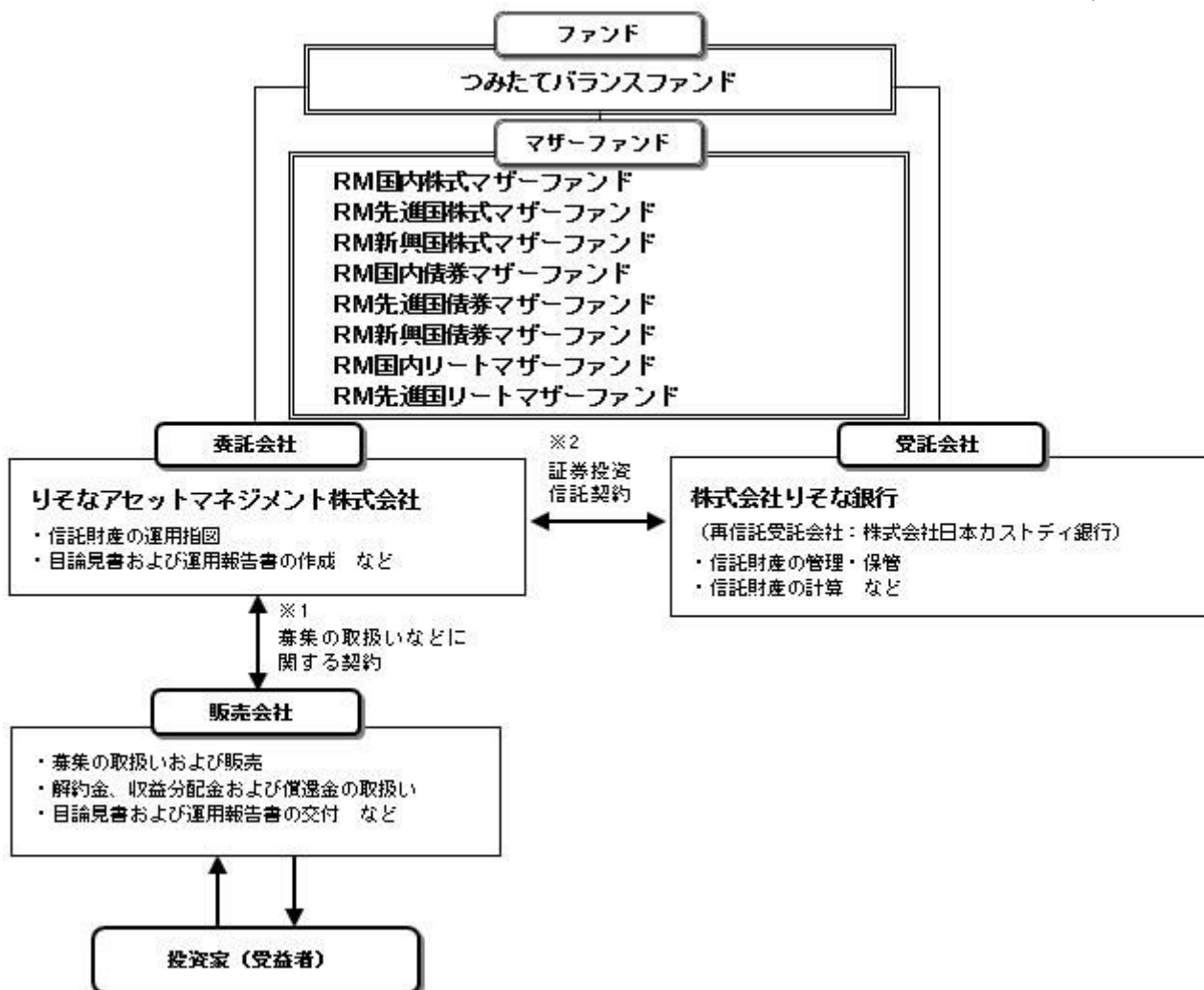
### (2)【ファンドの沿革】

2017年10月26日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

### (3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



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

委託会社の概況（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】

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



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株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

以下の指数を「基本的資産配分」で組合わせたものを合成ベンチマークとし、当該合成ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

実質的な投資対象	指数名称	基本的資産配分
国内株式	東証株価指数（TOPIX、配当込み）	30%
先進国株式	M S C I - K O K U S A I 指数（配当込み、円換算ベース）	20%
新興国株式	M S C I エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）	5%
国内債券	N O M U R A - B P I 総合	20%
先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）	5%
新興国債券	J P モルガン G B I - E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）	5%
国内リート	東証 R E I T 指数（配当込み）	10%
先進国リート	S & P 先進国 R E I T 指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	5%

合成ベンチマークへの連動性を高めるため、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、E T F（上場投資信託証券）を活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。

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。

指数の変動をその基準価額の変動に適正に反映するための手法については、前述の「運用プロセスのイメージ」をご参照ください。

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

## &lt; R M先進国株式マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、MSCI - K O K U S A 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	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。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）D R（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E T F（上場投資信託証券）
投資方針	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E T F（上場投資信託証券）に投資し、MSCI - K O K U S A I 指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI - K O K U S A I 指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 株式またはE T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	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。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M新興国株式マザーファンド &gt;

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

## &lt; R M国内債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、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	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券</li> </ul>
投資方針	<p>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。</p> <p>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。</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は、行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損 益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避す る目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、 同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額 を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エク スポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポ ージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの 区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることと なった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比 率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信 託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M先進国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動き に連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ 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</li> </ul>

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

## &lt; R M新興国債券マザーファンド &gt;

<b>運用の基本方針</b>	
基本方針	この投資信託は、JPモルガンGBI E Mグローバル・ダイバースファイド（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"> <li>・ J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券</li> <li>・ 新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	<p>主として、 J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）に投資し、 J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、 J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券または E T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で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す。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
<b>ファンドに係る費用</b>	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

## &lt; R M国内リートマザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証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



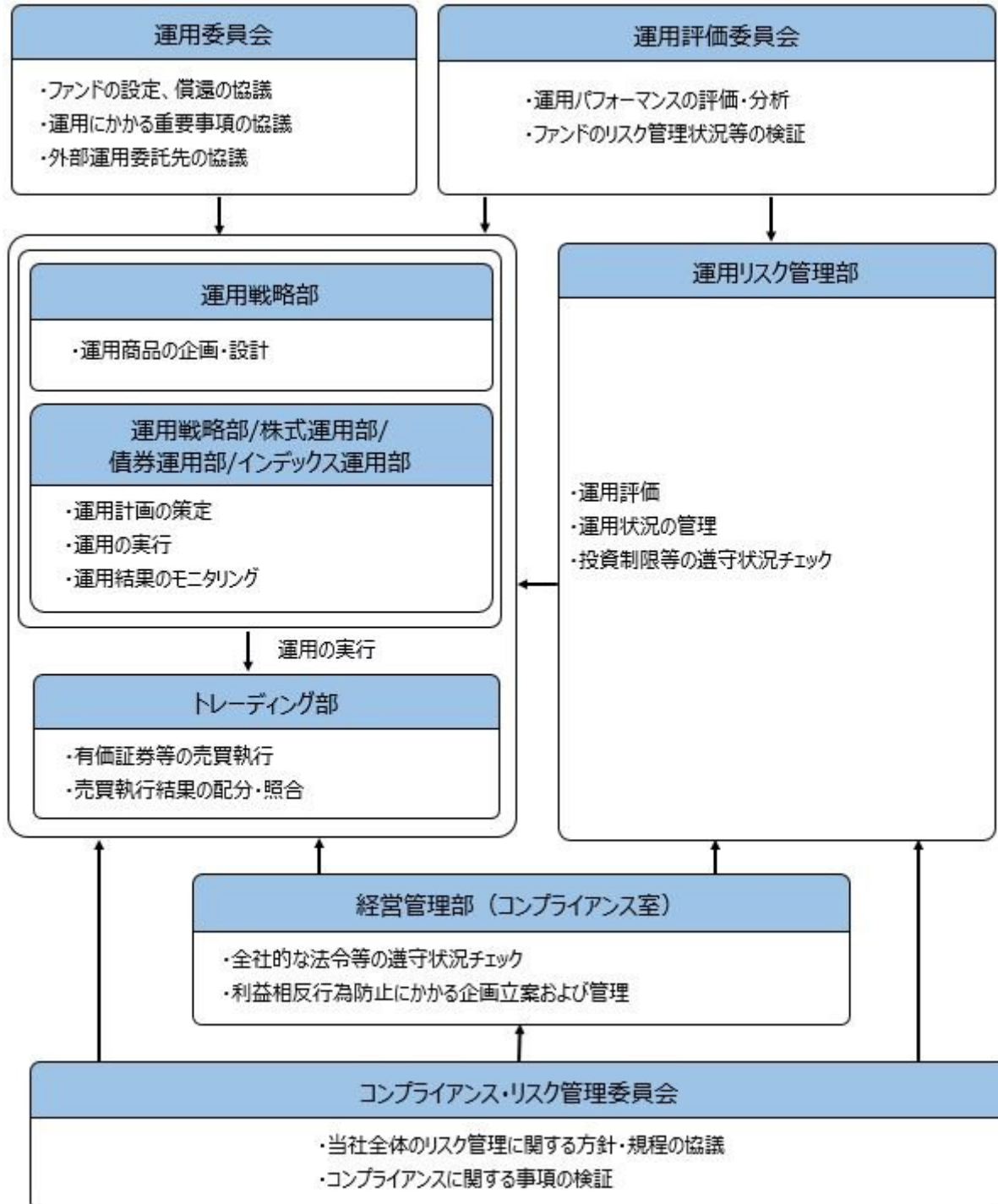
## &lt; R M先進国リートマザーファンド &gt;

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 <ul style="list-style-type: none"> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）</li> <li>・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式</li> <li>・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）</li> </ul>
投資方針	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。
<b>その他</b>	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

### （３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

りそなアセットマネジメント株式会社の運用体制に関する社内規則等は次の通りです。

委託会社では、運用に関する社内規程およびリスク管理規程を定め、適切な運用を行うと共に運用リスクの管理を行っています。

#### ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 3) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

#### 収益分配金の支払い

##### <分配金再投資コース(自動けいぞく投資コース)>

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

##### <分配金受取りコース(一般コース)>

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

### (5) 【投資制限】

#### 約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- 3) 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記1.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

## 9) 信用取引の指図範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 前記1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
  - ロ) 株式分割により取得する株券
  - ハ) 有償増資により取得する株券
  - ニ) 売出しにより取得する株券
  - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限り、）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け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
  - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定す

る全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
  - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。
  - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、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け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
  - 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ヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### 11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

#### 12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対

象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3．において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

- 4．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- 5．前記3．および4．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 6．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 7．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### 13) 直物為替先渡取引の運用指図

- 1．委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- 2．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- 3．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3．において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する直物為替先渡取引の一部の解約（反対の売買による解消を含む。）を指図するものとします。
- 4．前記3．においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- 5．直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- 6．委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

### 14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

- 1．委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
  - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。

2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### 16) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

#### 17) 資金の借入れ

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

4. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

#### 法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスク

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

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

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

#### 市場リスク

##### ・株価変動リスク

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

##### ・金利（債券価格）変動リスク

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



- ・リートの価格変動リスク  
リートの価格は、不動産市況（不動産価格、賃貸料等）、金利・景気動向、社会情勢の変化、関係法令・各種規制等の変更、災害等の要因により変動します。リートの価格および分配金がその影響を受け下落した場合は、基準価額の下落要因となります。
- ・為替変動リスク  
為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。
- 資産配分リスク  
複数資産（国内・外の株式、債券、リート等）への投資を行うため、投資割合が高い資産の価格が下落した場合、当ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。
- 信用リスク  
実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合またはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。
- 流動性リスク  
時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。
- カントリーリスク  
投資対象国・地域（特に新興国）において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となる場合があります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

#### （その他の留意点）

当ファンドは合成ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は合成ベンチマークの動きから乖離する場合があります。

- ・組入資産の時価変動等の理由により、基本的資産配分から実際の資産配分比率が乖離する場合があります。
- ・合成ベンチマークを構成する指数の全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、構成銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があります。
- ・有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があります。
- ・外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があります。
- ・運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。

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がかつた場合も同様です。

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、2016年2月から2021年1月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2018年9月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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

## 各資産クラスの指数

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

## ○ 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

## 東京株価指数 (TOPIX, 配当込み)

東京株価指数 (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。

## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	18.1	32.2	34.1	37.2	9.3	11.4	19.3
最小値	△10.6	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値	3.7	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年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- \* 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。

## 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0.2145%（税抜0.195%）の率を乗じて得た額とします。

ただし、R M新興国債券マザーファンドがETF（上場投資信託証券）を保有した場合に受益者が負担する実質的な信託報酬率の合計値は0.237%（年率、税込）程度

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
0.075%	0.100%	0.020%

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す（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

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

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

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

#### (5) 【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

##### 1) 収益分配金に対する課税

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

##### 2) 解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

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

法人受益者の場合

##### 1) 収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

##### 2) 益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

個別元本

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

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

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

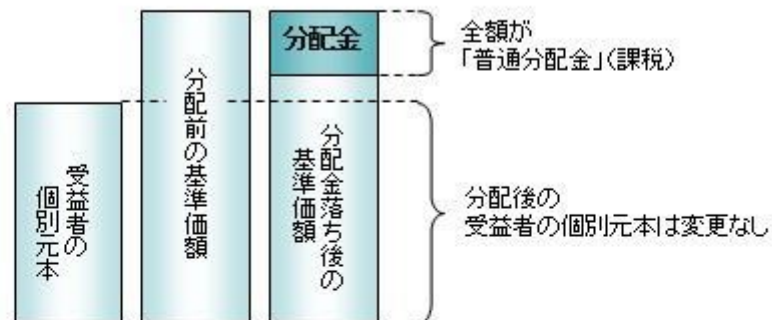
##### 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

## 2) 受益者が収益分配金を受け取る際

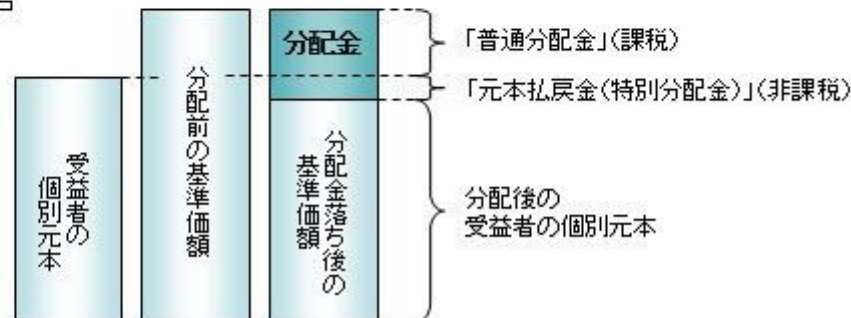
- イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
- ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
- ハ) 収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

## &lt;分配金に関するイメージ図&gt;

## イ) の場合



## ロ)、ハ) の場合



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

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

## 5 【運用状況】

## 【つみたてバランスファンド】

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。

## (1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	11,437,925,365	99.74
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		30,098,259	0.26
合計(純資産総額)		11,468,023,624	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国内株式マザーファンド	2,604,209,212	1.1336	2,952,264,293	1.2958	3,374,534,296	29.43
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	2,186,256,912	1.0521	2,300,165,616	1.0497	2,294,913,880	20.01
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	1,467,771,171	1.3482	1,978,954,797	1.5612	2,291,484,352	19.98
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	911,030,444	1.1641	1,060,540,236	1.3025	1,186,617,153	10.35
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	357,193,819	1.2955	462,761,406	1.6223	579,475,532	5.05
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	551,267,883	0.9254	510,158,195	1.0463	576,791,585	5.03
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	533,914,335	1.0594	565,681,395	1.0654	568,832,332	4.96
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	522,388,167	1.0434	545,072,301	1.0821	565,276,235	4.93

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	99.74
合 計	99.74

## 【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 (2018年 7月25日)	556	556	1.0211	1.0211
第2計算期間末 (2019年 7月25日)	3,291	3,291	1.0322	1.0322
第3計算期間末 (2020年 7月27日)	7,744	7,744	1.0317	1.0317
2020年 1月末日	5,562		1.0947	
2月末日	5,578		1.0302	



3月末日	5,426		0.9327
4月末日	6,062		0.9706
5月末日	6,742		1.0100
6月末日	7,197		1.0164
7月末日	7,620		1.0163
8月末日	8,425		1.0650
9月末日	8,783		1.0546
10月末日	9,035		1.0331
11月末日	10,159		1.1089
12月末日	10,892		1.1355
2021年 1月末日	11,468		1.1500

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	0.0000
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.0000
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0.0000
当中間期	2020年 7月28日～2021年 1月27日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	2.11
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1.09
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0.05
当中間期	2020年 7月28日～2021年 1月27日	12.48

(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	2017年10月26日～2018年 7月25日	548,362,039	3,063,179
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,744,605,538	101,031,481
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	4,603,201,837	284,995,956
当中間期	2020年 7月28日～2021年 1月27日	2,790,663,722	319,815,196

(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-GENUSSSCHEIN	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	WUXI 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
	ブラジルレアル	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。

## 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。

#### R A M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	大和証券リビング投資法人	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
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	SEGRO 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)

2018年7月25日	0円
2019年7月25日	0円
2020年7月27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国内株式マザーファンド	29.4
RAM先進国株式マザーファンド	20.0
RAM新興国株式マザーファンド	5.1
RAM国内債券マザーファンド	20.0
RAM先進国債券マザーファンド	5.0
RAM新興国債券マザーファンド	4.9
RAM国内リートマザーファンド	10.3
RAM先進国リートマザーファンド	5.0
現金等	0.3
合計	100.0

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

## ■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	60.2
米ドル	22.0
ユーロ	4.8
英ポンド	1.4
香港ドル	1.2
その他	10.3
合計	100.0

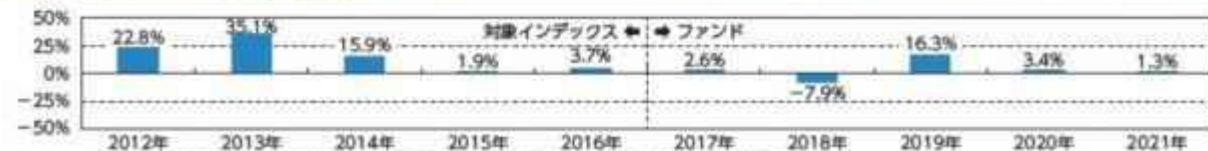
※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。  
 ※上記通貨別組入比率は、各マザーファンドが実質的に保有している株式・債券等の通貨を基準に算出しています。

## ■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内株式	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
国内債券	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING SP ADR	-	4.97
	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
先進国債券	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
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	-	7.00
	日本	ジャパル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
先進国リート	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)



・2012年から2016年までは、対象インデックス(合成ベンチマーク)の年間騰落率です。  
 ・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。  
 ・2017年は10月26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  
販売会社所定の方法でお申し込みください。
- (2) コースの選択  
収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞と＜分配金受取りコース（一般コース）＞の2通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。  
＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞  
収益分配金を自動的に再投資するコースです。  
＜分配金受取りコース（一般コース）＞  
収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。
- (3) 申込みの受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (4) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (5) 取得申込不可日  
販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
・ニューヨークの銀行の休業日  
・ニューヨーク証券取引所の休業日  
・ロンドンの銀行の休業日  
・ロンドン証券取引所の休業日
- (6) 申込金額  
取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。
- (7) 申込単位  
最低単位を1円または1口単位として販売会社が定める単位とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- (8) 申込代金の支払い  
取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。
- (9) 受付の中止および取消  
委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得の申込みの受付を中止すること、および既に受け付けた取得の申込みの受付を取り消すことができます。  
金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。

## 2【換金（解約）手続等】

- (1) 解約の受付  
販売会社の営業日に受け付けます。
- (2) 取扱時間  
原則として、午後3時までに、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。なお、上記時刻を過ぎた場合は、翌営業日の取扱いとなります。
- (3) 解約請求不可日  
販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。  
・ニューヨークの銀行の休業日  
・ニューヨーク証券取引所の休業日  
・ロンドンの銀行の休業日  
・ロンドン証券取引所の休業日
- (4) 解約制限  
ファンドの規模および商品性格などにに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

## (5) 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

## 委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## (6) 手取額

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

税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。

詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

## (7) 解約単位

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

## (8) 解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

## (9) 受付の中止および取消

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

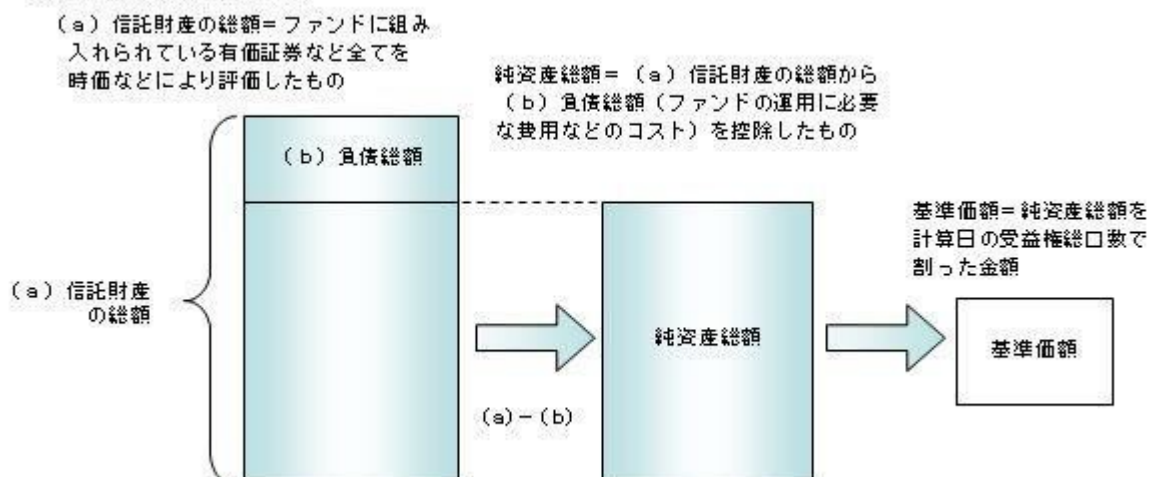
## 3【資産管理等の概要】

## (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。

## &lt;基準価額算出の流れ&gt;



## 有価証券などの評価基準

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

す。

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

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

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

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

\*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（2）【保管】

該当事項はありません。

（3）【信託期間】

無期限とします（2017年10月26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7月26日から翌年7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。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
  - イ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
  - ロ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
  - ハ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
  - ニ) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

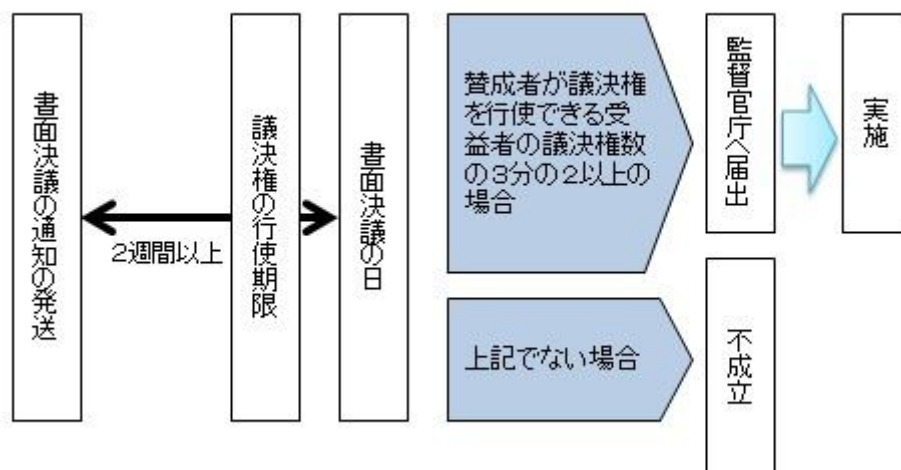
信託約款の変更など

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

書面決議

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

## ＜書面決議の主な流れ＞



## 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

## 運用報告書の作成

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

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

## 関係法人との契約について

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

## 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

## 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

## (1) 収益分配金・償還金受領権

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

## (2) 解約請求権

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

## (3) 帳簿閲覧権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (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3期計算期間(2019年 7月26日から2020年 7月27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】

## 【つみたてバランスファンド】

## ( 1 ) 【貸借対照表】

( 単位：円 )

	第2期 2019年 7月25日現在	第3期 2020年 7月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	16,238,120	41,438,298
親投資信託受益証券	3,279,255,746	7,713,098,239
流動資産合計	3,295,493,866	7,754,536,537
資産合計	3,295,493,866	7,754,536,537
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,410,134	2,733,612
未払受託者報酬	259,677	683,592
未払委託者報酬	2,272,129	5,981,382
未払利息	44	112
その他未払費用	129,783	290,435
流動負債合計	4,071,767	9,689,133
負債合計	4,071,767	9,689,133
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,188,872,917	7,507,078,798
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	102,549,182	237,768,606
( 分配準備積立金 )	85,590,407	191,711,824
元本等合計	3,291,422,099	7,744,847,404
純資産合計	3,291,422,099	7,744,847,404
負債純資産合計	3,295,493,866	7,754,536,537

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2018年 7月26日	自	2019年 7月26日
	至	2019年 7月25日	至	2020年 7月27日
営業収益				
有価証券売買等損益		83,722,623		48,942,493
営業収益合計		83,722,623		48,942,493
営業費用				
支払利息		8,174		24,393
受託者報酬		373,217		1,166,627
委託者報酬		3,265,522		10,207,869
その他費用		186,884		499,187
営業費用合計		3,833,797		11,898,076
営業利益又は営業損失（ ）		79,888,826		37,044,417
経常利益又は経常損失（ ）		79,888,826		37,044,417
当期純利益又は当期純損失（ ）		79,888,826		37,044,417
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（ ）		347,250		405,406
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		11,501,654		102,549,182
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,117,941		107,624,613
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,117,941		107,624,613
剰余金減少額又は欠損金増加額		611,989		9,855,012
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		611,989		9,855,012
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		102,549,182		237,768,606



## (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7月26日から翌年7月25日までとなっております。ただし、当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2019年7月26日から2020年7月27日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2期 2019年7月25日現在		第3期 2020年7月27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	545,298,860円	期首元本額	3,188,872,917円
期中追加設定元本額	2,744,605,538円	期中追加設定元本額	4,603,201,837円
期中一部解約元本額	101,031,481円	期中一部解約元本額	284,995,956円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	3,188,872,917口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	7,507,078,798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	1.0322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	1.0317円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,322円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額)	(10,317円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2018年7月26日 至 2019年7月25日		第3期 自 2019年7月26日 至 2020年7月27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	39,815,689円	A 費用控除後の配当等収益額	110,914,577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	39,725,887円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円
C 収益調整金額	39,716,068円	C 収益調整金額	219,159,100円
D 分配準備積立金額	6,048,831円	D 分配準備積立金額	80,797,247円
E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	125,306,475円	E 当ファンドの分配対象収益額 (E=A+B+C+D)	410,870,924円
F 当ファンドの期末残存口数	3,188,872,917口	F 当ファンドの期末残存口数	7,507,078,798口
G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	392円	G 10,000口当たり収益分配対象額 (G=E/F×10,000)	547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2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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2期 2019年 7月25日現在	第3期 2020年 7月27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2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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2期 自 2018年 7月26日 至 2019年 7月25日	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27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	83,666,500	92,493,244
合計	83,666,500	92,493,244

## 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国内株式マザーファンド	2,080,350,763	2,326,664,293	
	R A M国内リートマザーファンド	676,734,334	782,440,236	
	R A M先進国株式マザーファンド	1,144,518,133	1,524,154,797	
	R A M新興国株式マザーファンド	299,837,531	384,961,406	
	R A M先進国リートマザーファンド	412,484,360	377,258,195	
	R A M国内債券マザーファンド	1,474,116,724	1,551,065,616	
	R A M先進国債券マザーファンド	361,996,029	383,281,395	
	R A M新興国債券マザーファンド	368,283,176	383,272,301	
合計		6,818,321,050	7,713,098,239	

(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「R A M国内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 A M新興国株式マザーファンド」、「R A M国内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 A M新興国債券マザーファンド」、「R A M国内リートマザーファンド」および「R A M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国内株式マザーファンド

#### 貸借対照表

(単位：円)

2020年 7月27日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	432,067,596
株式	26,845,238,190
派生商品評価勘定	733,350
未収入金	19,191,826
未収配当金	33,415,400

2020年 7月27日現在

前払金	12,545,000
差入委託証拠金	16,530,000
流動資産合計	27,359,721,362
資産合計	27,359,721,362
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,844,300
未払金	72,177,251
未払解約金	3,088,000
未払利息	1,171
流動負債合計	87,110,722
負債合計	87,110,722
純資産の部	
元本等	
元本	24,384,590,778
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,888,019,862
元本等合計	27,272,610,640
純資産合計	27,272,610,640
負債純資産合計	27,359,721,362

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	26,668,234,398円
期中追加設定元本額	35,164,870,676円
期中一部解約元本額	37,448,514,296円
期末元本額	24,384,590,778円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	1,705,146,782円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,213,573,607円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,111,936,980円
DCりそな グローバルバランス	33,795,255円
つみたてバランスファンド	2,080,350,763円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	695,553,585円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	343,062,813円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	205,035,444円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,608,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	11,143,239円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,961,213円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,771,567円
リスクコントロール・オープン	5,150,901円
FWりそな国内株式アクティブファンド	196,941,729円
FWりそな国内株式インデックスファンド	11,058,055,556円
Smart-i TOPIXインデックス	929,396,480円
Smart-i 8資産バランス 安定型	89,474,074円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	269,848,296円
Smart-i 8資産バランス 成長型	299,577,000円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	340,110,389円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	244,877,619円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	155,375,135円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	100,063,513円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	317,639,747円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	51,619,540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)	1,933,118円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	532,001,366円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	827,263,864円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,495,483,821円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	45,838,639円
2. 計算日における受益権の総数	24,384,590,778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	1.1184円
(10,000口当たり純資産額)	(11,184円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 7月27日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

### 1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	591,599,136	
合計	591,599,136	

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2020年 7月27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	株価指数先物取引					
	買建	468,875,950	-		457,765,000	11,110,950
合計		468,875,950	-		457,765,000	11,110,950

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	600	2,720.00	1,632,000	
日本水産	16,500	468.00	7,722,000	
マルハニチロ	2,400	2,142.00	5,140,800	
カネコ種苗	500	1,450.00	725,000	
サカタのタネ	2,000	3,335.00	6,670,000	
ホクト	1,300	2,100.00	2,730,000	



ホクリヨウ	300	641.00	192,300
住石ホールディングス	3,300	126.00	415,800
日鉄鉱業	400	4,365.00	1,746,000
三井松島ホールディングス	600	772.00	463,200
国際石油開発帝石	66,200	668.00	44,221,600
石油資源開発	2,200	1,859.00	4,089,800
K & O エナジーグループ	800	1,527.00	1,221,600
ヒノキヤグループ	400	1,560.00	624,000
ショーボンドホールディングス	2,600	4,790.00	12,454,000
ミライト・ホールディングス	4,900	1,598.00	7,830,200
タマホーム	900	1,189.00	1,070,100
サンヨーホームズ	100	612.00	61,200
日本アクア	700	638.00	446,600
ファーストコーポレーション	500	600.00	300,000
ベステラ	300	1,009.00	302,700
TATERU	3,300	164.00	541,200
キャンディル	300	562.00	168,600
スペースバリューホールディングス	2,000	365.00	730,000
ダイセキ環境ソリューション	300	706.00	211,800
第一カッター興業	200	2,511.00	502,200
明豊ファシリティワークス	500	595.00	297,500
安藤・間	9,800	601.00	5,889,800
東急建設	4,800	542.00	2,601,600
コムシスホールディングス	5,900	3,235.00	19,086,500
ビーアールホールディングス	1,800	604.00	1,087,200
高松コンストラクショングループ	1,000	2,322.00	2,322,000
東建コーポレーション	500	7,130.00	3,565,000
ソネック	200	821.00	164,200
ヤマウラ	700	835.00	584,500
大成建設	12,700	3,845.00	48,831,500
大林組	38,100	998.00	38,023,800
清水建設	38,700	843.00	32,624,100
飛島建設	1,100	1,100.00	1,210,000
長谷工コーポレーション	14,800	1,307.00	19,343,600
松井建設	1,500	671.00	1,006,500
銭高組	200	3,980.00	796,000
鹿島建設	29,900	1,239.00	37,046,100
不動テトラ	1,000	1,428.00	1,428,000
大末建設	400	822.00	328,800
鉄建建設	800	2,029.00	1,623,200
西松建設	2,900	2,102.00	6,095,800
三井住友建設	9,200	458.00	4,213,600

大豊建設	900	2,418.00	2,176,200
前田建設工業	9,500	760.00	7,220,000
佐田建設	800	415.00	332,000
ナカノフドー建設	1,000	399.00	399,000
奥村組	2,100	2,589.00	5,436,900
東鉄工業	1,600	2,711.00	4,337,600
イチケン	300	1,541.00	462,300
富士ピー・エス	600	598.00	358,800
浅沼組	400	4,210.00	1,684,000
戸田建設	15,800	705.00	11,139,000
熊谷組	1,800	2,590.00	4,662,000
北野建設	200	2,671.00	534,200
植木組	200	2,444.00	488,800
矢作建設工業	1,700	809.00	1,375,300
ピーエス三菱	1,300	520.00	676,000
日本ハウスホールディングス	2,600	268.00	696,800
大東建託	4,200	10,135.00	42,567,000
新日本建設	1,600	877.00	1,403,200
N I P P O	3,200	2,867.00	9,174,400
東亜道路工業	200	3,210.00	642,000
前田道路	3,400	2,009.00	6,830,600
日本道路	400	7,540.00	3,016,000
東亜建設工業	1,200	1,585.00	1,902,000
日本国土開発	3,700	560.00	2,072,000
若築建設	700	1,232.00	862,400
東洋建設	4,300	399.00	1,715,700
五洋建設	15,100	574.00	8,667,400
世紀東急工業	1,800	748.00	1,346,400
福田組	400	4,915.00	1,966,000
住友林業	9,700	1,317.00	12,774,900
日本基礎技術	1,300	403.00	523,900
巴コーポレーション	1,700	343.00	583,100
大和ハウス工業	37,700	2,540.00	95,758,000
ライト工業	2,200	1,528.00	3,361,600
積水ハウス	41,300	2,103.50	86,874,550
日特建設	1,000	788.00	788,000
北陸電気工事	700	1,002.00	701,400
ユアテック	2,200	658.00	1,447,600
日本リーテック	800	3,200.00	2,560,000
四電工	200	2,414.00	482,800
中電工	1,500	2,289.00	3,433,500
関電工	5,400	894.00	4,827,600

きんでん	9,100	1,716.00	15,615,600
東京エネシス	1,300	785.00	1,020,500
トーエネック	400	3,695.00	1,478,000
住友電設	1,100	2,389.00	2,627,900
日本電設工業	2,100	2,381.00	5,000,100
協和エクシオ	5,800	2,625.00	15,225,000
新日本空調	1,000	2,389.00	2,389,000
九電工	2,700	3,205.00	8,653,500
三機工業	2,700	1,263.00	3,410,100
日揮ホールディングス	11,700	1,144.00	13,384,800
中外炉工業	400	1,647.00	658,800
ヤマト	1,200	657.00	788,400
太平電業	900	2,169.00	1,952,100
高砂熱学工業	3,300	1,525.00	5,032,500
三晃金属工業	200	2,097.00	419,400
朝日工業社	300	3,170.00	951,000
明星工業	2,500	891.00	2,227,500
大気社	1,900	3,240.00	6,156,000
ダイダン	900	2,807.00	2,526,300
日比谷総合設備	1,200	1,913.00	2,295,600
フィル・カンパニー	200	1,837.00	367,400
OSJBホールディングス	6,000	244.00	1,464,000
東洋エンジニアリング	1,600	353.00	564,800
レイズネクスト	2,000	1,237.00	2,474,000
日本製粉	3,600	1,697.00	6,109,200
日清製粉グループ本社	13,800	1,576.00	21,748,800
日東富士製粉	100	6,050.00	605,000
昭和産業	1,100	3,450.00	3,795,000
鳥越製粉	1,100	932.00	1,025,200
中部飼料	1,500	1,674.00	2,511,000
フィード・ワン	8,100	202.00	1,636,200
東洋精糖	200	1,194.00	238,800
日本甜菜製糖	600	1,814.00	1,088,400
三井製糖	1,100	2,032.00	2,235,200
塩水港精糖	1,300	216.00	280,800
日新製糖	600	1,864.00	1,118,400
森永製菓	2,900	3,965.00	11,498,500
中村屋	300	4,100.00	1,230,000
江崎グリコ	3,600	5,030.00	18,108,000
名糖産業	600	1,381.00	828,600
井村屋グループ	700	2,350.00	1,645,000
不二家	700	2,188.00	1,531,600

山崎製パン	9,100	1,817.00	16,534,700
第一屋製パン	200	983.00	196,600
モロゾフ	200	5,450.00	1,090,000
亀田製菓	700	5,550.00	3,885,000
寿スピリッツ	1,200	4,060.00	4,872,000
カルビー	5,600	3,090.00	17,304,000
森永乳業	2,300	4,835.00	11,120,500
六甲バター	800	1,596.00	1,276,800
ヤクルト本社	8,400	6,410.00	53,844,000
明治ホールディングス	8,100	8,440.00	68,364,000
雪印メグミルク	2,900	2,538.00	7,360,200
プリマハム	1,900	2,752.00	5,228,800
日本ハム	4,700	4,325.00	20,327,500
林兼産業	400	572.00	228,800
丸大食品	1,300	1,943.00	2,525,900
S Foods	1,000	2,564.00	2,564,000
柿安本店	400	2,609.00	1,043,600
伊藤ハム米久ホールディングス	7,900	643.00	5,079,700
サッポロホールディングス	4,200	1,935.00	8,127,000
アサヒグループホールディングス	25,500	3,610.00	92,055,000
キリンホールディングス	51,700	2,083.00	107,691,100
宝ホールディングス	9,000	942.00	8,478,000
オエノンホールディングス	3,200	419.00	1,340,800
養命酒製造	400	1,828.00	731,200
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	8,600	1,749.00	15,041,400
サントリー食品インターナショナル	8,200	4,135.00	33,907,000
ダイドーグループホールディングス	600	4,685.00	2,811,000
伊藤園	3,700	6,290.00	23,273,000
キーコーヒー	1,200	2,216.00	2,659,200
ユニカフェ	300	1,015.00	304,500
ジャパンフーズ	200	1,218.00	243,600
日清オイリオグループ	1,600	3,345.00	5,352,000
不二製油グループ本社	3,000	2,849.00	8,547,000
かどや製油	100	3,765.00	376,500
J - オイルミルズ	600	4,080.00	2,448,000
キッコーマン	8,800	4,895.00	43,076,000
味の素	26,900	1,731.50	46,577,350
キュービー	6,800	1,946.00	13,232,800
ハウス食品グループ本社	4,600	3,355.00	15,433,000
カゴメ	4,600	3,140.00	14,444,000
焼津水産化学工業	600	900.00	540,000
アリアケジャパン	1,100	6,670.00	7,337,000

ピエトロ	200	1,650.00	330,000
エバラ食品工業	300	2,190.00	657,000
やまみ	100	2,227.00	222,700
ニチレイ	5,800	2,916.00	16,912,800
東洋水産	6,300	6,330.00	39,879,000
イートアンド	400	1,800.00	720,000
大冷	200	2,073.00	414,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	700	903.00	632,100
日清食品ホールディングス	5,200	9,510.00	49,452,000
永谷園ホールディングス	600	2,196.00	1,317,600
一正蒲鉾	500	1,003.00	501,500
フジッコ	1,300	2,081.00	2,705,300
ロック・フィールド	1,300	1,291.00	1,678,300
日本たばこ産業	70,400	1,897.50	133,584,000
ケンコーマヨネーズ	700	1,902.00	1,331,400
わらべや日洋ホールディングス	800	1,576.00	1,260,800
なとり	700	1,820.00	1,274,000
イフジ産業	200	834.00	166,800
ピクルスコーポレーション	300	2,809.00	842,700
北の達人コーポレーション	4,300	528.00	2,270,400
ユーグレナ	5,300	766.00	4,059,800
ミヨシ油脂	500	1,131.00	565,500
理研ビタミン	1,200	2,359.00	2,830,800
片倉工業	1,700	1,137.00	1,932,900
ゲンゼ	900	4,055.00	3,649,500
東洋紡	4,700	1,531.00	7,195,700
ユニチカ	3,500	358.00	1,253,000
富士紡ホールディングス	600	3,040.00	1,824,000
倉敷紡績	1,200	2,139.00	2,566,800
シキボウ	600	1,051.00	630,600
日本毛織	3,900	957.00	3,732,300
ダイトウボウ	1,900	120.00	228,000
トーア紡コーポレーション	500	482.00	241,000
ダイドーリミテッド	1,500	194.00	291,000
帝国繊維	1,300	2,443.00	3,175,900
帝人	9,700	1,660.00	16,102,000
東レ	86,200	499.30	43,039,660
サカイオーベックス	300	2,225.00	667,500
住江織物	300	1,978.00	593,400
日本フェルト	700	485.00	339,500
イチカワ	200	1,300.00	260,000
日東製網	100	1,397.00	139,700

アツギ	1,000	583.00	583,000
ダイニック	400	787.00	314,800
セーレン	2,900	1,328.00	3,851,200
ソトー	500	958.00	479,000
東海染工	200	1,125.00	225,000
小松マテーレ	2,000	748.00	1,496,000
ワコールホールディングス	3,000	1,961.00	5,883,000
ホギメディカル	1,400	3,275.00	4,585,000
クラウディアホールディングス	300	332.00	99,600
T S Iホールディングス	4,000	322.00	1,288,000
マツオカコーポレーション	300	1,853.00	555,900
ワールド	1,700	1,398.00	2,376,600
三陽商会	600	628.00	376,800
ナイガイ	400	354.00	141,600
オンワードホールディングス	7,100	311.00	2,208,100
ルックホールディングス	400	734.00	293,600
キムラタン	6,200	25.00	155,000
ゴールドウイン	2,200	6,610.00	14,542,000
デサント	2,300	1,807.00	4,156,100
キング	600	535.00	321,000
ヤマトインターナショナル	1,000	340.00	340,000
特種東海製紙	800	4,765.00	3,812,000
王子ホールディングス	49,800	477.00	23,754,600
日本製紙	5,300	1,434.00	7,600,200
三菱製紙	1,300	349.00	453,700
北越コーポレーション	7,100	373.00	2,648,300
中越パルプ工業	500	1,561.00	780,500
巴川製紙所	400	879.00	351,600
大王製紙	5,200	1,437.00	7,472,400
阿波製紙	300	486.00	145,800
レンゴー	11,300	833.00	9,412,900
トモク	700	1,819.00	1,273,300
ザ・パック	900	2,858.00	2,572,200
クラレ	18,700	1,100.00	20,570,000
旭化成	78,900	812.00	64,066,800
共和レザー	600	642.00	385,200
昭和電工	8,500	2,366.00	20,111,000
住友化学	87,500	332.00	29,050,000
住友精化	500	3,430.00	1,715,000
日産化学	6,600	5,700.00	37,620,000
ラサ工業	400	1,584.00	633,600
クレハ	1,000	4,640.00	4,640,000

多木化学	500	7,100.00	3,550,000
テイカ	900	1,369.00	1,232,100
石原産業	2,100	731.00	1,535,100
片倉コープアグリ	300	1,242.00	372,600
日本曹達	1,800	2,846.00	5,122,800
東ソー	18,400	1,479.00	27,213,600
トクヤマ	3,400	2,621.00	8,911,400
セントラル硝子	2,400	2,037.00	4,888,800
東亜合成	7,500	1,087.00	8,152,500
大阪ソーダ	1,200	2,378.00	2,853,600
関東電化工業	2,800	857.00	2,399,600
デンカ	4,300	2,701.00	11,614,300
信越化学工業	20,400	13,525.00	275,910,000
日本カーバイド工業	400	1,231.00	492,400
堺化学工業	800	2,140.00	1,712,000
第一稀元素化学工業	1,300	788.00	1,024,400
エア・ウォーター	11,100	1,466.00	16,272,600
大陽日酸	11,400	1,887.00	21,511,800
日本化学工業	400	2,228.00	891,200
東邦アセチレン	200	1,232.00	246,400
日本パーカライズング	6,000	1,124.00	6,744,000
高压ガス工業	1,900	850.00	1,615,000
チタン工業	100	1,770.00	177,000
四国化成工業	1,800	1,142.00	2,055,600
戸田工業	300	1,794.00	538,200
ステラ ケミファ	600	2,827.00	1,696,200
保土谷化学工業	400	4,705.00	1,882,000
日本触媒	1,800	5,580.00	10,044,000
大日精化工業	1,100	2,479.00	2,726,900
カネカ	3,100	2,683.00	8,317,300
三菱瓦斯化学	11,100	1,676.00	18,603,600
三井化学	10,800	2,200.00	23,760,000
J S R	11,100	2,273.00	25,230,300
東京応化工業	2,000	5,720.00	11,440,000
大阪有機化学工業	1,100	2,822.00	3,104,200
三菱ケミカルホールディングス	79,600	622.10	49,519,160
K Hネオケム	2,100	2,127.00	4,466,700
ダイセル	15,500	797.00	12,353,500
住友ベークライト	1,900	2,903.00	5,515,700
積水化学工業	25,200	1,526.00	38,455,200
日本ゼオン	10,700	1,046.00	11,192,200
アイカ工業	3,600	3,620.00	13,032,000

宇部興産	6,000	1,806.00	10,836,000
積水樹脂	2,100	2,234.00	4,691,400
タキロンシーアイ	2,600	707.00	1,838,200
旭有機材	700	1,409.00	986,300
ニチバン	600	1,558.00	934,800
リケンテクノス	3,000	421.00	1,263,000
大倉工業	600	1,550.00	930,000
積水化成成品工業	1,600	573.00	916,800
群栄化学工業	300	2,437.00	731,100
タイガースポリマー	600	474.00	284,400
ミライアル	400	1,114.00	445,600
ダイキアクシス	400	791.00	316,400
ダイキョーニシカワ	2,500	502.00	1,255,000
竹本容器	400	705.00	282,000
森六ホールディングス	600	1,669.00	1,001,400
日本化薬	7,400	1,079.00	7,984,600
カーリットホールディングス	1,300	520.00	676,000
日本精化	1,000	1,459.00	1,459,000
扶桑化学工業	1,200	4,220.00	5,064,000
トリケミカル研究所	300	11,150.00	3,345,000
A D E K A	5,500	1,492.00	8,206,000
日油	4,500	4,000.00	18,000,000
新日本理化	1,900	164.00	311,600
ハリマ化成グループ	1,000	987.00	987,000
花王	29,100	8,544.00	248,630,400
第一工業製薬	400	4,950.00	1,980,000
石原ケミカル	300	2,023.00	606,900
日華化学	400	876.00	350,400
ニイタカ	200	3,245.00	649,000
三洋化成工業	700	4,815.00	3,370,500
有機合成薬品工業	900	358.00	322,200
大日本塗料	1,300	996.00	1,294,800
日本ペイントホールディングス	9,800	7,640.00	74,872,000
関西ペイント	13,400	2,156.00	28,890,400
神東塗料	900	167.00	150,300
中国塗料	3,400	866.00	2,944,400
日本特殊塗料	900	1,037.00	933,300
藤倉化成	1,600	554.00	886,400
太陽ホールディングス	900	5,160.00	4,644,000
D I C	5,000	2,728.00	13,640,000
サカタインクス	2,600	1,063.00	2,763,800
東洋インキＳＣホールディングス	2,500	2,059.00	5,147,500



T & K TOKA	900	841.00	756,900
富士フィルムホールディングス	23,300	4,777.00	111,304,100
資生堂	24,200	6,615.00	160,083,000
ライオン	15,800	2,771.00	43,781,800
高砂香料工業	800	2,167.00	1,733,600
マンダム	2,700	1,861.00	5,024,700
ミルボン	1,600	5,080.00	8,128,000
ファンケル	4,900	3,195.00	15,655,500
コーセー	2,300	12,030.00	27,669,000
コタ	700	1,210.00	847,000
シーボン	200	1,913.00	382,600
ポーラ・オルビスホールディングス	5,200	1,752.00	9,110,400
ノエビアホールディングス	1,000	4,570.00	4,570,000
アジュバンコスメジャパン	300	939.00	281,700
エステー	800	1,850.00	1,480,000
アグロ カネショウ	500	1,433.00	716,500
コニシ	2,000	1,513.00	3,026,000
長谷川香料	2,100	2,291.00	4,811,100
星光PMC	700	735.00	514,500
小林製薬	3,400	9,100.00	30,940,000
荒川化学工業	1,100	1,258.00	1,383,800
メック	800	2,023.00	1,618,400
日本高純度化学	300	2,585.00	775,500
タカラバイオ	3,200	2,914.00	9,324,800
JCU	1,500	3,270.00	4,905,000
新田ゼラチン	800	667.00	533,600
OATアグリオ	200	1,082.00	216,400
デクセリアルズ	3,100	878.00	2,721,800
アース製薬	900	7,370.00	6,633,000
北興化学工業	1,200	602.00	722,400
大成ラミック	400	2,790.00	1,116,000
クミアイ化学工業	5,000	1,079.00	5,395,000
日本農薬	2,200	537.00	1,181,400
アキレス	800	1,942.00	1,553,600
有沢製作所	1,900	796.00	1,512,400
日東電工	8,400	6,290.00	52,836,000
レック	1,300	1,621.00	2,107,300
三光合成	1,400	277.00	387,800
きもと	2,000	180.00	360,000
藤森工業	1,100	3,585.00	3,943,500
前澤化成工業	800	1,002.00	801,600
未来工業	700	1,926.00	1,348,200

ウェーブロックホールディングス	400	825.00	330,000
J S P	700	1,485.00	1,039,500
エフピコ	1,300	8,520.00	11,076,000
天馬	800	1,682.00	1,345,600
信越ポリマー	2,200	1,002.00	2,204,400
東リ	3,000	272.00	816,000
ニフコ	4,500	2,518.00	11,331,000
バルカー	1,000	1,917.00	1,917,000
ユニ・チャーム	23,400	4,779.00	111,828,600
ショーエイコーポレーション	200	959.00	191,800
協和キリン	12,200	2,686.00	32,769,200
武田薬品工業	101,100	3,807.00	384,887,700
アステラス製薬	105,400	1,739.50	183,343,300
大日本住友製薬	9,000	1,376.00	12,384,000
塩野義製薬	15,300	6,374.00	97,522,200
わかもと製薬	1,400	267.00	373,800
あすか製薬	1,400	1,200.00	1,680,000
日本新薬	3,200	8,430.00	26,976,000
ピオフェルミン製薬	200	2,415.00	483,000
中外製薬	38,000	5,095.00	193,610,000
科研製薬	2,100	4,985.00	10,468,500
エーザイ	14,500	8,746.00	126,817,000
ロート製薬	6,200	3,355.00	20,801,000
小野薬品工業	27,900	3,039.00	84,788,100
久光製薬	3,200	4,780.00	15,296,000
持田製薬	1,700	3,965.00	6,740,500
参天製薬	22,700	1,872.00	42,494,400
扶桑薬品工業	400	2,490.00	996,000
日本ケミファ	200	2,549.00	509,800
ツムラ	3,800	2,754.00	10,465,200
日医工	3,400	1,292.00	4,392,800
キッセイ薬品工業	2,200	2,306.00	5,073,200
生化学工業	2,400	1,092.00	2,620,800
栄研化学	2,100	1,677.00	3,521,700
日水製薬	500	1,137.00	568,500
鳥居薬品	800	3,500.00	2,800,000
J C R ファーマ	900	10,380.00	9,342,000
東和薬品	1,600	1,987.00	3,179,200
富士製薬工業	800	1,155.00	924,000
沢井製薬	2,500	5,330.00	13,325,000
ゼリア新薬工業	2,200	1,932.00	4,250,400
第一三共	34,800	8,666.00	301,576,800

キョーリン製薬ホールディングス	2,700	2,010.00	5,427,000
大幸薬品	1,500	2,170.00	3,255,000
ダイト	700	3,145.00	2,201,500
大塚ホールディングス	23,200	4,508.00	104,585,600
大正製薬ホールディングス	2,600	6,350.00	16,510,000
ペプチドリーム	6,200	4,520.00	28,024,000
日本コークス工業	10,100	65.00	656,500
ニチレキ	1,400	1,681.00	2,353,400
ユシロ化学工業	700	1,330.00	931,000
ビーピー・カストロール	400	1,153.00	461,200
富士石油	3,200	164.00	524,800
MORESCO	400	1,021.00	408,400
出光興産	13,500	2,307.00	31,144,500
ENEOSホールディングス	182,900	392.80	71,843,120
コスモエネルギーホールディングス	3,500	1,640.00	5,740,000
横浜ゴム	7,000	1,520.00	10,640,000
TOYO TIRE	7,000	1,497.00	10,479,000
ブリヂストン	35,000	3,428.00	119,980,000
住友ゴム工業	10,900	980.00	10,682,000
藤倉コンポジット	1,100	382.00	420,200
オカモト	700	4,210.00	2,947,000
フコク	500	630.00	315,000
ニッタ	1,400	2,337.00	3,271,800
住友理工	2,400	585.00	1,404,000
三ツ星ベルト	1,600	1,867.00	2,987,200
バンドー化学	2,100	666.00	1,398,600
日東紡績	1,800	5,050.00	9,090,000
AGC	12,000	3,095.00	37,140,000
日本板硝子	5,800	402.00	2,331,600
石塚硝子	200	1,837.00	367,400
日本山村硝子	500	879.00	439,500
日本電気硝子	4,900	1,724.00	8,447,600
オハラ	500	1,037.00	518,500
住友大阪セメント	2,300	3,740.00	8,602,000
太平洋セメント	7,700	2,433.00	18,734,100
日本ヒューム	1,200	802.00	962,400
日本コンクリート工業	2,600	278.00	722,800
三谷セキサン	600	5,700.00	3,420,000
アジアパイルホールディングス	1,700	490.00	833,000
東海カーボン	12,700	970.00	12,319,000
日本カーボン	600	3,480.00	2,088,000
東洋炭素	700	1,759.00	1,231,300

ノリタケカンパニーリミテド	700	3,340.00	2,338,000	
TOTO	8,700	4,200.00	36,540,000	
日本碍子	14,600	1,460.00	21,316,000	
日本特殊陶業	9,200	1,550.00	14,260,000	
ダントーホールディングス	900	168.00	151,200	
MARUWA	500	8,610.00	4,305,000	
品川リフラクトリーズ	300	2,241.00	672,300	
黒崎播磨	200	3,540.00	708,000	
ヨータイ	1,000	730.00	730,000	
イソライト工業	600	434.00	260,400	
東京窯業	1,500	311.00	466,500	
ニッカトー	500	730.00	365,000	
フジミインコーポレーテッド	1,100	3,630.00	3,993,000	
クニミネ工業	500	988.00	494,000	
エーアンドエーマテリアル	200	1,036.00	207,200	
ニチアス	3,300	2,432.00	8,025,600	
ニチハ	1,700	2,360.00	4,012,000	
日本製鉄	53,800	985.50	53,019,900	
神戸製鋼所	22,000	383.00	8,426,000	
中山製鋼所	1,700	369.00	627,300	
合同製鐵	600	1,813.00	1,087,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	32,500	786.00	25,545,000	
東京製鐵	5,900	640.00	3,776,000	
共英製鋼	1,400	1,281.00	1,793,400	
大和工業	2,600	2,231.00	5,800,600	
東京鐵鋼	500	1,532.00	766,000	
大阪製鐵	600	1,232.00	739,200	
淀川製鋼所	1,600	1,920.00	3,072,000	
丸一鋼管	3,900	2,675.00	10,432,500	
モリ工業	400	2,254.00	901,600	
大同特殊鋼	2,000	3,495.00	6,990,000	
日本高周波鋼業	400	337.00	134,800	
日本冶金工業	1,000	1,596.00	1,596,000	
山陽特殊製鋼	800	879.00	703,200	
愛知製鋼	700	2,896.00	2,027,200	
日立金属	12,900	1,353.00	17,453,700	
日本金属	300	597.00	179,100	
大平洋金属	800	1,601.00	1,280,800	
新日本電工	7,700	153.00	1,178,100	
栗本鐵工所	600	1,646.00	987,600	
虹技	200	1,278.00	255,600	
日本鑄鐵管	100	1,265.00	126,500	

三菱製鋼	900	612.00	550,800
日亜鋼業	1,700	303.00	515,100
日本精線	200	3,545.00	709,000
エンビプロ・ホールディングス	500	528.00	264,000
シンニッタン	1,800	233.00	419,400
新家工業	300	1,186.00	355,800
大紀アルミニウム工業所	2,000	549.00	1,098,000
日本軽金属ホールディングス	30,400	186.00	5,654,400
三井金属鉱業	3,200	2,377.00	7,606,400
東邦亜鉛	600	1,626.00	975,600
三菱マテリアル	7,900	2,283.00	18,035,700
住友金属鉱山	15,400	3,309.00	50,958,600
D O W Aホールディングス	3,000	3,255.00	9,765,000
古河機械金属	2,100	1,108.00	2,326,800
エス・サイエンス	5,300	45.00	238,500
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,200	916.00	1,099,200
東邦チタニウム	2,200	676.00	1,487,200
U A C J	1,800	1,878.00	3,380,400
C Kサンエツ	300	3,095.00	928,500
古河電気工業	3,700	2,628.00	9,723,600
住友電気工業	44,900	1,258.50	56,506,650
フジクラ	14,500	314.00	4,553,000
昭和電線ホールディングス	1,400	1,313.00	1,838,200
東京特殊電線	200	2,290.00	458,000
タツタ電線	2,400	567.00	1,360,800
カナレ電気	200	1,698.00	339,600
平河ヒューテック	600	964.00	578,400
リョービ	1,500	1,160.00	1,740,000
アーレスティ	1,600	360.00	576,000
アサヒホールディングス	2,100	3,145.00	6,604,500
稲葉製作所	700	1,426.00	998,200
宮地エンジニアリンググループ	400	1,643.00	657,200
トーカロ	3,300	1,211.00	3,996,300
アルファC o	400	952.00	380,800
S U M C O	14,300	1,669.00	23,866,700
川田テクノロジーズ	200	4,650.00	930,000
R S T e c h n o l o g i e s	300	3,950.00	1,185,000
信和	700	707.00	494,900
東洋製罐グループホールディングス	7,700	1,216.00	9,363,200
ホッカンホールディングス	700	1,853.00	1,297,100
コロナ	700	1,023.00	716,100
横河ブリッジホールディングス	2,200	2,083.00	4,582,600

駒井ハルテック	200	1,378.00	275,600
高田機工	100	2,417.00	241,700
三和ホールディングス	11,300	923.00	10,429,900
文化シャッター	3,500	719.00	2,516,500
三協立山	1,500	924.00	1,386,000
アルインコ	900	922.00	829,800
東洋シャッター	300	700.00	210,000
LIXILグループ	17,700	1,533.00	27,134,100
日本フィルコン	900	484.00	435,600
ノーリツ	2,500	1,356.00	3,390,000
長府製作所	1,200	2,270.00	2,724,000
リンナイ	2,300	8,980.00	20,654,000
ダイニチ工業	600	674.00	404,400
日東精工	1,700	452.00	768,400
三洋工業	200	1,962.00	392,400
岡部	2,400	826.00	1,982,400
ジーテクト	1,500	970.00	1,455,000
東プレ	2,200	1,148.00	2,525,600
高周波熱錬	2,300	520.00	1,196,000
東京製綱	900	571.00	513,900
サンコール	900	415.00	373,500
モリテック スチール	900	308.00	277,200
パイオラックス	1,800	1,620.00	2,916,000
エイチワン	1,200	558.00	669,600
日本発條	12,900	667.00	8,604,300
中央発條	100	2,722.00	272,200
アドバネクス	200	1,385.00	277,000
立川ブラインド工業	500	1,200.00	600,000
三益半導体工業	900	2,359.00	2,123,100
日本ドライケミカル	300	1,637.00	491,100
日本製鋼所	3,600	1,590.00	5,724,000
三浦工業	5,200	4,195.00	21,814,000
タクマ	4,100	1,506.00	6,174,600
ツガミ	2,500	941.00	2,352,500
オークマ	1,400	4,600.00	6,440,000
芝浦機械	1,400	2,114.00	2,959,600
アマダ	14,900	780.00	11,622,000
アイダエンジニアリング	3,100	720.00	2,232,000
滝澤鉄工所	400	1,035.00	414,000
F U J I	5,200	1,990.00	10,348,000
牧野フライス製作所	1,400	3,505.00	4,907,000
オーエスジー	5,600	1,620.00	9,072,000

ダイジェット工業	100	1,472.00	147,200
旭ダイヤモンド工業	3,200	483.00	1,545,600
D M G 森精機	7,600	1,257.00	9,553,200
ソディック	2,800	867.00	2,427,600
ディスコ	1,600	26,810.00	42,896,000
日東工器	700	2,079.00	1,455,300
日進工具	500	2,717.00	1,358,500
パンチ工業	1,100	429.00	471,900
富士ダイス	500	708.00	354,000
豊和工業	700	824.00	576,800
O K K	500	373.00	186,500
石川製作所	300	1,774.00	532,200
東洋機械金属	900	408.00	367,200
津田駒工業	200	860.00	172,000
エンシュウ	300	936.00	280,800
島精機製作所	1,900	1,410.00	2,679,000
オプトラン	1,300	2,473.00	3,214,900
N C ホールディングス	400	579.00	231,600
イワキポンプ	800	969.00	775,200
フリー	1,200	975.00	1,170,000
ヤマシンフィルタ	2,600	1,033.00	2,685,800
日阪製作所	1,500	789.00	1,183,500
やまびこ	2,300	970.00	2,231,000
平田機工	600	6,230.00	3,738,000
ペガサスミシン製造	1,200	310.00	372,000
マルマエ	400	1,020.00	408,000
タツモ	600	1,652.00	991,200
ナプテスコ	7,100	3,495.00	24,814,500
三井海洋開発	1,300	1,570.00	2,041,000
レオン自動機	1,200	1,324.00	1,588,800
S M C	3,800	58,420.00	221,996,000
ホソカワミクロン	400	6,080.00	2,432,000
ユニオンツール	400	2,743.00	1,097,200
オイレス工業	1,600	1,485.00	2,376,000
日精エー・エス・ビー機械	300	2,939.00	881,700
サトーホールディングス	1,700	2,345.00	3,986,500
技研製作所	1,100	4,290.00	4,719,000
日本エアーテック	400	1,401.00	560,400
カワタ	400	751.00	300,400
日精樹脂工業	1,000	825.00	825,000
オカダアイヨン	400	932.00	372,800
ワイエイシイホールディングス	500	707.00	353,500

小松製作所	55,100	2,344.50	129,181,950
住友重機械工業	7,000	2,350.00	16,450,000
日立建機	4,900	3,290.00	16,121,000
日工	1,700	634.00	1,077,800
巴工業	500	1,887.00	943,500
井関農機	1,200	1,221.00	1,465,200
TOWA	1,200	1,382.00	1,658,400
丸山製作所	200	1,236.00	247,200
北川鉄工所	500	1,625.00	812,500
ローツェ	500	5,900.00	2,950,000
タカキタ	400	648.00	259,200
クボタ	64,500	1,611.00	103,909,500
荏原実業	300	2,907.00	872,100
三菱化工機	400	1,875.00	750,000
月島機械	2,200	1,224.00	2,692,800
帝国電機製作所	1,000	1,226.00	1,226,000
東京機械製作所	500	281.00	140,500
新東工業	2,900	761.00	2,206,900
澁谷工業	1,100	2,940.00	3,234,000
アイチ コーポレーション	2,100	805.00	1,690,500
小森コーポレーション	3,100	733.00	2,272,300
鶴見製作所	900	1,894.00	1,704,600
住友精密工業	200	2,272.00	454,400
日本ギア工業	500	281.00	140,500
酒井重工業	200	2,240.00	448,000
荏原製作所	5,000	2,706.00	13,530,000
石井鐵工所	200	2,515.00	503,000
西島製作所	1,200	896.00	1,075,200
北越工業	1,300	1,195.00	1,553,500
ダイキン工業	15,500	19,365.00	300,157,500
オルガノ	400	5,590.00	2,236,000
トーヨーカネツ	500	2,125.00	1,062,500
栗田工業	6,600	3,020.00	19,932,000
椿本チエイン	1,700	2,666.00	4,532,200
大同工業	600	635.00	381,000
木村化工機	1,000	443.00	443,000
アネスト岩田	1,900	847.00	1,609,300
ダイフク	6,200	9,960.00	61,752,000
サムコ	300	2,935.00	880,500
加藤製作所	700	1,281.00	896,700
油研工業	200	1,562.00	312,400
タダノ	5,900	912.00	5,380,800



フジテック	4,400	1,827.00	8,038,800
C K D	3,300	2,184.00	7,207,200
キトー	900	1,211.00	1,089,900
平和	3,400	1,850.00	6,290,000
理想科学工業	1,100	1,431.00	1,574,100
S A N K Y O	2,700	2,738.00	7,392,600
日本金銭機械	1,300	572.00	743,600
マースグループホールディングス	800	1,687.00	1,349,600
フクシマガリレイ	700	3,345.00	2,341,500
オーイズミ	500	378.00	189,000
ダイコク電機	600	1,289.00	773,400
竹内製作所	2,000	1,918.00	3,836,000
アマノ	3,200	2,191.00	7,011,200
J U K I	1,700	500.00	850,000
サンデンホールディングス	1,600	289.00	462,400
蛇の目マシン工業	1,100	463.00	509,300
マックス	1,900	1,551.00	2,946,900
グローリー	3,100	2,498.00	7,743,800
新晃工業	1,100	1,459.00	1,604,900
大和冷機工業	1,800	975.00	1,755,000
セガサミーホールディングス	12,100	1,302.00	15,754,200
日本ピストンリング	400	1,241.00	496,400
リケン	600	2,809.00	1,685,400
T P R	1,600	1,421.00	2,273,600
ツバキ・ナカシマ	2,500	823.00	2,057,500
ホシザキ	3,600	8,510.00	30,636,000
大豊工業	1,000	565.00	565,000
日本精工	22,900	788.00	18,045,200
N T N	28,100	213.00	5,985,300
ジェイテクト	11,700	818.00	9,570,600
不二越	1,100	3,320.00	3,652,000
日本トムソン	3,600	346.00	1,245,600
T H K	7,100	2,694.00	19,127,400
ユーシン精機	900	710.00	639,000
前澤給装工業	400	2,037.00	814,800
イーグル工業	1,500	705.00	1,057,500
前澤工業	800	398.00	318,400
日本ピラー工業	1,200	1,534.00	1,840,800
キッツ	4,900	710.00	3,479,000
マキタ	15,900	4,120.00	65,508,000
日立造船	9,600	385.00	3,696,000
三菱重工業	20,400	2,668.50	54,437,400

I H I	8,800	1,565.00	13,772,000
スター精密	1,900	1,277.00	2,426,300
日清紡ホールディングス	8,100	760.00	6,156,000
イビデン	7,400	2,980.00	22,052,000
コニカミノルタ	26,600	369.00	9,815,400
ブラザー工業	14,800	1,880.00	27,824,000
ミネベアミツミ	22,600	1,876.00	42,397,600
日立製作所	58,400	3,340.00	195,056,000
三菱電機	121,500	1,427.00	173,380,500
富士電機	7,300	2,914.00	21,272,200
東洋電機製造	400	1,164.00	465,600
安川電機	13,100	3,745.00	49,059,500
シンフォニアテクノロジー	1,600	1,108.00	1,772,800
明電舎	2,200	1,732.00	3,810,400
オリジン	300	1,308.00	392,400
山洋電気	600	5,000.00	3,000,000
デンヨー	1,000	2,075.00	2,075,000
東芝テック	1,500	4,435.00	6,652,500
芝浦メカトロニクス	200	2,805.00	561,000
マブチモーター	3,400	3,405.00	11,577,000
日本電産	29,300	8,395.00	245,973,500
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	700	392.00	274,400
トレックス・セミコンダクター	700	1,199.00	839,300
東光高岳	700	1,029.00	720,300
ダブル・スコープ	1,900	708.00	1,345,200
宮越ホールディングス	500	697.00	348,500
ダイヘン	1,300	4,055.00	5,271,500
ヤーマン	2,000	1,019.00	2,038,000
JVCケンウッド	9,800	157.00	1,538,600
ミマキエンジニアリング	1,100	388.00	426,800
第一精工	500	1,984.00	992,000
日新電機	2,800	1,043.00	2,920,400
大崎電気工業	2,400	521.00	1,250,400
オムロン	10,900	7,490.00	81,641,000
日東工業	1,800	1,821.00	3,277,800
I D E C	1,800	1,735.00	3,123,000
正興電機製作所	300	1,014.00	304,200
不二電機工業	200	1,327.00	265,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,100	1,817.00	7,449,700
サクサホールディングス	300	1,513.00	453,900
メルコホールディングス	400	3,200.00	1,280,000
テクノメディカ	300	1,857.00	557,100

ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	300	589.00	176,700
日本電気	14,700	5,930.00	87,171,000
富士通	11,700	14,010.00	163,917,000
沖電気工業	4,900	1,086.00	5,321,400
岩崎通信機	500	843.00	421,500
電気興業	600	2,488.00	1,492,800
サンケン電気	1,300	2,160.00	2,808,000
ナカヨ	200	1,481.00	296,200
アイホン	700	1,532.00	1,072,400
ルネサスエレクトロニクス	58,200	574.00	33,406,800
セイコーエプソン	15,100	1,245.00	18,799,500
ワコム	8,200	593.00	4,862,600
アルバック	2,200	3,350.00	7,370,000
アクセル	500	865.00	432,500
E I Z O	900	4,160.00	3,744,000
ジャパンディスプレイ	34,900	49.00	1,710,100
日本信号	3,100	1,070.00	3,317,000
京三製作所	2,800	556.00	1,556,800
能美防災	1,600	2,163.00	3,460,800
ホーチキ	900	1,199.00	1,079,100
星和電機	600	611.00	366,600
エレコム	1,400	5,440.00	7,616,000
パナソニック	138,900	1,039.00	144,317,100
シャープ	14,100	1,171.00	16,511,100
アンリツ	7,800	2,459.00	19,180,200
富士通ゼネラル	3,300	2,603.00	8,589,900
ソニー	76,100	8,196.00	623,715,600
T D K	5,900	10,700.00	63,130,000
帝国通信工業	500	1,215.00	607,500
タムラ製作所	4,100	463.00	1,898,300
アルプスアルパイン	10,800	1,422.00	15,357,600
池上通信機	400	879.00	351,600
日本電波工業	1,100	329.00	361,900
鈴木	600	685.00	411,000
日本トリム	200	3,190.00	638,000
ローランド ディー . ジー .	700	1,224.00	856,800
フォスター電機	1,300	1,122.00	1,458,600
S M K	300	2,658.00	797,400
ヨコオ	800	2,687.00	2,149,600
ティアック	600	110.00	66,000
ホシデン	3,300	943.00	3,111,900
ヒロセ電機	1,900	11,670.00	22,173,000

日本航空電子工業	2,800	1,429.00	4,001,200
TOA	1,300	759.00	986,700
マクセルホールディングス	2,600	926.00	2,407,600
古野電気	1,600	1,019.00	1,630,400
ユニデンホールディングス	300	1,759.00	527,700
スミダコーポレーション	900	712.00	640,800
アイコム	700	3,020.00	2,114,000
リオン	500	2,069.00	1,034,500
本多通信工業	1,000	430.00	430,000
船井電機	1,200	540.00	648,000
横河電機	11,200	1,692.00	18,950,400
新電元工業	400	2,142.00	856,800
アズビル	7,700	3,530.00	27,181,000
東亜ディーケーケー	600	862.00	517,200
日本光電工業	5,000	3,700.00	18,500,000
チノー	400	1,409.00	563,600
共和電業	1,300	428.00	556,400
日本電子材料	500	1,266.00	633,000
堀場製作所	2,400	5,730.00	13,752,000
アドバンテスト	9,000	6,650.00	59,850,000
小野測器	500	508.00	254,000
エスペック	1,100	1,888.00	2,076,800
キーエンス	11,000	46,140.00	507,540,000
日置電機	600	3,340.00	2,004,000
シスメックス	8,700	8,177.00	71,139,900
日本マイクロニクス	2,100	1,095.00	2,299,500
メガチップス	1,100	2,124.00	2,336,400
OBARA GROUP	700	3,580.00	2,506,000
澤藤電機	100	1,638.00	163,800
原田工業	600	898.00	538,800
コーセル	1,600	880.00	1,408,000
イリソ電子工業	1,000	3,405.00	3,405,000
オブテックスグループ	2,000	1,228.00	2,456,000
千代田インテグレ	600	1,664.00	998,400
アイ・オー・データ機器	400	1,016.00	406,400
レーザーテック	5,300	9,760.00	51,728,000
スタンレー電気	8,500	2,669.00	22,686,500
岩崎電気	500	1,850.00	925,000
ウシオ電機	6,700	1,329.00	8,904,300
岡谷電機産業	900	302.00	271,800
ヘリオス テクノ ホールディング	1,100	309.00	339,900
エノモト	400	1,073.00	429,200

日本セラミック	1,200	2,158.00	2,589,600
遠藤照明	600	629.00	377,400
古河電池	900	1,155.00	1,039,500
双信電機	600	403.00	241,800
山一電機	900	1,339.00	1,205,100
図研	800	3,100.00	2,480,000
日本電子	2,400	2,919.00	7,005,600
カシオ計算機	10,800	1,834.00	19,807,200
ファナック	11,400	20,745.00	236,493,000
日本シイエムケイ	2,900	434.00	1,258,600
エンプラス	600	2,279.00	1,367,400
大真空	400	2,209.00	883,600
ローム	5,400	7,040.00	38,016,000
浜松ホトニクス	8,700	4,835.00	42,064,500
三井ハイテック	1,300	1,617.00	2,102,100
新光電気工業	4,100	1,708.00	7,002,800
京セラ	17,100	5,917.00	101,180,700
太陽誘電	5,400	3,245.00	17,523,000
村田製作所	35,700	6,712.00	239,618,400
双葉電子工業	1,900	968.00	1,839,200
北陸電気工業	500	897.00	448,500
ニチコン	4,100	718.00	2,943,800
日本ケミコン	900	1,891.00	1,701,900
K O A	1,800	994.00	1,789,200
市光工業	1,800	506.00	910,800
小糸製作所	7,300	4,585.00	33,470,500
ミツバ	2,200	395.00	869,000
S C R E E Nホールディングス	2,100	5,430.00	11,403,000
キャノン電子	1,300	1,540.00	2,002,000
キャノン	65,400	2,098.50	137,241,900
リコー	30,900	798.00	24,658,200
象印マホービン	3,600	1,376.00	4,953,600
M U T O Hホールディングス	200	1,532.00	306,400
東京エレクトロン	7,700	28,870.00	222,299,000
トヨタ紡織	3,500	1,427.00	4,994,500
芦森工業	300	989.00	296,700
ユニプレス	2,400	935.00	2,244,000
豊田自動織機	9,800	5,790.00	56,742,000
モリタホールディングス	2,100	1,908.00	4,006,800
三櫻工業	1,500	675.00	1,012,500
デンソー	26,800	4,150.00	111,220,000
東海理化電機製作所	3,200	1,520.00	4,864,000

三井E & Sホールディングス	4,400	461.00	2,028,400
川崎重工業	9,500	1,621.00	15,399,500
名村造船所	3,800	172.00	653,600
サノヤスホールディングス	1,400	183.00	256,200
日本車輛製造	400	2,625.00	1,050,000
三菱ロジスネクスト	1,600	1,029.00	1,646,400
近畿車輛	200	1,228.00	245,600
日産自動車	143,400	429.40	61,575,960
いすゞ自動車	35,200	936.60	32,968,320
トヨタ自動車	135,600	6,737.00	913,537,200
日野自動車	15,200	719.00	10,928,800
三菱自動車工業	45,000	269.00	12,105,000
エフテック	800	497.00	397,600
レシップホールディングス	500	563.00	281,500
G M B	200	607.00	121,400
ファルテック	200	639.00	127,800
武蔵精密工業	2,700	909.00	2,454,300
日産車体	2,400	938.00	2,251,200
新明和工業	3,300	1,025.00	3,382,500
極東開発工業	2,300	1,499.00	3,447,700
日信工業	1,800	2,200.00	3,960,000
トピー工業	1,000	1,210.00	1,210,000
ティラド	400	1,347.00	538,800
曙ブレーキ工業	6,600	175.00	1,155,000
タチエス	2,000	932.00	1,864,000
N O K	6,500	1,280.00	8,320,000
フタバ産業	3,400	457.00	1,553,800
K Y B	1,400	1,945.00	2,723,000
大同メタル工業	2,300	552.00	1,269,600
プレス工業	6,000	314.00	1,884,000
ミクニ	1,500	271.00	406,500
太平洋工業	2,500	916.00	2,290,000
ケーヒン	2,100	2,544.00	5,342,400
河西工業	1,600	444.00	710,400
アイシン精機	10,000	3,180.00	31,800,000
マツダ	35,800	699.00	25,024,200
今仙電機製作所	1,100	738.00	811,800
本田技研工業	95,700	2,758.00	263,940,600
スズキ	24,100	3,702.00	89,218,200
S U B A R U	37,700	2,246.00	84,674,200
安永	600	1,042.00	625,200
ヤマハ発動機	15,900	1,666.00	26,489,400

ショーワ	2,100	2,250.00	4,725,000
T B K	1,400	455.00	637,000
エクセディ	1,700	1,599.00	2,718,300
豊田合成	3,900	2,138.00	8,338,200
愛三工業	1,900	510.00	969,000
盟和産業	200	897.00	179,400
日本プラスト	1,000	434.00	434,000
ヨロズ	1,100	1,107.00	1,217,700
エフ・シー・シー	2,000	1,890.00	3,780,000
シマノ	4,500	21,720.00	97,740,000
テイ・エス テック	2,800	2,939.00	8,229,200
ジャムコ	600	726.00	435,600
テルモ	34,400	4,012.00	138,012,800
クリエートメディック	400	996.00	398,400
日機装	3,600	973.00	3,502,800
日本エム・ディ・エム	700	1,672.00	1,170,400
島津製作所	14,500	2,810.00	40,745,000
J M S	1,000	813.00	813,000
クボテック	300	369.00	110,700
長野計器	900	986.00	887,400
ブイ・テクノロジー	600	3,675.00	2,205,000
東京計器	800	1,003.00	802,400
愛知時計電機	200	4,460.00	892,000
インターアクション	700	1,681.00	1,176,700
オーバル	1,000	224.00	224,000
東京精密	2,200	3,465.00	7,623,000
マニー	4,800	2,838.00	13,622,400
ニコン	18,600	844.00	15,698,400
トプコン	6,100	806.00	4,916,600
オリンパス	67,300	1,973.00	132,782,900
理研計器	1,100	2,513.00	2,764,300
タムロン	1,000	1,787.00	1,787,000
H O Y A	24,100	10,490.00	252,809,000
シード	500	684.00	342,000
ノーリツ鋼機	800	1,525.00	1,220,000
エー・アンド・デイ	1,100	682.00	750,200
朝日インテック	13,800	2,986.00	41,206,800
シチズン時計	14,200	327.00	4,643,400
リズム時計工業	400	615.00	246,000
大研医器	800	565.00	452,000
メニコン	1,700	5,090.00	8,653,000
シンシア	100	362.00	36,200

松風	500	1,418.00	709,000
セイコーホールディングス	1,700	1,615.00	2,745,500
ニプロ	8,400	1,178.00	9,895,200
中本パックス	300	1,505.00	451,500
スノーピーク	600	1,123.00	673,800
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,530.00	5,889,000
トランザクション	700	1,092.00	764,400
粧美堂	300	353.00	105,900
ニホンフラッシュ	1,100	1,515.00	1,666,500
前田工織	1,300	2,549.00	3,313,700
永大産業	1,600	290.00	464,000
アートネイチャー	1,300	630.00	819,000
バンダイナムコホールディングス	12,600	6,100.00	76,860,000
アイフィスジャパン	300	731.00	219,300
共立印刷	1,900	137.00	260,300
SHOEI	1,100	2,820.00	3,102,000
フランスベッドホールディングス	1,700	846.00	1,438,200
パイロットコーポレーション	2,000	3,260.00	6,520,000
萩原工業	700	1,423.00	996,100
トッパン・フォームズ	2,600	1,079.00	2,805,400
フジシールインターナショナル	2,700	1,977.00	5,337,900
タカラトミー	5,500	866.00	4,763,000
廣濟堂	800	804.00	643,200
エステールホールディングス	300	646.00	193,800
アーク	4,600	112.00	515,200
タカノ	500	714.00	357,000
プロネクサス	1,000	1,196.00	1,196,000
ホクシン	700	118.00	82,600
ウッドワン	400	1,178.00	471,200
大建工業	800	1,896.00	1,516,800
凸版印刷	17,200	1,695.00	29,154,000
大日本印刷	15,900	2,422.00	38,509,800
共同印刷	400	2,734.00	1,093,600
NISSHA	2,500	1,094.00	2,735,000
光村印刷	100	1,524.00	152,400
TAKARA & COMPANY	600	2,328.00	1,396,800
アシックス	10,000	1,266.00	12,660,000
ツツミ	400	1,920.00	768,000
小松ウオール工業	400	1,733.00	693,200
ヤマハ	7,200	4,990.00	35,928,000
河合楽器製作所	400	2,734.00	1,093,600
クリナップ	1,100	577.00	634,700



ピジョン	7,300	4,345.00	31,718,500
オリバー	300	2,520.00	756,000
兼松サステック	100	1,478.00	147,800
キングジム	1,000	866.00	866,000
リンテック	2,900	2,573.00	7,461,700
イトーキ	2,600	338.00	878,800
任天堂	7,500	47,500.00	356,250,000
三菱鉛筆	2,000	1,326.00	2,652,000
タカラスタンダード	2,500	1,542.00	3,855,000
コクヨ	5,800	1,226.00	7,110,800
ナカバヤシ	1,200	602.00	722,400
グローブライド	500	2,094.00	1,047,000
オカムラ	4,200	761.00	3,196,200
美津濃	1,100	2,008.00	2,208,800
東京電力ホールディングス	97,000	323.00	31,331,000
中部電力	37,200	1,344.50	50,015,400
関西電力	46,100	1,063.50	49,027,350
中国電力	17,500	1,345.00	23,537,500
北陸電力	11,100	672.00	7,459,200
東北電力	30,400	1,034.00	31,433,600
四国電力	10,900	779.00	8,491,100
九州電力	25,100	931.00	23,368,100
北海道電力	11,400	414.00	4,719,600
沖縄電力	2,400	1,737.00	4,168,800
電源開発	9,700	1,688.00	16,373,600
エフオン	700	604.00	422,800
イーレックス	1,700	1,545.00	2,626,500
レノバ	2,000	1,061.00	2,122,000
東京瓦斯	23,400	2,695.00	63,063,000
大阪瓦斯	23,600	2,160.00	50,976,000
東邦瓦斯	6,000	5,220.00	31,320,000
北海道瓦斯	700	1,560.00	1,092,000
広島ガス	2,500	362.00	905,000
西部瓦斯	1,400	2,627.00	3,677,800
静岡ガス	3,500	875.00	3,062,500
メタウォーター	600	4,680.00	2,808,000
SBSホールディングス	1,000	2,345.00	2,345,000
東武鉄道	12,700	3,395.00	43,116,500
相鉄ホールディングス	3,900	2,815.00	10,978,500
東急	30,700	1,332.00	40,892,400
京浜急行電鉄	15,600	1,585.00	24,726,000
小田急電鉄	18,100	2,562.00	46,372,200

京王電鉄	6,300	5,940.00	37,422,000
京成電鉄	8,500	2,984.00	25,364,000
富士急行	1,700	3,300.00	5,610,000
新京成電鉄	300	2,243.00	672,900
東日本旅客鉄道	21,400	6,976.00	149,286,400
西日本旅客鉄道	10,800	5,168.00	55,814,400
東海旅客鉄道	10,100	14,455.00	145,995,500
西武ホールディングス	15,900	1,038.00	16,504,200
鴻池運輸	1,900	1,125.00	2,137,500
西日本鉄道	3,400	2,849.00	9,686,600
ハマキョウレックス	900	3,215.00	2,893,500
サカイ引越センター	600	4,935.00	2,961,000
近鉄グループホールディングス	11,500	4,600.00	52,900,000
阪急阪神ホールディングス	15,400	3,390.00	52,206,000
南海電気鉄道	5,500	2,420.00	13,310,000
京阪ホールディングス	5,100	4,665.00	23,791,500
神戸電鉄	300	3,595.00	1,078,500
名古屋鉄道	9,500	2,893.00	27,483,500
山陽電気鉄道	800	2,235.00	1,788,000
日本通運	4,000	5,560.00	22,240,000
ヤマトホールディングス	20,200	2,735.00	55,247,000
山九	3,200	3,895.00	12,464,000
丸運	600	225.00	135,000
丸全昭和運輸	900	3,175.00	2,857,500
センコーグループホールディングス	6,300	812.00	5,115,600
トナミホールディングス	300	6,000.00	1,800,000
ニッコンホールディングス	4,100	2,065.00	8,466,500
日本石油輸送	100	3,070.00	307,000
福山通運	1,500	3,810.00	5,715,000
セイノーホールディングス	8,600	1,364.00	11,730,400
エスライン	300	946.00	283,800
神奈川中央交通	300	3,910.00	1,173,000
日立物流	2,100	3,015.00	6,331,500
丸和運輸機関	1,200	3,290.00	3,948,000
C & F ロジホールディングス	1,200	1,679.00	2,014,800
九州旅客鉄道	10,100	2,358.00	23,815,800
S Gホールディングス	12,100	3,705.00	44,830,500
日本郵船	9,600	1,408.00	13,516,800
商船三井	7,300	1,871.00	13,658,300
川崎汽船	3,500	1,031.00	3,608,500
N S ユナイテッド海運	600	1,552.00	931,200
明治海運	1,200	322.00	386,400

飯野海運	5,400	326.00	1,760,400
共栄タンカー	200	795.00	159,000
乾汽船	700	807.00	564,900
日本航空	20,400	1,894.50	38,647,800
A N Aホールディングス	21,000	2,373.00	49,833,000
パスコ	200	1,421.00	284,200
トランコム	300	7,270.00	2,181,000
日新	1,000	1,539.00	1,539,000
三菱倉庫	3,700	2,735.00	10,119,500
三井倉庫ホールディングス	1,300	1,550.00	2,015,000
住友倉庫	4,100	1,268.00	5,198,800
澁澤倉庫	600	1,961.00	1,176,600
東陽倉庫	2,100	331.00	695,100
日本トランスシティ	2,500	499.00	1,247,500
ケイヒン	200	1,269.00	253,800
中央倉庫	700	1,000.00	700,000
川西倉庫	200	1,032.00	206,400
安田倉庫	900	921.00	828,900
ファイズホールディングス	200	1,071.00	214,200
東洋埠頭	400	1,437.00	574,800
宇徳	1,000	482.00	482,000
上組	6,400	2,038.00	13,043,200
サンリツ	300	578.00	173,400
キムラユニティー	300	1,033.00	309,900
キューソー流通システム	300	1,506.00	451,800
近鉄エクスプレス	2,400	1,907.00	4,576,800
東海運	600	275.00	165,000
エーアイティー	800	946.00	756,800
内外トランスライン	400	1,052.00	420,800
日本コンセプト	400	1,254.00	501,600
N E C ネットズエスアイ	3,400	2,212.00	7,520,800
クロスキャット	300	1,128.00	338,400
システナ	4,300	1,440.00	6,192,000
デジタルアーツ	600	9,360.00	5,616,000
日鉄ソリューションズ	1,800	3,065.00	5,517,000
キューブシステム	600	1,066.00	639,600
エイジア	200	1,418.00	283,600
コア	500	1,257.00	628,500
ラクーンホールディングス	500	1,099.00	549,500
ソリトンシステムズ	500	1,545.00	772,500
ソフトクリエイトホールディングス	500	2,379.00	1,189,500
T I S	11,900	2,273.00	27,048,700

ネオス	500	626.00	313,000
電算システム	500	4,795.00	2,397,500
グリー	7,300	453.00	3,306,900
コーエーテクモホールディングス	2,400	3,420.00	8,208,000
三菱総合研究所	500	4,300.00	2,150,000
ボルテージ	300	489.00	146,700
電算	100	2,238.00	223,800
A G S	700	860.00	602,000
ファインデックス	1,000	975.00	975,000
ブレインパッド	300	4,190.00	1,257,000
K L a b	2,300	714.00	1,642,200
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	1,400	861.00	1,205,400
イーブックイニシアティブジャパン	200	3,315.00	663,000
ネクソン	33,300	2,482.00	82,650,600
アイスタイル	3,300	274.00	904,200
エムアップホールディングス	300	2,332.00	699,600
エイチーム	800	889.00	711,200
エニグモ	1,100	1,322.00	1,454,200
テクノスジャパン	900	813.00	731,700
e n i s h	700	827.00	578,900
コロブラ	3,900	968.00	3,775,200
オルトプラス	700	431.00	301,700
ブロードリーフ	5,900	563.00	3,321,700
クロス・マーケティンググループ	500	331.00	165,500
デジタルハーツホールディングス	600	869.00	521,400
システム情報	900	1,462.00	1,315,800
メディアドゥ	400	5,400.00	2,160,000
じげん	2,900	303.00	878,700
ブイキューブ	700	1,236.00	865,200
エンカレッジ・テクノロジー	300	787.00	236,100
サイバーリンクス	200	2,253.00	450,600
ディー・エル・イー	1,000	415.00	415,000
フィックスターズ	1,300	1,181.00	1,535,300
C A R T A H O L D I N G S	600	1,336.00	801,600
オブティム	600	3,395.00	2,037,000
セレス	400	1,200.00	480,000
S H I F T	500	11,770.00	5,885,000
ティーガイア	1,100	1,936.00	2,129,600
セック	200	3,025.00	605,000
日本アジアグループ	1,200	291.00	349,200
テクマトリックス	1,700	1,781.00	3,027,700
プロシップ	300	1,499.00	449,700

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	2,900	1,953.00	5,663,700
GMOペイメントゲートウェイ	2,500	11,190.00	27,975,000
ザッパラス	500	402.00	201,000
システムリサーチ	300	2,086.00	625,800
インターネットイニシアティブ	1,800	3,690.00	6,642,000
さくらインターネット	1,300	625.00	812,500
ヴィンクス	300	1,258.00	377,400
GMOクラウド	200	7,740.00	1,548,000
SRAホールディングス	600	2,349.00	1,409,400
システムインテグレータ	400	816.00	326,400
朝日ネット	800	1,162.00	929,600
eBASE	1,400	1,536.00	2,150,400
アバント	1,100	1,054.00	1,159,400
アドソル日進	400	2,346.00	938,400
フリービット	600	803.00	481,800
コムチュア	1,300	2,715.00	3,529,500
サイバーコム	200	1,836.00	367,200
アステリア	700	486.00	340,200
アイル	700	1,577.00	1,103,900
マークライنز	600	2,138.00	1,282,800
メディカル・データ・ビジョン	900	1,417.00	1,275,300
gumi	1,500	932.00	1,398,000
ショーケース	300	696.00	208,800
モバイルファクトリー	300	1,055.00	316,500
テラスカイ	400	4,860.00	1,944,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	500	1,379.00	689,500
PCIホールディングス	500	1,166.00	583,000
パイプドHD	200	1,415.00	283,000
アイビーシー	200	939.00	187,800
ネオジャパン	200	2,258.00	451,600
PR TIMES	100	3,985.00	398,500
ランドコンピュータ	200	990.00	198,000
ダブルスタンダード	200	5,590.00	1,118,000
オープンドア	600	1,055.00	633,000
マイネット	400	1,378.00	551,200
アカツキ	400	3,875.00	1,550,000
ベネフィットジャパン	100	1,625.00	162,500
Ubicomホールディングス	300	2,259.00	677,700
LINE	2,000	5,550.00	11,100,000
カナミックネットワーク	1,100	917.00	1,008,700
ノムラシステムコーポレーション	500	462.00	231,000
チェンジ	400	8,470.00	3,388,000

シンクロ・フード	500	339.00	169,500
オークネット	700	1,088.00	761,600
セグエグループ	300	913.00	273,900
エイトレッド	200	2,000.00	400,000
AOI TYO Holdings	1,200	411.00	493,200
マクロミル	2,400	754.00	1,809,600
ビーグリー	200	2,145.00	429,000
オロ	300	3,030.00	909,000
ユーザーローカル	100	3,835.00	383,500
テモナ	300	968.00	290,400
ニーズウェル	200	709.00	141,800
サインポスト	200	1,385.00	277,000
ソルクシーズ	500	755.00	377,500
フェイス	400	698.00	279,200
プロトコーポレーション	1,100	930.00	1,023,000
ハイマックス	100	2,010.00	201,000
野村総合研究所	16,900	2,804.00	47,387,600
サイバネットシステム	800	666.00	532,800
CEホールディングス	600	585.00	351,000
日本システム技術	200	1,770.00	354,000
インテージホールディングス	1,500	900.00	1,350,000
東邦システムサイエンス	300	964.00	289,200
ソースネクスト	5,600	273.00	1,528,800
インフォコム	1,300	3,295.00	4,283,500
HEROZ	200	3,195.00	639,000
ラクスル	1,000	3,175.00	3,175,000
FIG	1,300	250.00	325,000
システムサポート	300	1,934.00	580,200
イーソル	600	1,106.00	663,600
アルテリア・ネットワークス	1,300	2,000.00	2,600,000
東海ソフト	100	1,221.00	122,100
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	200	1,050.00	210,000
トピラシステムズ	100	1,898.00	189,800
フォーカスシステムズ	700	806.00	564,200
クレスコ	700	1,382.00	967,400
フジ・メディア・ホールディングス	11,500	1,024.00	11,776,000
オービック	4,100	19,060.00	78,146,000
ジャストシステム	1,900	8,120.00	15,428,000
TDCソフト	1,000	916.00	916,000
Zホールディングス	163,800	532.00	87,141,600
トレンドマイクロ	5,300	6,200.00	32,860,000
IDホールディングス	500	1,562.00	781,000

日本オラクル	2,400	12,690.00	30,456,000
アルファシステムズ	400	4,180.00	1,672,000
フューチャー	1,400	1,791.00	2,507,400
C A C H o l d i n g s	800	1,235.00	988,000
S B テクノロジー	400	3,980.00	1,592,000
トーセ	300	859.00	257,700
オービックビジネスコンサルタント	1,200	6,130.00	7,356,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,400	4,220.00	22,788,000
アイティフォー	1,400	745.00	1,043,000
東計電算	200	4,000.00	800,000
エクスネット	200	975.00	195,000
大塚商会	6,500	5,540.00	36,010,000
サイボウズ	1,400	3,300.00	4,620,000
ソフトブレーン	700	431.00	301,700
電通国際情報サービス	700	5,630.00	3,941,000
A C C E S S	1,100	847.00	931,700
デジタルガレージ	2,100	3,750.00	7,875,000
E M システムズ	1,700	921.00	1,565,700
ウェザーニューズ	400	4,010.00	1,604,000
C I J	800	800.00	640,000
ビジネスエンジニアリング	100	2,695.00	269,500
日本エンタープライズ	1,200	361.00	433,200
WOWOW	600	2,478.00	1,486,800
スカラ	800	637.00	509,600
インテリジェント ウェイブ	700	807.00	564,900
I M A G I C A G R O U P	1,000	380.00	380,000
ネットワンシステムズ	4,500	4,105.00	18,472,500
システムソフト	2,500	99.00	247,500
アルゴグラフィックス	1,000	3,385.00	3,385,000
マーベラス	1,800	680.00	1,224,000
エイベックス	2,000	906.00	1,812,000
日本ユニシス	3,700	3,355.00	12,413,500
兼松エレクトロニクス	600	4,315.00	2,589,000
東京放送ホールディングス	7,300	1,648.00	12,030,400
日本テレビホールディングス	10,000	1,208.00	12,080,000
朝日放送グループホールディングス	1,200	745.00	894,000
テレビ朝日ホールディングス	3,300	1,559.00	5,144,700
スカパー J S A T ホールディングス	7,800	420.00	3,276,000
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,318.00	2,318,000
日本BS放送	400	1,098.00	439,200
ビジョン	1,100	666.00	732,600
スマートバリュー	300	1,141.00	342,300

USEN - NEXT HOLDINGS	500	1,313.00	656,500
ワイヤレスゲート	600	851.00	510,600
コネクシオ	700	1,403.00	982,100
日本通信	9,300	212.00	1,971,600
ク Robbins	200	731.00	146,200
日本電信電話	159,400	2,552.50	406,868,500
KDDI	87,000	3,364.00	292,668,000
ソフトバンク	108,400	1,429.00	154,903,600
光通信	1,200	23,260.00	27,912,000
NTTドコモ	85,300	3,000.00	255,900,000
エムティーアイ	1,200	809.00	970,800
GMOインターネット	4,700	3,065.00	14,405,500
ファイバーゲート	400	1,991.00	796,400
アйдママーケティングコミュニケーション	400	436.00	174,400
KADOKAWA	3,200	2,280.00	7,296,000
学研ホールディングス	1,600	1,432.00	2,291,200
ゼンリン	2,400	1,178.00	2,827,200
昭文社ホールディングス	500	447.00	223,500
インプレスホールディングス	900	149.00	134,100
アイネット	600	1,657.00	994,200
松竹	800	12,890.00	10,312,000
東宝	7,000	3,345.00	23,415,000
東映	400	14,640.00	5,856,000
エヌ・ティ・ティ・データ	31,800	1,246.00	39,622,800
ピー・シー・エー	200	3,910.00	782,000
ビジネスブレイン太田昭和	400	1,266.00	506,400
DTS	2,700	2,412.00	6,512,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,100	5,820.00	29,682,000
シーイーシー	1,300	1,596.00	2,074,800
カブコン	5,600	4,005.00	22,428,000
アイ・エス・ビー	200	2,417.00	483,400
ジャステック	800	1,202.00	961,600
SCSK	2,800	5,370.00	15,036,000
日本システムウエア	400	2,190.00	876,000
アイネス	1,200	1,533.00	1,839,600
TKC	1,000	5,950.00	5,950,000
富士ソフト	1,500	4,640.00	6,960,000
NSD	3,800	2,048.00	7,782,400
コナミホールディングス	4,300	3,440.00	14,792,000
福井コンピュータホールディングス	500	2,602.00	1,301,000
JBCホールディングス	800	1,510.00	1,208,000
ミロク情報サービス	1,100	2,204.00	2,424,400



ソフトバンクグループ	94,600	6,499.00	614,805,400
ハウスイ	100	885.00	88,500
高千穂交易	500	923.00	461,500
カワニシホールディングス	100	1,315.00	131,500
伊藤忠食品	300	4,785.00	1,435,500
エレマテック	1,100	919.00	1,010,900
JALUX	300	1,731.00	519,300
あらた	1,000	4,855.00	4,855,000
トーメンデバイス	200	4,020.00	804,000
東京エレクトロン デバイス	400	3,810.00	1,524,000
フィールズ	900	350.00	315,000
双日	66,100	237.00	15,665,700
アルフレッサ ホールディングス	13,300	2,250.00	29,925,000
横浜冷凍	3,100	899.00	2,786,900
神栄	200	495.00	99,000
ラサ商事	600	949.00	569,400
アルコニックス	1,300	1,312.00	1,705,600
神戸物産	4,100	6,660.00	27,306,000
ハイパー	200	563.00	112,600
あい ホールディングス	1,700	1,524.00	2,590,800
ディーブイエックス	400	911.00	364,400
ダイワボウホールディングス	1,000	7,990.00	7,990,000
マクニカ・富士エレホールディングス	2,900	1,661.00	4,816,900
ラクト・ジャパン	400	3,705.00	1,482,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2,300	1,061.00	2,440,300
八洲電機	900	958.00	862,200
メディアスホールディングス	700	893.00	625,100
レスターホールディングス	1,200	2,009.00	2,410,800
ジューテックホールディングス	300	1,025.00	307,500
大光	500	676.00	338,000
OCHIホールディングス	300	1,532.00	459,600
TOKAIホールディングス	6,300	997.00	6,281,100
黒谷	300	518.00	155,400
Cominix	200	683.00	136,600
三洋貿易	1,200	979.00	1,174,800
ビューティガレージ	200	1,911.00	382,200
ウイン・パートナーズ	900	960.00	864,000
ミタチ産業	400	566.00	226,400
シップヘルスケアホールディングス	1,900	4,570.00	8,683,000
明治電機工業	400	1,392.00	556,800
デリカフーズホールディングス	400	628.00	251,200
スターティアホールディングス	300	620.00	186,000

コメダホールディングス	2,600	1,813.00	4,713,800
ピーバンドットコム	100	938.00	93,800
アセンテック	100	3,800.00	380,000
富士興産	400	446.00	178,400
協栄産業	100	1,228.00	122,800
小野建	1,100	1,229.00	1,351,900
南陽	300	1,566.00	469,800
佐島電機	800	835.00	668,000
エコートレーディング	300	530.00	159,000
伯東	700	957.00	669,900
コンドーテック	900	1,150.00	1,035,000
中山福	700	455.00	318,500
ナガイレーベン	1,600	2,783.00	4,452,800
三菱食品	1,300	2,661.00	3,459,300
松田産業	900	1,582.00	1,423,800
第一興商	1,800	3,140.00	5,652,000
メディパルホールディングス	12,900	2,014.00	25,980,600
S P K	500	1,335.00	667,500
萩原電気ホールディングス	400	2,038.00	815,200
アズワン	800	11,350.00	9,080,000
スズデン	400	1,217.00	486,800
尾家産業	300	1,500.00	450,000
シモジマ	700	1,236.00	865,200
ドウシシャ	1,100	1,698.00	1,867,800
小津産業	300	1,759.00	527,700
高速	700	1,435.00	1,004,500
たけびし	400	1,513.00	605,200
リックス	300	1,663.00	498,900
丸文	1,100	509.00	559,900
ハビネット	1,000	1,175.00	1,175,000
橋本総業ホールディングス	200	1,970.00	394,000
日本ライフライン	3,500	1,365.00	4,777,500
タカショー	800	499.00	399,200
マルカ	400	1,817.00	726,800
I D O M	3,200	505.00	1,616,000
進和	700	1,951.00	1,365,700
エスケイジャパン	200	297.00	59,400
ダイトロン	500	1,502.00	751,000
シークス	1,500	949.00	1,423,500
田中商事	400	708.00	283,200
オーハシテクニカ	600	1,660.00	996,000
白銅	400	1,450.00	580,000

ダイコー通産	100	1,212.00	121,200
伊藤忠商事	83,700	2,371.00	198,452,700
丸紅	124,600	515.10	64,181,460
高島	200	1,839.00	367,800
長瀬産業	6,700	1,326.00	8,884,200
蝶理	800	1,747.00	1,397,600
豊田通商	13,400	2,830.00	37,922,000
三共生興	1,800	435.00	783,000
兼松	4,500	1,292.00	5,814,000
ツカモトコーポレーション	200	1,164.00	232,800
三井物産	103,700	1,645.50	170,638,350
日本紙パルプ商事	700	3,840.00	2,688,000
カメイ	1,600	1,050.00	1,680,000
東都水産	200	3,230.00	646,000
OUGホールディングス	200	2,666.00	533,200
スターゼン	400	4,180.00	1,672,000
山善	4,700	1,018.00	4,784,600
椿本興業	200	3,360.00	672,000
住友商事	75,500	1,252.50	94,563,750
内田洋行	500	6,800.00	3,400,000
三菱商事	78,500	2,253.00	176,860,500
第一実業	600	3,680.00	2,208,000
キャノンマーケティングジャパン	3,000	2,192.00	6,576,000
西華産業	700	1,259.00	881,300
佐藤商事	1,000	938.00	938,000
菱洋エレクトロ	1,200	3,190.00	3,828,000
東京産業	1,100	522.00	574,200
ユアサ商事	1,100	2,956.00	3,251,600
神鋼商事	300	1,929.00	578,700
トルク	700	301.00	210,700
阪和興業	2,200	2,157.00	4,745,400
正栄食品工業	800	3,880.00	3,104,000
カナデン	1,000	1,360.00	1,360,000
菱電商事	900	1,486.00	1,337,400
フルサト工業	700	1,430.00	1,001,000
岩谷産業	2,700	3,805.00	10,273,500
ナイス	500	1,017.00	508,500
昭光通商	400	609.00	243,600
ニチモウ	200	1,903.00	380,600
極東貿易	300	1,358.00	407,400
イワキ	1,600	491.00	785,600
三愛石油	2,900	907.00	2,630,300

稲畑産業	2,600	1,255.00	3,263,000
G S Iクレオス	300	1,188.00	356,400
明和産業	1,100	461.00	507,100
クワザワ	400	532.00	212,800
ヤマエ久野	900	1,244.00	1,119,600
ワキタ	2,600	976.00	2,537,600
東邦ホールディングス	3,800	1,892.00	7,189,600
サンゲツ	3,300	1,543.00	5,091,900
ミツウロコグループホールディングス	1,800	1,164.00	2,095,200
シナネンホールディングス	500	2,941.00	1,470,500
伊藤忠エネクス	2,600	843.00	2,191,800
サンリオ	3,400	1,655.00	5,627,000
サンワテクノス	800	855.00	684,000
リョーサン	1,300	2,148.00	2,792,400
新光商事	1,900	875.00	1,662,500
トーヨー	500	1,901.00	950,500
三信電気	600	1,839.00	1,103,400
東陽テクニカ	1,300	995.00	1,293,500
モスフードサービス	1,600	2,886.00	4,617,600
加賀電子	1,200	2,111.00	2,533,200
ソーダニッカ	1,200	533.00	639,600
立花エレテック	900	1,765.00	1,588,500
フォーバル	500	1,010.00	505,000
P A L T A C	1,900	5,240.00	9,956,000
三谷産業	1,600	339.00	542,400
太平洋興発	500	613.00	306,500
西本W i s m e t t a cホールディングス	200	2,119.00	423,800
ヤマシタヘルスケアホールディングス	100	1,513.00	151,300
国際紙パルプ商事	2,800	279.00	781,200
ヤマタネ	600	1,312.00	787,200
丸紅建材リース	100	1,582.00	158,200
日鉄物産	900	3,445.00	3,100,500
泉州電業	400	2,937.00	1,174,800
トラスコ中山	2,500	2,600.00	6,500,000
オートバックスセブン	4,400	1,339.00	5,891,600
モリト	900	609.00	548,100
加藤産業	1,700	3,420.00	5,814,000
北恵	300	960.00	288,000
イノテック	600	1,024.00	614,400
イエローハット	2,300	1,507.00	3,466,100
J Kホールディングス	1,100	803.00	883,300
日伝	1,100	2,414.00	2,655,400

北沢産業	900	287.00	258,300
杉本商事	600	1,920.00	1,152,000
因幡電機産業	3,400	2,480.00	8,432,000
東テク	400	2,288.00	915,200
ミスミグループ本社	15,000	2,744.00	41,160,000
アルテック	900	255.00	229,500
タキヒヨー	400	1,911.00	764,400
蔵王産業	200	1,470.00	294,000
スズケン	5,100	3,880.00	19,788,000
ジェコス	800	973.00	778,400
グローセル	1,200	435.00	522,000
ローソン	3,000	5,580.00	16,740,000
サンエー	1,000	4,165.00	4,165,000
カワチ薬品	900	3,190.00	2,871,000
エービーシー・マート	1,900	6,100.00	11,590,000
ハードオフコーポレーション	500	710.00	355,000
アスクル	1,300	3,100.00	4,030,000
ゲオホールディングス	2,200	1,501.00	3,302,200
アダストリア	1,700	1,500.00	2,550,000
ジーフット	700	525.00	367,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	200	473.00	94,600
くら寿司	600	4,810.00	2,886,000
キャンドゥ	600	2,439.00	1,463,400
パルグループホールディングス	1,200	1,213.00	1,455,600
エディオン	5,500	1,078.00	5,929,000
サーラコーポレーション	2,400	584.00	1,401,600
ワッツ	500	1,000.00	500,000
ハローズ	400	3,655.00	1,462,000
フジオフードグループ本社	1,000	1,326.00	1,326,000
あみやき亭	300	2,783.00	834,900
ひらまつ	2,200	177.00	389,400
大黒天物産	300	6,020.00	1,806,000
ハニーズホールディングス	1,100	1,137.00	1,250,700
ファーマライズホールディングス	300	716.00	214,800
アルペン	900	1,633.00	1,469,700
ハブ	300	616.00	184,800
クオールホールディングス	1,800	1,135.00	2,043,000
ジーンズホールディングス	600	7,590.00	4,554,000
ビックカメラ	7,100	1,141.00	8,101,100
DCMホールディングス	6,600	1,321.00	8,718,600
ペッパーフードサービス	1,000	488.00	488,000
Monotaro	8,500	4,390.00	37,315,000

東京一番フーズ	300	515.00	154,500
D Dホールディングス	500	704.00	352,000
きちりホールディングス	300	566.00	169,800
アークランドサービスホールディングス	900	1,975.00	1,777,500
J . フロント リテイリング	14,300	697.00	9,967,100
ドトール・日レスホールディングス	1,700	1,552.00	2,638,400
マツモトキヨシホールディングス	4,900	3,785.00	18,546,500
ブロンコビリー	600	2,119.00	1,271,400
Z O Z O	8,200	2,498.00	20,483,600
トレジャー・ファクトリー	400	679.00	271,600
物語コーポレーション	300	8,720.00	2,616,000
ココカラファイン	1,200	6,180.00	7,416,000
三越伊勢丹ホールディングス	20,900	588.00	12,289,200
H a m e e	400	1,792.00	716,800
ウエルシアホールディングス	3,600	9,630.00	34,668,000
クリエイトSDホールディングス	2,000	3,735.00	7,470,000
丸善CHIホールディングス	1,400	394.00	551,600
ミサワ	200	670.00	134,000
ティーライフ	200	1,060.00	212,000
エー・ピーカンパニー	200	429.00	85,800
チムニー	400	1,346.00	538,400
シュッピン	800	686.00	548,800
オイシックス・ラ・大地	1,200	2,200.00	2,640,000
ネクステージ	1,700	1,074.00	1,825,800
ジョイフル本田	3,500	1,502.00	5,257,000
鳥貴族	400	1,466.00	586,400
麒麟堂ホールディングス	500	2,853.00	1,426,500
ホットランド	800	1,111.00	888,800
すかいらーくホールディングス	13,400	1,620.00	21,708,000
S F Pホールディングス	700	1,372.00	960,400
綿半ホールディングス	400	2,050.00	820,000
ヨシックス	200	1,854.00	370,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,500	1,276.00	4,466,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	600	501.00	300,600
B E E N O S	600	1,196.00	717,600
あさひ	900	1,649.00	1,484,100
日本調剤	700	1,664.00	1,164,800
コスモス薬品	1,100	19,270.00	21,197,000
トーエル	600	699.00	419,400
オンリー	200	559.00	111,800
セブン&アイ・ホールディングス	46,800	3,463.00	162,068,400

クリエイト・レストランツ・ホールディングス	6,400	560.00	3,584,000
ツルハホールディングス	2,600	14,980.00	38,948,000
サンマルクホールディングス	900	1,615.00	1,453,500
フェリシモ	300	1,076.00	322,800
トリドールホールディングス	3,000	1,227.00	3,681,000
T O K Y O B A S E	1,100	296.00	325,600
ウイルプラスホールディングス	100	571.00	57,100
J Mホールディングス	900	3,525.00	3,172,500
サツドラホールディングス	200	1,974.00	394,800
アレンザホールディングス	600	1,346.00	807,600
串カツ田中ホールディングス	200	1,720.00	344,000
パロックジャパンリミテッド	800	623.00	498,400
クスリのアオキホールディングス	1,100	9,900.00	10,890,000
力の源ホールディングス	500	666.00	333,000
スシローグローバルホールディングス	6,600	2,450.00	16,170,000
L I X I L ビバ	900	2,593.00	2,333,700
メディカルシステムネットワーク	1,200	506.00	607,200
はるやまホールディングス	600	766.00	459,600
ノジマ	2,100	2,671.00	5,609,100
カッパ・クリエイト	1,700	1,393.00	2,368,100
ライトオン	900	597.00	537,300
ジーンズメイト	300	210.00	63,000
良品計画	15,900	1,371.00	21,798,900
三城ホールディングス	1,200	270.00	324,000
アドヴァン	1,800	1,370.00	2,466,000
アルビス	500	2,639.00	1,319,500
コナカ	1,400	299.00	418,600
ハウス オブ ローゼ	100	1,599.00	159,900
G - 7ホールディングス	700	2,487.00	1,740,900
イオン北海道	1,600	779.00	1,246,400
コジマ	2,100	559.00	1,173,900
ヒマラヤ	400	805.00	322,000
コーナン商事	1,700	3,770.00	6,409,000
エコス	400	2,325.00	930,000
ワタミ	1,400	914.00	1,279,600
マルシェ	300	505.00	151,500
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	26,300	2,382.00	62,646,600
西松屋チェーン	2,600	1,110.00	2,886,000
ゼンショーホールディングス	5,700	2,108.00	12,015,600
幸楽苑ホールディングス	800	1,609.00	1,287,200
ハークスレイ	200	997.00	199,400

サイゼリヤ	1,800	1,818.00	3,272,400
V Tホールディングス	4,900	339.00	1,661,100
魚力	300	1,576.00	472,800
ポブラ	300	409.00	122,700
フジ・コーポレーション	300	2,001.00	600,300
ユナイテッドアローズ	1,300	1,605.00	2,086,500
ハイデイ日高	1,700	1,642.00	2,791,400
京都きもの友禅	700	243.00	170,100
コロワイド	4,000	1,399.00	5,596,000
ピーシーデポコーポレーション	1,600	656.00	1,049,600
壱番屋	800	5,150.00	4,120,000
トップカルチャー	400	346.00	138,400
P L A N T	300	781.00	234,300
スギホールディングス	2,400	7,730.00	18,552,000
薬王堂ホールディングス	500	2,797.00	1,398,500
ヴィア・ホールディングス	1,500	343.00	514,500
スクロール	1,800	583.00	1,049,400
ヨンドシーホールディングス	1,200	1,914.00	2,296,800
ファミリーマート	8,600	2,360.00	20,296,000
木曽路	1,600	2,375.00	3,800,000
S R Sホールディングス	1,400	903.00	1,264,200
千趣会	2,200	347.00	763,400
タカキュー	800	125.00	100,000
リテールパートナーズ	1,600	2,190.00	3,504,000
ケーヨー	2,500	870.00	2,175,000
上新電機	1,400	2,240.00	3,136,000
日本瓦斯	1,900	5,070.00	9,633,000
ロイヤルホールディングス	2,100	1,742.00	3,658,200
東天紅	100	956.00	95,600
いなげや	1,500	1,887.00	2,830,500
島忠	2,300	2,946.00	6,775,800
チヨダ	1,300	1,074.00	1,396,200
ライフコーポレーション	900	4,845.00	4,360,500
リンガーハット	1,500	2,302.00	3,453,000
M r M a x H D	1,600	835.00	1,336,000
テンアライド	1,100	369.00	405,900
A O K Iホールディングス	2,400	615.00	1,476,000
オークワ	1,900	1,562.00	2,967,800
コメリ	1,800	2,900.00	5,220,000
青山商事	2,500	646.00	1,615,000
しまむら	1,400	7,720.00	10,808,000
はせがわ	600	284.00	170,400



高島屋	8,700	802.00	6,977,400
松屋	2,400	673.00	1,615,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	5,700	712.00	4,058,400
近鉄百貨店	500	2,785.00	1,392,500
丸井グループ	11,000	1,715.00	18,865,000
アクシアル リテイリング	1,000	4,680.00	4,680,000
井筒屋	600	179.00	107,400
イオン	46,100	2,552.00	117,647,200
イズミ	2,400	4,185.00	10,044,000
平和堂	2,400	2,017.00	4,840,800
フジ	1,400	1,900.00	2,660,000
ヤオコー	1,400	8,340.00	11,676,000
ゼビオホールディングス	1,400	768.00	1,075,200
ケーズホールディングス	11,600	1,413.00	16,390,800
Olympicグループ	600	953.00	571,800
日産東京販売ホールディングス	1,700	254.00	431,800
シルバーライフ	200	1,999.00	399,800
一家ダイニングプロジェクト	100	589.00	58,900
Genky DrugStores	500	3,940.00	1,970,000
ナルミヤ・インターナショナル	300	565.00	169,500
ブックオフグループホールディングス	700	799.00	559,300
アインホールディングス	1,500	6,910.00	10,365,000
元気寿司	300	2,270.00	681,000
ヤマダ電機	36,500	485.00	17,702,500
アークランドサカモト	1,900	1,920.00	3,648,000
ニトリホールディングス	5,200	22,590.00	117,468,000
グルメ杵屋	900	972.00	874,800
愛眼	900	224.00	201,600
ケーユーホールディングス	600	892.00	535,200
吉野家ホールディングス	3,900	2,089.00	8,147,100
松屋フーズホールディングス	600	3,630.00	2,178,000
サガミホールディングス	1,600	1,226.00	1,961,600
関西スーパーマーケット	1,000	1,300.00	1,300,000
王将フードサービス	900	5,810.00	5,229,000
プレナス	1,300	1,730.00	2,249,000
ミニストップ	900	1,550.00	1,395,000
アークス	2,400	2,531.00	6,074,400
バローホールディングス	2,600	2,299.00	5,977,400
藤久	100	1,349.00	134,900
ベルク	600	7,710.00	4,626,000
大庄	600	1,160.00	696,000
ファーストリテイリング	1,600	58,650.00	93,840,000

サンドラッグ	4,500	3,640.00	16,380,000
サクスパー ホールディングス	1,000	555.00	555,000
ヤマザワ	300	1,730.00	519,000
やまや	200	2,030.00	406,000
ペルーナ	2,600	768.00	1,996,800
島根銀行	300	536.00	160,800
じもとホールディングス	7,900	96.00	758,400
めぶきフィナンシャルグループ	62,300	255.00	15,886,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,600	1,166.00	1,865,600
九州フィナンシャルグループ	26,200	454.00	11,894,800
ゆうちょ銀行	34,000	829.00	28,186,000
富山第一銀行	2,800	265.00	742,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	68,500	343.00	23,495,500
西日本フィナンシャルホールディングス	8,000	727.00	5,816,000
関西みらいフィナンシャルグループ	6,600	428.00	2,824,800
三十三フィナンシャルグループ	1,100	1,357.00	1,492,700
第四北越フィナンシャルグループ	2,100	2,137.00	4,487,700
新生銀行	8,800	1,303.00	11,466,400
あおぞら銀行	7,100	1,914.00	13,589,400
三菱UFJフィナンシャル・グループ	820,100	415.80	340,997,580
りそなホールディングス	130,800	376.30	49,220,040
三井住友トラスト・ホールディングス	22,700	2,939.00	66,715,300
三井住友フィナンシャルグループ	82,900	3,027.00	250,938,300
千葉銀行	40,000	513.00	20,520,000
群馬銀行	23,000	350.00	8,050,000
武蔵野銀行	1,800	1,539.00	2,770,200
千葉興業銀行	3,300	241.00	795,300
筑波銀行	4,900	172.00	842,800
七十七銀行	4,000	1,530.00	6,120,000
青森銀行	900	2,288.00	2,059,200
秋田銀行	800	1,508.00	1,206,400
山形銀行	1,300	1,372.00	1,783,600
岩手銀行	800	2,627.00	2,101,600
東邦銀行	10,700	237.00	2,535,900
東北銀行	600	970.00	582,000
みちのく銀行	800	1,015.00	812,000
ふくおかフィナンシャルグループ	10,100	1,655.00	16,715,500
静岡銀行	29,200	699.00	20,410,800
十六銀行	1,500	1,894.00	2,841,000
スルガ銀行	12,300	377.00	4,637,100
八十二銀行	28,900	417.00	12,051,300
山梨中央銀行	1,400	841.00	1,177,400

大垣共立銀行	2,400	2,227.00	5,344,800
福井銀行	1,000	1,688.00	1,688,000
北國銀行	1,200	2,989.00	3,586,800
清水銀行	500	1,611.00	805,500
富山銀行	200	2,359.00	471,800
滋賀銀行	2,400	2,512.00	6,028,800
南都銀行	2,000	2,058.00	4,116,000
百五銀行	10,800	325.00	3,510,000
京都銀行	4,300	4,050.00	17,415,000
紀陽銀行	4,200	1,630.00	6,846,000
ほくほくフィナンシャルグループ	8,000	964.00	7,712,000
広島銀行	17,700	522.00	9,239,400
山陰合同銀行	7,100	526.00	3,734,600
中国銀行	10,300	957.00	9,857,100
鳥取銀行	400	1,163.00	465,200
伊予銀行	17,100	647.00	11,063,700
百十四銀行	1,300	1,858.00	2,415,400
四国銀行	1,800	803.00	1,445,400
阿波銀行	2,000	2,420.00	4,840,000
大分銀行	700	2,421.00	1,694,700
宮崎銀行	800	2,467.00	1,973,600
佐賀銀行	700	1,249.00	874,300
沖縄銀行	1,100	3,120.00	3,432,000
琉球銀行	2,800	954.00	2,671,200
セブン銀行	40,000	271.00	10,840,000
みずほフィナンシャルグループ	1,629,000	139.60	227,408,400
高知銀行	400	682.00	272,800
山口フィナンシャルグループ	15,000	668.00	10,020,000
長野銀行	400	1,119.00	447,600
名古屋銀行	900	2,430.00	2,187,000
北洋銀行	18,000	218.00	3,924,000
愛知銀行	400	2,830.00	1,132,000
中京銀行	500	2,099.00	1,049,500
大光銀行	400	1,382.00	552,800
愛媛銀行	1,700	1,179.00	2,004,300
トマト銀行	500	1,020.00	510,000
京葉銀行	5,100	525.00	2,677,500
栃木銀行	5,700	169.00	963,300
北日本銀行	400	1,759.00	703,600
東和銀行	2,100	692.00	1,453,200
福島銀行	1,100	164.00	180,400
大東銀行	600	617.00	370,200

トモニホールディングス	9,300	353.00	3,282,900
フィデアホールディングス	11,600	101.00	1,171,600
池田泉州ホールディングス	13,700	165.00	2,260,500
F P G	3,700	539.00	1,994,300
マーキュリアインベストメント	500	595.00	297,500
S B Iホールディングス	13,400	2,232.00	29,908,800
日本アジア投資	1,000	220.00	220,000
ジャフコ	1,800	3,955.00	7,119,000
大和証券グループ本社	96,200	478.80	46,060,560
野村ホールディングス	210,900	485.60	102,413,040
岡三証券グループ	10,200	349.00	3,559,800
丸三証券	3,600	435.00	1,566,000
東洋証券	4,200	112.00	470,400
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13,700	250.00	3,425,000
光世証券	300	575.00	172,500
水戸証券	3,400	208.00	707,200
いちよし証券	2,200	424.00	932,800
松井証券	6,800	906.00	6,160,800
マネックスグループ	8,800	240.00	2,112,000
極東証券	1,600	576.00	921,600
岩井コスモホールディングス	1,100	1,279.00	1,406,900
藍澤証券	2,200	703.00	1,546,600
マネーパートナーズグループ	1,200	213.00	255,600
スパークス・グループ	5,500	206.00	1,133,000
小林洋行	300	259.00	77,700
かんぽ生命保険	4,200	1,478.00	6,207,600
S O M P Oホールディングス	22,500	3,691.00	83,047,500
アニコムホールディングス	1,000	4,460.00	4,460,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	31,300	2,844.00	89,017,200
第一生命ホールディングス	67,800	1,309.50	88,784,100
東京海上ホールディングス	42,400	4,762.00	201,908,800
T & Dホールディングス	35,800	934.00	33,437,200
アドバンスクリエイト	200	2,032.00	406,400
全国保証	3,400	4,015.00	13,651,000
ジェイリース	300	316.00	94,800
イントラスト	400	825.00	330,000
日本モーゲージサービス	200	2,059.00	411,800
C a s a	400	1,136.00	454,400
アルヒ	1,900	1,509.00	2,867,100
プレミアグループ	700	1,820.00	1,274,000
クレディセゾン	8,400	1,099.00	9,231,600
芙蓉総合リース	1,300	5,950.00	7,735,000

みずほリース	1,800	2,389.00	4,300,200
東京センチュリー	2,400	5,920.00	14,208,000
日本証券金融	5,300	491.00	2,602,300
アイフル	18,200	226.00	4,113,200
リコーリース	900	2,907.00	2,616,300
イオンフィナンシャルサービス	7,300	901.00	6,577,300
アコム	24,100	391.00	9,423,100
ジャックス	1,300	1,676.00	2,178,800
オリエントコーポレーション	32,400	110.00	3,564,000
日立キャピタル	2,800	2,552.00	7,145,600
アプラスフィナンシャル	5,600	64.00	358,400
オリックス	74,400	1,210.50	90,061,200
三菱UFJリース	30,400	475.00	14,440,000
九州リースサービス	600	563.00	337,800
日本取引所グループ	34,400	2,850.00	98,040,000
イー・ギャランティ	1,300	2,638.00	3,429,400
アサックス	600	671.00	402,600
NECキャピタルソリューション	500	1,969.00	984,500
いちご	15,200	272.00	4,134,400
日本駐車場開発	11,800	140.00	1,652,000
スター・マイカ・ホールディングス	600	1,339.00	803,400
ADワークスグループ	2,200	169.00	371,800
ヒューリック	25,600	981.00	25,113,600
三栄建築設計	500	1,295.00	647,500
野村不動産ホールディングス	7,300	1,907.00	13,921,100
三重交通グループホールディングス	2,400	473.00	1,135,200
サムティ	1,700	1,244.00	2,114,800
ディア・ライフ	1,700	506.00	860,200
コーセーアールイー	400	501.00	200,400
日本商業開発	800	1,524.00	1,219,200
プレサンスコーポレーション	2,000	1,299.00	2,598,000
THEグローバル社	500	216.00	108,000
ハウスコム	200	1,320.00	264,000
日本管理センター	800	1,224.00	979,200
サンセイランディック	400	785.00	314,000
エストラスト	200	629.00	125,800
フージャースホールディングス	2,400	549.00	1,317,600
オープンハウス	3,500	3,120.00	10,920,000
東急不動産ホールディングス	32,600	444.00	14,474,400
飯田グループホールディングス	10,000	1,770.00	17,700,000
イーランド	200	711.00	142,200
ムゲンエステート	800	497.00	397,600

ビーロット	600	623.00	373,800
ファーストブラザーズ	300	750.00	225,000
ハウストゥ	600	835.00	501,000
シーアールイー	300	1,588.00	476,400
プロパティエージェント	200	1,056.00	211,200
ケイアイスター不動産	400	1,835.00	734,000
アグレ都市デザイン	200	519.00	103,800
グッドコムアセット	300	1,630.00	489,000
ジェイ・エス・ビー	300	2,821.00	846,300
テンポイノベーション	300	635.00	190,500
グローバル・リンク・マネジメント	200	623.00	124,600
パーク24	6,400	1,740.00	11,136,000
パラカ	300	1,648.00	494,400
三井不動産	59,100	1,813.50	107,177,850
三菱地所	84,000	1,586.00	133,224,000
平和不動産	2,200	2,844.00	6,256,800
東京建物	12,600	1,209.00	15,233,400
ダイビル	3,100	1,010.00	3,131,000
京阪神ビルディング	1,900	1,323.00	2,513,700
住友不動産	26,900	2,820.50	75,871,450
テーオーシー	2,400	700.00	1,680,000
東京楽天地	200	4,050.00	810,000
レオパレス21	15,700	183.00	2,873,100
スターツコーポレーション	1,600	2,165.00	3,464,000
フジ住宅	1,400	530.00	742,000
空港施設	1,200	422.00	506,400
明和地所	700	407.00	284,900
ゴールドクレスト	900	1,463.00	1,316,700
エスリード	500	1,373.00	686,500
日神グループホールディングス	1,800	372.00	669,600
日本エスコン	2,200	829.00	1,823,800
タカラレーベン	5,500	355.00	1,952,500
A V A N T I A	700	872.00	610,400
イオンモール	6,000	1,348.00	8,088,000
毎日コムネット	300	764.00	229,200
ファースト住建	500	992.00	496,000
ランド	64,000	10.00	640,000
カチタス	3,000	2,509.00	7,527,000
トーセイ	1,700	877.00	1,490,900
穴吹興産	300	1,509.00	452,700
サンフロンティア不動産	1,700	858.00	1,458,600
エフ・ジェー・ネクスト	1,000	858.00	858,000

インテリックス	300	489.00	146,700
ランドビジネス	400	347.00	138,800
サンネクスタグループ	400	1,076.00	430,400
グランディハウス	900	374.00	336,600
日本空港ビルデング	3,800	4,070.00	15,466,000
日本工営	800	2,942.00	2,353,600
L I F U L L	4,100	426.00	1,746,600
ジェイエシーリクルートメント	800	1,094.00	875,200
日本M&Aセンター	8,800	4,880.00	42,944,000
メンバーズ	300	1,446.00	433,800
中広	200	500.00	100,000
UTグループ	1,800	2,529.00	4,552,200
アイティメディア	500	1,764.00	882,000
タケエイ	1,100	1,073.00	1,180,300
E・Jホールディングス	200	2,154.00	430,800
ビーネックスグループ	1,500	1,085.00	1,627,500
コシダカホールディングス	2,800	404.00	1,131,200
アルトナー	300	859.00	257,700
パソナグループ	1,300	1,304.00	1,695,200
C D S	300	1,252.00	375,600
リンクアンドモチベーション	2,600	352.00	915,200
G C A	1,400	617.00	863,800
エス・エム・エス	3,600	2,489.00	8,960,400
サニーサイドアップグループ	400	663.00	265,200
パーソルホールディングス	11,600	1,438.00	16,680,800
リニカル	600	847.00	508,200
クックパッド	4,000	328.00	1,312,000
エスクリ	400	360.00	144,000
アイ・ケイ・ケイ	600	530.00	318,000
学情	400	1,009.00	403,600
スタジオアリス	600	1,557.00	934,200
シミックホールディングス	600	1,321.00	792,600
エプコ	200	1,304.00	260,800
N J S	300	1,741.00	522,300
総合警備保障	4,600	5,030.00	23,138,000
カカクコム	8,600	2,758.00	23,718,800
アイロムグループ	400	2,327.00	930,800
セントケア・ホールディング	700	436.00	305,200
サイネックス	200	684.00	136,800
ルネサンス	600	903.00	541,800
ディップ	1,600	2,200.00	3,520,000
デジタルホールディングス	600	1,422.00	853,200

新日本科学	1,300	658.00	855,400
ツクイ	2,700	492.00	1,328,400
キャリアデザインセンター	300	855.00	256,500
ベネフィット・ワン	4,200	2,158.00	9,063,600
エムスリー	25,600	5,110.00	130,816,000
ツカダ・グローバルホールディング	700	277.00	193,900
プラス	200	438.00	87,600
アウトソーシング	6,600	618.00	4,078,800
ウェルネット	1,200	618.00	741,600
ワールドホールディングス	400	1,561.00	624,400
ディー・エヌ・エー	4,900	1,270.00	6,223,000
博報堂D Yホールディングス	16,200	1,243.00	20,136,600
ぐるなび	2,000	635.00	1,270,000
タカミヤ	1,200	540.00	648,000
ジャパンベストレスキューシステム	900	811.00	729,900
ファンコミュニケーションズ	3,200	447.00	1,430,400
ライク	400	1,615.00	646,000
ビジネス・ブレークスルー	500	374.00	187,000
エスプール	3,000	723.00	2,169,000
WDBホールディングス	500	2,703.00	1,351,500
手間いらず	100	3,770.00	377,000
ティア	700	458.00	320,600
C D G	100	1,703.00	170,300
バリューコマース	700	3,350.00	2,345,000
インフォマート	12,700	672.00	8,534,400
J Pホールディングス	3,600	272.00	979,200
エコナックホールディングス	2,000	92.00	184,000
E P Sホールディングス	1,600	997.00	1,595,200
レッグス	300	880.00	264,000
プレステージ・インターナショナル	4,300	878.00	3,775,400
アミューズ	600	2,130.00	1,278,000
ドリームインキュベータ	400	1,365.00	546,000
クイック	700	1,116.00	781,200
T A C	600	195.00	117,000
ケネディクス	10,800	483.00	5,216,400
電通グループ	12,000	2,554.00	30,648,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	400	547.00	218,800
ぴあ	300	3,060.00	918,000
イオンファンタジー	400	1,569.00	627,600
シーティーエス	1,300	836.00	1,086,800
ネクシィーズグループ	400	856.00	342,400
H . U . グループホールディングス	3,200	2,458.00	7,865,600



アルプス技研	1,000	1,926.00	1,926,000
サニックス	2,000	267.00	534,000
ダイオーズ	200	982.00	196,400
日本空調サービス	1,200	742.00	890,400
オリエンタルランド	12,400	14,000.00	173,600,000
ダスキン	2,900	2,735.00	7,931,500
明光ネットワークジャパン	1,500	771.00	1,156,500
ファルコホールディングス	600	1,575.00	945,000
秀英予備校	300	423.00	126,900
田谷	200	530.00	106,000
ラウンドワン	3,200	727.00	2,326,400
リゾートトラスト	5,300	1,327.00	7,033,100
ビー・エム・エル	1,500	2,706.00	4,059,000
ワタベウェディング	200	277.00	55,400
りらいあコミュニケーションズ	2,100	1,164.00	2,444,400
リソー教育	5,300	315.00	1,669,500
早稲田アカデミー	500	975.00	487,500
ユー・エス・エス	13,000	1,696.00	22,048,000
東京個別指導学院	400	532.00	212,800
サイバーエージェント	7,200	5,760.00	41,472,000
楽天	54,100	1,004.00	54,316,400
クリーク・アンド・リバー社	600	1,200.00	720,000
テー・オー・ダブリュー	1,800	288.00	518,400
山田コンサルティンググループ	800	1,277.00	1,021,600
セントラルスポーツ	400	2,191.00	876,400
フルキャストホールディングス	1,200	1,303.00	1,563,600
エン・ジャパン	2,100	2,832.00	5,947,200
リソルホールディングス	100	3,485.00	348,500
テクノプロ・ホールディングス	2,300	5,780.00	13,294,000
アトラ	200	240.00	48,000
インターワークス	200	351.00	70,200
アイ・アールジャパンホールディングス	500	12,500.00	6,250,000
Keeper 技研	400	1,711.00	684,400
ファーストロジック	200	647.00	129,400
三機サービス	200	1,065.00	213,000
Gunosy	700	799.00	559,300
デザインワン・ジャパン	300	230.00	69,000
イー・ガーディアン	500	3,050.00	1,525,000
リブセンス	700	295.00	206,500
ジャパンマテリアル	3,600	1,667.00	6,001,200
ベクトル	1,400	790.00	1,106,000
ウチヤマホールディングス	600	297.00	178,200

チャーム・ケア・コーポレーション	1,000	766.00	766,000
ライクキッズ	200	1,003.00	200,600
キャリアリンク	400	808.00	323,200
I B J	800	679.00	543,200
アサンテ	500	1,473.00	736,500
N・フィールド	800	471.00	376,800
バリューHR	500	1,400.00	700,000
M&Aキャピタルパートナーズ	900	3,650.00	3,285,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	400	2,240.00	896,000
E R Iホールディングス	300	612.00	183,600
アビスト	200	2,695.00	539,000
シグマクシス	800	1,584.00	1,267,200
ウィルグループ	800	630.00	504,000
エスクロー・エージェント・ジャパン	1,600	296.00	473,600
リクルートホールディングス	83,200	3,558.00	296,025,600
エラン	700	1,814.00	1,269,800
土木管理総合試験所	500	381.00	190,500
ネットマーケティング	400	565.00	226,000
日本郵政	95,200	775.70	73,846,640
ベルシステム24ホールディングス	1,900	1,747.00	3,319,300
鎌倉新書	900	842.00	757,800
S M N	200	1,013.00	202,600
一蔵	100	379.00	37,900
L I T A L I C O	400	2,202.00	880,800
グローバルキッズCOMPANY	200	660.00	132,000
エアトリ	600	1,114.00	668,400
アトラエ	400	2,780.00	1,112,000
ストライク	400	4,725.00	1,890,000
ソラスト	3,200	1,082.00	3,462,400
セラク	400	1,318.00	527,200
インソース	500	2,513.00	1,256,500
ベйкаレント・コンサルティング	700	12,900.00	9,030,000
Orchestra Holdings	200	1,662.00	332,400
アイモバイル	400	728.00	291,200
キャリアインデックス	500	399.00	199,500
MS - J a p a n	400	807.00	322,800
船場	200	940.00	188,000
グレイステクノロジー	500	5,690.00	2,845,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	1,200	3,550.00	4,260,000
フルテック	200	1,325.00	265,000
グリーンズ	300	464.00	139,200
ツナググループ・ホールディングス	200	411.00	82,200

GameWith	300	543.00	162,900
ソウルドアウト	200	2,238.00	447,600
MS&Consulting	200	574.00	114,800
ミダック	200	1,570.00	314,000
日総工産	800	629.00	503,200
キュービーネットホールディングス	500	1,793.00	896,500
RPAホールディングス	900	749.00	674,100
スプリックス	300	696.00	208,800
マネジメントソリューションズ	500	1,348.00	674,000
プロレド・パートナーズ	200	5,260.00	1,052,000
and factory	100	929.00	92,900
ギークス	100	1,089.00	108,900
カーブスホールディングス	3,200	573.00	1,833,600
フォーラムエンジニアリング	600	747.00	448,200
アドバンテッジリスクマネジメント	600	825.00	495,000
リログループ	6,300	1,965.00	12,379,500
東祥	700	1,199.00	839,300
エイチ・アイ・エス	1,800	1,556.00	2,800,800
ラックランド	300	2,220.00	666,000
共立メンテナンス	1,900	3,405.00	6,469,500
イチネンホールディングス	1,300	1,164.00	1,513,200
建設技術研究所	800	1,708.00	1,366,400
スペース	800	940.00	752,000
長大	500	1,067.00	533,500
燦ホールディングス	500	1,205.00	602,500
スバル興業	100	7,640.00	764,000
東京テアトル	500	1,203.00	601,500
タナベ経営	200	1,305.00	261,000
ナガワ	400	7,610.00	3,044,000
よみうりランド	300	3,595.00	1,078,500
東京都競馬	800	4,240.00	3,392,000
常磐興産	500	1,464.00	732,000
カナモト	1,900	2,299.00	4,368,100
東京ドーム	4,700	733.00	3,445,100
西尾レントオール	1,100	2,170.00	2,387,000
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	7,000	31.00	217,000
トランス・コスモス	1,100	2,596.00	2,855,600
乃村工藝社	5,000	808.00	4,040,000
藤田観光	500	1,529.00	764,500
KNT-CTホールディングス	700	919.00	643,300
日本管財	1,200	2,013.00	2,415,600
トーカイ	1,100	2,264.00	2,490,400

白洋舎	100	2,787.00	278,700
セコム	12,300	9,366.00	115,201,800
セントラル警備保障	600	3,575.00	2,145,000
丹青社	2,200	703.00	1,546,600
メイテック	1,400	5,370.00	7,518,000
応用地質	1,200	1,449.00	1,738,800
船井総研ホールディングス	2,400	2,369.00	5,685,600
進学会ホールディングス	500	421.00	210,500
オオバ	800	689.00	551,200
いであ	300	1,831.00	549,300
学究社	300	1,108.00	332,400
ベネッセホールディングス	3,900	2,934.00	11,442,600
イオンディライト	1,400	3,245.00	4,543,000
ナック	600	930.00	558,000
ニチイ学館	1,200	1,605.00	1,926,000
ダイセキ	1,900	2,411.00	4,580,900
ステップ	400	1,540.00	616,000
合 計	14,392,000		26,845,238,190

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## RAM先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2020年 7月27日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,046,656,926
コール・ローン	62,366,485
株式	44,096,852,265
投資証券	1,091,488,777
派生商品評価勘定	512,858,830

2020年 7月27日現在

未収入金	1,036,403
未収配当金	38,506,389
差入委託証拠金	2,702,643,039
流動資産合計	61,552,409,114
資産合計	61,552,409,114
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,714,632
未払解約金	57,501,000
未払利息	169
流動負債合計	62,215,801
負債合計	62,215,801
純資産の部	
元本等	
元本	46,174,135,861
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,316,057,452
元本等合計	61,490,193,313
純資産合計	61,490,193,313
負債純資産合計	61,552,409,114

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	20,696,961,350円
期中追加設定元本額	67,134,669,045円
期中一部解約元本額	41,657,494,534円
期末元本額	46,174,135,861円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,773,641,367円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,642,825,422円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,134,251,270円
DCりそな グローバルバランス	36,358,347円
つみたてバランスファンド	1,144,518,133円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	669,132,633円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	328,133,054円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	197,046,314円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	12,985,862円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,897,128円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,819,401円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,300,647円
リスクコントロール・オープン	27,838,287円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	287,169,265円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	163,101,258円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	20,414,784,997円
Smart-i 先進国株式インデックス	2,995,432,541円
Smart-i 8資産バランス 安定型	92,158,169円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	251,486,392円
Smart-i 8資産バランス 成長型	268,696,370円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,687,766,274円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,228,644,680円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	784,225,961円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	505,044,426円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,570,014,671円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	255,520,616円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,640,320円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	385,727,212円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,250,163,169円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	40,811,675円
2. 計算日における受益権の総数	46,174,135,861口

3. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3317円
(10,000口当たり純資産額)	(13,317円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

2020年 7月27日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		979,302,733
投資証券		147,767,061
合計		1,127,069,794

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

## (株式関連)

(2020年 7月27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	15,751,953,654	-	16,260,097,852	508,144,198
合計		15,751,953,654	-	16,260,097,852	508,144,198

## (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。



## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	IAC/INTERACTIVECORP	691	125.79	86,920.89	
	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	16.37	117,618.45	
	CABOT OIL & GAS CORP	2,861	19.04	54,473.44	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	48.99	123,160.86	
	CHEVRON CORP	20,064	90.13	1,808,368.32	
	CONCHO RESOURCES INC	1,797	53.46	96,067.62	
	CONOCOPHILLIPS	11,641	40.28	468,899.48	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	1,657	40.73	67,489.61	
	EOG RESOURCES INC	6,306	49.04	309,246.24	
	EXXON MOBIL CORP	45,166	43.43	1,961,559.38	
	HALLIBURTON CO	7,683	14.71	113,016.93	
	HESS CORP	3,020	50.46	152,389.20	
	HOLLYFRONTIER CORP	1,707	26.98	46,054.86	
	KINDER MORGAN INC	22,071	14.25	314,511.75	
	MARATHON PETROLEUM CORP	7,066	38.70	273,454.20	
	NATIONAL OILWELL VARCO INC	3,053	12.74	38,895.22	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	9,822	16.74	164,420.28	
	ONEOK INC	4,830	28.72	138,717.60	
	PHILLIPS 66	4,762	65.06	309,815.72	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,821	99.68	181,517.28	
	SCHLUMBERGER LTD	15,077	19.48	293,699.96	
	VALERO ENERGY CORP	4,460	57.98	258,590.80	
	WILLIAMS COS INC	13,196	19.21	253,495.16	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2,378	291.52	693,234.56	
	ALBEMARLE CORP	1,183	87.04	102,968.32	
	AMCOR PLC	17,805	10.67	189,979.35	
AVERY DENNISON CORP	928	120.41	111,740.48		
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	22.74	38,339.64		
BALL CORP	3,574	73.16	261,473.84		

CELANESE CORP	1,332	92.43	123,116.76
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,555	30.58	47,551.90
CORTEVA INC	8,263	28.52	235,660.76
CROWN HOLDINGS INC	1,510	70.70	106,757.00
DOW INC	8,080	42.61	344,288.80
DUPONT DE NEMOURS INC	8,014	54.55	437,163.70
EASTMAN CHEMICAL CO	1,243	76.64	95,263.52
ECOLAB INC	2,752	210.06	578,085.12
FMC CORP	1,444	107.34	154,998.96
FREEPORT-MCMORAN INC	16,054	13.12	210,628.48
INTERNATIONAL PAPER CO	4,150	36.32	150,728.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	708	126.82	89,788.56
LINDE PLC	5,713	244.07	1,394,371.91
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,955	68.50	202,417.50
MARTIN MARIETTA MATERIALS	693	223.65	154,989.45
MOSAIC CO/THE	3,288	13.67	44,946.96
NEWMONT CORP	8,719	66.75	581,993.25
NUCOR CORP	3,362	42.85	144,061.70
PACKAGING CORP OF AMERICA	848	102.79	87,165.92
PPG INDUSTRIES INC	2,581	110.56	285,355.36
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	79.69	115,231.74
SEALED AIR CORP	1,397	37.25	52,038.25
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	897	620.02	556,157.94
STEEL DYNAMICS INC	2,352	27.83	65,456.16
VULCAN MATERIALS CO	1,473	127.28	187,483.44
WESTROCK CO	2,274	30.21	68,697.54
3M CO	6,170	159.84	986,212.80
AERCAP HOLDINGS NV	853	28.23	24,080.19
ALLEGION PLC	1,026	101.02	103,646.52
AMETEK INC	2,517	92.90	233,829.30
BOEING CO/THE	5,732	173.76	995,992.32
CARRIER GLOBAL CORP	9,015	26.58	239,618.70
CATERPILLAR INC	5,909	137.58	812,960.22
CUMMINS INC	1,639	188.24	308,525.36
DEERE & CO	3,214	175.35	563,574.90

DOVER CORP	1,600	105.51	168,816.00
EATON CORP PLC	4,479	93.61	419,279.19
EMERSON ELECTRIC CO	6,625	63.36	419,760.00
FASTENAL CO	6,269	45.74	286,744.06
FORTIVE CORP	3,320	71.00	235,720.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,104	71.00	78,384.00
GENERAL DYNAMICS CORP	2,668	150.15	400,600.20
GENERAL ELECTRIC CO	94,041	6.86	645,121.26
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,524	35.66	54,345.84
HEICO CORP	242	95.45	23,098.90
HEICO CORP-CLASS A	819	75.69	61,990.11
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,631	149.43	1,140,300.33
HOWMET AEROSPACE INC	3,134	15.55	48,733.70
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	289	177.06	51,170.34
IDEX CORP	845	167.67	141,681.15
ILLINOIS TOOL WORKS	3,433	184.79	634,384.07
INGERSOLL-RAND INC	3,920	31.60	123,872.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,079	83.94	90,571.26
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	40.04	112,112.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	19.72	45,356.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	8,332	36.80	306,617.60
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,394	171.24	409,948.56
LENNOX INTERNATIONAL INC	245	265.78	65,116.10
LOCKHEED MARTIN CORP	2,720	386.21	1,050,491.20
MASCO CORP	3,079	54.10	166,573.90
NORDSON CORP	495	192.23	95,153.85
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,718	312.69	537,201.42
OTIS WORLDWIDE CORP	4,485	58.13	260,713.05
OWENS CORNING	860	61.76	53,113.60
PACCAR INC	3,778	85.74	323,925.72
PARKER HANNIFIN CORP	1,404	182.86	256,735.44
PENTAIR PLC	1,289	42.38	54,627.82
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	16,242	62.07	1,008,140.94
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,269	226.19	287,035.11
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,147	415.27	476,314.69

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	40.42	67,986.44
SMITH (A.O.) CORP	1,507	51.31	77,324.17
SNAP-ON INC	437	141.75	61,944.75
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,689	152.91	258,264.99
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	406	308.95	125,433.70
TEXTRON INC	1,613	34.35	55,406.55
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,613	103.76	271,124.88
TRANSDIGM GROUP INC	559	425.56	237,888.04
UNITED RENTALS INC	621	160.88	99,906.48
WABTEC CORP	2,019	61.87	124,915.53
WW GRAINGER INC	506	341.39	172,743.34
XYLEM INC	1,998	74.25	148,351.50
CINTAS CORP	955	302.60	288,983.00
COPART INC	2,291	89.52	205,090.32
COSTAR GROUP INC	421	703.77	296,287.17
EQUIFAX INC	1,317	167.16	220,149.72
IHS MARKIT LTD	4,101	79.56	326,275.56
NIELSEN HOLDINGS PLC	2,733	14.93	40,803.69
REPUBLIC SERVICES INC	2,433	85.03	206,877.99
ROBERT HALF INTL INC	673	52.73	35,487.29
ROLLINS INC	1,190	48.68	57,929.20
TRANSUNION	2,060	89.73	184,843.80
VERISK ANALYTICS INC	1,675	179.78	301,131.50
WASTE CONNECTIONS INC	2,855	99.43	283,872.65
WASTE MANAGEMENT INC	4,563	107.28	489,518.64
AMERCO	106	316.47	33,545.82
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	86.07	127,900.02
CSX CORP	8,321	71.34	593,620.14
DELTA AIR LINES INC	1,316	25.96	34,163.36
EXPEDITORS INTL WASH INC	1,870	80.19	149,955.30
FEDEX CORP	2,677	165.04	441,812.08
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	734	130.79	95,999.86
KANSAS CITY SOUTHERN	1,059	154.70	163,827.30
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	45.11	47,094.84
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,778	187.01	519,513.78

OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,051	182.24	191,534.24
SOUTHWEST AIRLINES CO	908	31.66	28,747.28
UBER TECHNOLOGIES INC	10,289	31.18	320,811.02
UNION PACIFIC CORP	7,380	176.12	1,299,765.60
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,523	118.35	890,347.05
XPO LOGISTICS INC	977	79.25	77,427.25
APTIV PLC	2,927	82.25	240,745.75
AUTOLIV INC	743	68.49	50,888.07
BORGWARNER INC	2,199	38.36	84,353.64
FORD MOTOR CO	42,318	6.88	291,147.84
GENERAL MOTORS CO	13,900	26.25	364,875.00
LEAR CORP	352	116.59	41,039.68
TESLA INC	1,574	1,417.00	2,230,358.00
DR HORTON INC	3,907	63.75	249,071.25
GARMIN LTD	1,303	96.74	126,052.22
HASBRO INC	1,095	77.59	84,961.05
LENNAR CORP-A	3,110	69.79	217,046.90
LULULEMON ATHLETICA INC	1,355	321.50	435,632.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	85.01	47,945.64
NEWELL RUBBERMAID INC	2,767	17.14	47,426.38
NIKE INC -CL B	13,339	98.43	1,312,957.77
NVR INC	40	3,810.39	152,415.60
PULTEGROUP INC	2,237	42.62	95,340.94
RALPH LAUREN CORP	478	71.45	34,153.10
VF CORP	3,763	59.90	225,403.70
WHIRLPOOL CORP	714	157.95	112,776.30
ARAMARK	2,216	22.66	50,214.56
CARNIVAL CORP	3,704	14.80	54,819.20
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	290	1,130.26	327,775.40
DARDEN RESTAURANTS INC	1,103	78.64	86,739.92
DOMINO'S PIZZA INC	438	386.91	169,466.58
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,098	77.43	239,878.14
LAS VEGAS SANDS CORP	3,893	44.36	172,693.48
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,056	87.50	267,400.00
MCDONALD'S CORP	7,991	198.72	1,587,971.52

MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	1,100	15.25	16,775.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,588	15.79	72,444.52
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,568	50.83	79,701.44
STARBUCKS CORP	12,635	75.78	957,480.30
VAIL RESORTS INC	293	193.90	56,812.70
WYNN RESORTS LTD	1,017	73.41	74,657.97
YUM! BRANDS INC	3,325	93.14	309,690.50
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,296	79.99	663,597.04
ALPHABET INC-CL A	3,198	1,508.21	4,823,255.58
ALPHABET INC-CL C	3,272	1,511.87	4,946,838.64
ALTICE USA INC- A	2,974	24.09	71,643.66
CABLE ONE INC	41	1,797.54	73,699.14
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,582	561.72	888,641.04
COMCAST CORP-CLASS A	48,588	43.35	2,106,289.80
DISCOVERY INC - A	1,722	21.15	36,420.30
DISCOVERY INC-C	3,336	18.93	63,150.48
DISH NETWORK CORP-A	2,183	33.36	72,824.88
ELECTRONIC ARTS INC	3,153	135.24	426,411.72
FACEBOOK INC-A	25,641	230.71	5,915,635.11
FOX CORP - CLASS A	3,877	26.66	103,360.82
FOX CORP- CLASS B	1,836	26.49	48,635.64
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	3,689	18.55	68,430.95
LIBERTY BROADBAND-A	223	130.63	29,130.49
LIBERTY BROADBAND-C	1,204	132.77	159,855.08
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	35.08	75,527.24
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	34.41	60,458.37
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	34.27	32,419.42
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,564	47.92	74,946.88
MATCH GROUP INC	2,699	90.36	243,881.64
NETFLIX INC	4,689	480.45	2,252,830.05
NEWS CORP - CLASS A	2,810	12.71	35,715.10
OMNICOM GROUP	2,439	56.56	137,949.84
PINTEREST INC- CLASS A	4,088	24.54	100,319.52
ROKU INC	1,052	151.17	159,030.84
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.90	61,335.23

SNAP INC - A	9,678	22.15	214,367.70
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,271	156.02	198,301.42
TWITTER INC	8,612	37.54	323,294.48
VIACOMCBS INC - CLASS B	6,314	24.75	156,271.50
WALT DISNEY CO/THE	19,296	117.61	2,269,402.56
ZILLOW GROUP INC - C	1,408	65.72	92,533.76
ADVANCE AUTO PARTS INC	587	147.27	86,447.49
AMAZON.COM INC	4,506	3,008.91	13,558,148.46
AUTOZONE INC	258	1,168.59	301,496.22
BEST BUY CO INC	2,568	96.99	249,070.32
BOOKING HOLDINGS INC	442	1,701.30	751,974.60
BURLINGTON STORES INC	580	186.92	108,413.60
CARMAX INC	1,819	97.46	177,279.74
DOLLAR GENERAL CORP	2,750	191.70	527,175.00
DOLLAR TREE INC	2,604	95.60	248,942.40
EBAY INC	8,607	55.12	474,417.84
EXPEDIA GROUP INC	1,497	83.72	125,328.84
GENUINE PARTS CO	1,255	88.64	111,243.20
HOME DEPOT INC	11,640	265.31	3,088,208.40
LKQ CORP	2,845	27.96	79,546.20
LOWE'S COS INC	8,214	147.03	1,207,704.42
MERCADOLIBRE INC	484	988.99	478,671.16
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	815	442.34	360,507.10
ROSS STORES INC	3,908	86.16	336,713.28
TARGET CORP	5,458	123.71	675,209.18
TIFFANY & CO	1,214	121.41	147,391.74
TJX COMPANIES INC	12,956	52.89	685,242.84
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,305	146.53	191,221.65
ULTA BEAUTY INC	498	203.71	101,447.58
WAYFAIR INC- CLASS A	567	222.79	126,321.93
COSTCO WHOLESALE CORP	4,723	325.78	1,538,658.94
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	100	4.23	423.00
KROGER CO	8,728	34.71	302,948.88
SYSCO CORP	5,273	54.94	289,698.62
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,179	40.51	331,331.29

WALMART INC	15,151	131.24	1,988,417.24
ALTRIA GROUP INC	19,925	41.85	833,861.25
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	6,088	42.09	256,243.92
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3,379	68.00	229,772.00
BUNGE LTD	1,423	44.33	63,081.59
CAMPBELL SOUP CO	1,995	49.40	98,553.00
COCA-COLA CO/THE	43,505	48.49	2,109,557.45
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,555	41.02	63,786.10
CONAGRA BRANDS INC	5,346	36.61	195,717.06
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,815	179.85	326,427.75
GENERAL MILLS INC	6,531	64.23	419,486.13
HERSHEY CO/THE	1,622	145.68	236,292.96
HORMEL FOODS CORP	3,241	50.27	162,925.07
INGREDION INC	744	87.35	64,988.40
JM SMUCKER CO/THE	1,257	108.14	135,931.98
KELLOGG CO	2,819	68.68	193,608.92
KEURIG DR PEPPER INC	3,147	30.34	95,479.98
KRAFT HEINZ CO/THE	7,334	34.68	254,343.12
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,300	67.79	88,127.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	1,348	193.52	260,864.96
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	1,463	36.49	53,384.87
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	15,364	54.87	843,022.68
MONSTER BEVERAGE CORP	4,374	74.88	327,525.12
PEPSICO INC	14,832	136.06	2,018,041.92
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,639	76.85	1,278,707.15
TYSON FOODS INC-CL A	3,241	60.82	197,117.62
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,623	85.87	225,237.01
CLOROX COMPANY	1,334	227.04	302,871.36
COLGATE-PALMOLIVE CO	8,654	74.32	643,165.28
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,370	191.75	454,447.50
KIMBERLY-CLARK CORP	3,642	147.34	536,612.28
PROCTER & GAMBLE CO/THE	26,285	125.96	3,310,858.60
ABBOTT LABORATORIES	18,821	98.95	1,862,337.95
ABIOMED INC	494	292.94	144,712.36
ALIGN TECHNOLOGY INC	815	298.14	242,984.10



AMERISOURCEBERGEN CORP	1,693	103.76	175,665.68
ANTHEM INC	2,704	270.49	731,404.96
BAXTER INTERNATIONAL INC	5,493	89.26	490,305.18
BECTON DICKINSON AND CO	2,906	271.89	790,112.34
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,005	38.60	579,193.00
CARDINAL HEALTH INC	3,200	56.50	180,800.00
CENTENE CORP	6,322	67.51	426,798.22
CERNER CORP	3,392	71.79	243,511.68
CIGNA CORP	3,992	181.02	722,631.84
COOPER COS INC/THE	539	283.58	152,849.62
CVS HEALTH CORP	13,958	63.34	884,099.72
DANAHER CORP	6,696	195.27	1,307,527.92
DAVITA INC	653	87.33	57,026.49
DENTSPLY SIRONA INC	2,048	43.24	88,555.52
DEXCOM INC	987	421.75	416,267.25
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	6,751	78.13	527,455.63
HCA HEALTHCARE INC	2,934	125.51	368,246.34
HENRY SCHEIN INC	1,305	67.03	87,474.15
HOLOGIC INC	2,888	61.75	178,334.00
HUMANA INC	1,419	392.14	556,446.66
IDEXX LABORATORIES INC	923	359.23	331,569.29
INSULET CORP	689	196.69	135,519.41
INTUITIVE SURGICAL INC	1,243	675.33	839,435.19
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,064	198.74	211,459.36
MASIMO CORP	462	233.46	107,858.52
MCKESSON CORP	1,755	155.34	272,621.70
MEDTRONIC PLC	14,324	96.35	1,380,117.40
MOLINA HEALTHCARE INC	546	184.25	100,600.50
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,464	124.99	182,985.36
RESMED INC	1,566	202.44	317,021.04
STERIS PLC	740	156.35	115,699.00
STRYKER CORP	3,616	198.83	718,969.28
TELADOC HEALTH INC	632	212.85	134,521.20
TELEFLEX INC	508	387.66	196,931.28
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,112	300.79	3,041,588.48

UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	653	108.08	70,576.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	994	127.16	126,397.04
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,428	251.95	359,784.60
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	808	262.66	212,229.28
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,240	134.11	300,406.40
ABBVIE INC	18,852	97.11	1,830,717.72
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,370	94.81	319,509.70
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,406	101.49	244,184.94
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,233	153.10	188,772.30
AMGEN INC	6,299	247.98	1,562,026.02
AVANTOR INC	3,867	18.48	71,462.16
BEIGENE LTD-ADR	500	224.44	112,220.00
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	515.75	126,874.50
BIOGEN INC	1,873	272.33	510,074.09
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,957	122.95	240,613.15
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	24,116	57.85	1,395,110.60
CATALENT INC	1,400	81.64	114,296.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	3,830	23.59	90,349.70
ELI LILLY & CO	9,193	159.54	1,466,651.22
EXACT SCIENCES CORP	1,627	95.39	155,199.53
GILEAD SCIENCES INC	13,520	73.64	995,612.80
ILLUMINA INC	1,579	382.25	603,572.75
INCYTE CORP	2,012	99.42	200,033.04
IONIS PHARMACEUTICALS INC	958	58.95	56,474.10
IQVIA HOLDINGS INC	2,091	157.88	330,127.08
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	406	112.89	45,833.34
JOHNSON & JOHNSON	28,077	148.12	4,158,765.24
MERCK & CO. INC.	27,061	77.10	2,086,403.10
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	263	862.72	226,895.36
MODERNA INC	2,441	73.21	178,705.61
MYLAN NV	4,542	15.96	72,490.32
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	125.20	120,692.80
PERKINELMER INC	1,224	110.37	135,092.88
PERRIGO CO PLC	998	55.80	55,688.40
PFIZER INC	59,057	37.66	2,224,086.62

REGENERON PHARMACEUTICALS	1,082	608.94	658,873.08
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	158.63	128,966.19
SEATTLE GENETICS INC	1,315	168.81	221,991.72
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	11.49	147,290.31
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,259	406.38	1,730,772.42
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	2,778	278.49	773,645.22
WATERS CORP	535	223.05	119,331.75
ZOETIS INC	5,094	144.22	734,656.68
BANK OF AMERICA CORP	83,806	24.35	2,040,676.10
CITIGROUP INC	22,512	51.67	1,163,195.04
CITIZENS FINANCIAL GROUP	3,620	25.58	92,599.60
COMERICA INC	1,325	37.42	49,581.50
EAST WEST BANCORP INC	1,540	35.61	54,839.40
FIFTH THIRD BANCORP	7,761	19.54	151,649.94
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,868	114.82	214,483.76
HUNTINGTON BANCSHARES INC	8,992	9.60	86,323.20
JPMORGAN CHASE & CO	32,764	98.28	3,220,045.92
KEYCORP	8,597	12.25	105,313.25
M & T BANK CORP	1,428	105.13	150,125.64
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	3,423	12.00	41,076.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	4,656	106.84	497,447.04
REGIONS FINANCIAL CORP	8,675	10.92	94,731.00
SIGNATURE BANK	590	109.59	64,658.10
SVB FINANCIAL GROUP	416	230.43	95,858.88
TRUIST FINANCIAL CORP	14,419	37.74	544,173.06
US BANCORP	14,716	36.92	543,314.72
WELLS FARGO & CO	41,644	26.26	1,093,571.44
ZIONS BANCORPORATION	1,197	33.63	40,255.11
ALLY FINANCIAL INC	3,571	21.18	75,633.78
AMERICAN EXPRESS CO	7,407	95.33	706,109.31
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,374	155.26	213,327.24
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	52.02	80,891.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	8,766	36.23	317,592.18
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	14,800	194.52	2,878,896.00
BLACKROCK INC	1,639	570.62	935,246.18

BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	7,338	55.70	408,726.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,016	65.06	326,340.96
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	28.71	35,887.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	89.46	110,840.94
CME GROUP INC	3,868	168.75	652,725.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,800	50.82	142,296.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,943	51.77	100,589.11
EQUITABLE HOLDINGS INC	2,938	20.30	59,641.40
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	344	347.94	119,691.36
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	20.60	56,402.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	3,540	201.47	713,203.80
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	5,988	96.32	576,764.16
INVESCO LTD	2,612	10.44	27,269.28
KKR & CO INC	5,635	34.69	195,478.15
MARKETAXESS HOLDINGS INC	421	505.81	212,946.01
MOODY'S CORP	1,827	289.68	529,245.36
MORGAN STANLEY	12,955	50.18	650,081.90
MSCI INC	928	385.65	357,883.20
NASDAQ INC	1,296	130.56	169,205.76
NORTHERN TRUST CORP	2,230	76.03	169,546.90
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,053	72.12	75,942.36
S&P GLOBAL INC	2,621	349.97	917,271.37
SCHWAB (CHARLES) CORP	12,586	34.94	439,754.84
SEI INVESTMENTS COMPANY	896	52.97	47,461.12
STATE STREET CORP	3,914	62.35	244,037.90
SYNCHRONY FINANCIAL	6,195	23.56	145,954.20
T ROWE PRICE GROUP INC	2,586	133.97	346,446.42
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,033	37.77	114,556.41
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	54.49	39,995.66
VOYA FINANCIAL INC	845	49.19	41,565.55
AFLAC INC	7,568	36.77	278,275.36
ALLEGHANY CORP	101	537.00	54,237.00
ALLSTATE CORP	3,471	94.36	327,523.56
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	61.90	48,034.40
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	9,607	31.31	300,795.17

AON PLC	2,512	207.17	520,411.04
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,552	30.85	140,429.20
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,097	103.93	217,941.21
ASSURANT INC	506	106.79	54,035.74
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	33.39	42,405.30
BROWN & BROWN INC	2,686	45.40	121,944.40
CHUBB LTD	4,881	134.91	658,495.71
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	83.23	144,320.82
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	146	206.25	30,112.50
EVEREST RE GROUP LTD	313	224.01	70,115.13
FNF GROUP	3,124	33.39	104,310.36
GLOBE LIFE INC	921	80.37	74,020.77
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,020	41.48	166,749.60
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	37.21	76,652.60
LOEWS CORP	2,906	36.87	107,144.22
MARKEL CORP	155	1,015.44	157,393.20
MARSH & MCLENNAN COS	5,447	114.62	624,335.14
METLIFE INC	8,537	38.22	326,284.14
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	2,449	44.77	109,641.73
PROGRESSIVE CORP	6,345	87.86	557,471.70
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,378	64.91	284,175.98
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	470	87.29	41,026.30
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	180.14	101,238.68
TRAVELERS COS INC/THE	2,795	118.28	330,592.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,416	211.52	299,512.32
WR BERKLEY CORP	1,291	63.96	82,572.36
CBRE GROUP INC - A	3,058	43.16	131,983.28
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	8,400	3.88	32,592.00
JONES LANG LASALLE INC	468	100.06	46,828.08
ACCENTURE PLC-CL A	6,783	221.44	1,502,027.52
ADOBE INC	5,143	430.31	2,213,084.33
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1,773	111.74	198,115.02
ANSYS INC	933	293.51	273,844.83
AUTODESK INC	2,364	232.88	550,528.32
AUTOMATIC DATA PROCESSING	4,632	145.43	673,631.76

AVALARA INC	656	123.93	81,298.08
BLACK KNIGHT INC	1,644	73.17	120,291.48
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	74.34	114,557.94
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,262	131.28	165,675.36
CADENCE DESIGN SYS INC	3,037	102.59	311,565.83
CDK GLOBAL INC	1,236	43.95	54,322.20
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,222	123.48	150,892.56
CITRIX SYSTEMS INC	1,273	142.49	181,389.77
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	5,936	61.80	366,844.80
COUPA SOFTWARE INC	728	292.11	212,656.08
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	916	100.03	91,627.48
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	279	113.52	31,672.08
DATADOG INC - CLASS A	933	84.84	79,155.72
DOCUSIGN INC	1,842	190.95	351,729.90
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	21.35	57,538.25
DYNATRACE INC	1,119	41.28	46,192.32
EPAM SYSTEMS INC	480	274.10	131,568.00
FAIR ISAAC CORP	258	414.33	106,897.14
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	6,599	143.70	948,276.30
FISERV INC	6,206	100.63	624,509.78
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	930	258.08	240,014.40
FORTINET INC	1,600	133.04	212,864.00
GARTNER INC	792	124.69	98,754.48
GLOBAL PAYMENTS INC	3,221	172.63	556,041.23
GODADDY INC - CLASS A	1,543	68.61	105,865.23
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	116.64	105,909.12
INTL BUSINESS MACHINES CORP	9,501	125.79	1,195,130.79
INTUIT INC	2,790	288.68	805,417.20
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	179.59	151,394.37
LEIDOS HOLDINGS INC	1,476	91.07	134,419.32
MASTERCARD INC-CLASS A	9,541	306.92	2,928,323.72
MICROSOFT CORP	76,921	201.30	15,484,197.30
MONGODB INC	444	204.64	90,860.16
NORTONLIFELOCK INC	6,268	20.38	127,773.18
OKTA INC	1,233	205.64	253,554.12

ORACLE CORP	23,992	55.65	1,335,154.80
PALO ALTO NETWORKS INC	1,084	243.77	264,246.68
PAYCHEX INC	3,506	72.19	253,098.14
PAYCOM SOFTWARE INC	550	286.97	157,833.50
PAYPAL HOLDINGS INC	11,889	172.56	2,051,565.84
PTC INC	1,110	81.46	90,420.60
RINGCENTRAL INC-CLASS A	788	268.25	211,381.00
SALESFORCE.COM INC	8,995	188.49	1,695,467.55
SERVICENOW INC	2,033	425.19	864,411.27
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	2,725	29.72	80,987.00
SPLUNK INC	1,688	199.57	336,874.16
SQUARE INC - A	3,819	121.41	463,664.79
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,001	55.75	111,555.75
SYNOPSYS INC	1,626	193.37	314,419.62
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	447	426.07	190,453.29
TWILIO INC - A	1,283	248.29	318,556.07
TYLER TECHNOLOGIES INC	433	357.19	154,663.27
VERISIGN INC	1,141	208.53	237,932.73
VISA INC-CLASS A SHARES	18,183	195.15	3,548,412.45
VMWARE INC-CLASS A	730	140.82	102,798.60
WESTERN UNION CO	2,957	22.47	66,443.79
WIX.COM LTD	591	267.47	158,074.77
WORKDAY INC-CLASS A	1,806	182.78	330,100.68
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	1,174	246.56	289,461.44
AMPHENOL CORP-CL A	3,259	104.39	340,207.01
APPLE INC	46,585	370.46	17,257,879.10
ARISTA NETWORKS INC	519	236.81	122,904.39
ARROW ELECTRONICS INC	902	67.35	60,749.70
CDW CORP/DE	1,592	114.56	182,379.52
CISCO SYSTEMS INC	45,313	46.40	2,102,523.20
COGNEX CORP	1,928	64.22	123,816.16
CORNING INC	8,440	29.29	247,207.60
DELL TECHNOLOGIES -C	2,187	60.80	132,969.60
F5 NETWORKS INC	613	152.34	93,384.42
FLIR SYSTEMS INC	1,041	40.97	42,649.77

HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	14,447	9.62	138,980.14
HP INC	15,754	17.50	275,695.00
IPG PHOTONICS CORP	259	175.29	45,400.11
JUNIPER NETWORKS INC	2,337	24.48	57,209.76
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,082	96.85	201,641.70
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,879	141.73	266,310.67
NETAPP INC	2,471	43.20	106,747.20
SEAGATE TECHNOLOGY	2,020	48.04	97,040.80
TE CONNECTIVITY LTD	3,659	87.27	319,320.93
TRIMBLE INC	2,244	44.03	98,803.32
WESTERN DIGITAL CORP	2,541	42.85	108,881.85
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	603	269.98	162,797.94
AT&T INC	76,714	29.57	2,268,432.98
CENTURYLINK INC	7,172	10.09	72,365.48
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	22.46	29,332.76
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	22.11	77,451.33
T-MOBILE US INC	5,997	104.93	629,265.21
VERIZON COMMUNICATIONS INC	44,223	56.85	2,514,077.55
AES CORP	7,346	15.40	113,128.40
ALLIANT ENERGY CORP	2,711	53.12	144,008.32
AMEREN CORPORATION	2,709	79.52	215,419.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,339	88.05	470,098.95
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,977	144.52	285,716.04
ATMOS ENERGY CORP	1,353	103.00	139,359.00
CENTERPOINT ENERGY INC	3,952	19.74	78,012.48
CMS ENERGY CORP	3,133	63.53	199,039.49
CONSOLIDATED EDISON INC	3,643	75.58	275,337.94
DOMINION ENERGY INC	9,007	80.41	724,252.87
DTE ENERGY COMPANY	2,108	114.57	241,513.56
DUKE ENERGY CORP	7,883	82.79	652,633.57
EDISON INTERNATIONAL	3,980	56.02	222,959.60
ENTERGY CORP	2,195	102.66	225,338.70
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	45.70	112,650.50
EVERGY INC	2,522	64.06	161,559.32
EVERSOURCE ENERGY	3,590	89.48	321,233.20



EXELON CORP	10,548	37.80	398,714.40
FIRSTENERGY CORP	5,919	29.48	174,492.12
NEXTERA ENERGY INC	5,230	280.25	1,465,707.50
NISOURCE INC	4,230	24.54	103,804.20
NRG ENERGY INC	1,800	34.19	61,542.00
OGE ENERGY CORP	1,432	32.97	47,213.04
PINNACLE WEST CAPITAL	828	81.38	67,382.64
PPL CORP	8,432	25.71	216,786.72
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	5,507	52.27	287,850.89
SEMPRA ENERGY	3,167	125.62	397,838.54
SOUTHERN CO/THE	11,345	54.85	622,273.25
UGI CORP	1,566	32.83	51,411.78
VISTRA CORP	4,854	18.88	91,643.52
WEC ENERGY GROUP INC	3,432	93.59	321,200.88
XCEL ENERGY INC	5,688	67.88	386,101.44
ADVANCED MICRO DEVICES	12,498	69.40	867,361.20
ANALOG DEVICES INC	3,940	112.21	442,107.40
APPLIED MATERIALS INC	9,816	60.62	595,045.92
BROADCOM INC	4,260	305.79	1,302,665.40
INTEL CORP	45,561	50.59	2,304,930.99
KLA CORP	1,682	188.21	316,569.22
LAM RESEARCH CORP	1,557	345.72	538,286.04
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,213	34.99	252,382.87
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,911	67.13	195,415.43
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	2,575	100.21	258,040.75
MICRON TECHNOLOGY INC	11,877	50.02	594,087.54
NVIDIA CORP	6,520	407.78	2,658,725.60
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,992	115.75	346,324.00
ON SEMICONDUCTOR CORP	3,199	20.47	65,483.53
QORVO INC	1,251	111.92	140,011.92
QUALCOMM INC	12,193	88.89	1,083,835.77
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,831	131.61	240,977.91
TERADYNE INC	1,812	83.53	151,356.36
TEXAS INSTRUMENTS INC	9,960	129.63	1,291,114.80
XILINX INC	2,675	102.66	274,615.50

米ドル 小計		3,097,648		295,064,912.23 (31,223,769,012)
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	16.00	39,424.00
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	13,084	24.39	319,118.76
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	6.73	69,568.01
	ENBRIDGE INC	21,825	41.96	915,777.00
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	22.43	64,531.11
	INTER PIPELINE LTD	3,471	12.93	44,880.03
	KEYERA CORP	2,259	20.88	47,167.92
	PARKLAND CORP	1,790	34.77	62,238.30
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,181	33.39	206,383.59
	SUNCOR ENERGY INC	16,785	22.42	376,319.70
	TC ENERGY CORP	10,192	60.29	614,475.68
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,708	96.41	261,078.28
	B2GOLD CORP	10,119	8.76	88,642.44
	BARRICK GOLD CORP	19,312	38.18	737,332.16
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	44.28	74,080.44
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	4,287	12.06	51,701.22
	FRANCO-NEVADA CORP	2,082	212.99	443,445.18
	KINROSS GOLD CORP	10,281	11.30	116,175.30
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	64.74	203,348.34
	LUNDIN MINING CORP	7,300	7.96	58,108.00
	NUTRIEN LTD	6,406	44.00	281,864.00
	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	49.25	100,962.50
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	3,246	15.01	48,722.46
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,994	71.93	359,218.42
	YAMANA GOLD INC	9,288	8.47	78,669.36
	CAE INC	3,196	19.73	63,057.08
WSP GLOBAL INC	1,340	82.85	111,019.00	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,068	59.17	63,193.56	
THOMSON REUTERS CORP	1,971	91.62	180,583.02	
AIR CANADA	840	16.47	13,834.80	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	7,691	129.53	996,215.23	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,489	367.70	547,505.30	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,272	64.11	209,767.92	

GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	22.39	40,302.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	3,265	76.31	249,152.15
QUEBECOR INC -CL B	1,274	29.11	37,086.14
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	23.71	135,882.01
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	500	119.92	59,960.00
DOLLARAMA INC	3,451	47.29	163,197.79
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,538	45.83	437,126.54
EMPIRE CO LTD 'A'	864	34.75	30,024.00
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	69.13	146,140.82
METRO INC	2,930	58.36	170,994.80
WESTON (GEORGE) LTD	817	103.47	84,534.99
SAPUTO INC	1,654	32.12	53,126.48
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	22.88	74,977.76
CANOPY GROWTH CORP	1,137	22.12	25,150.44
CRONOS GROUP INC	1,000	8.48	8,480.00
BANK OF MONTREAL	6,950	73.73	512,423.50
BANK OF NOVA SCOTIA	13,091	55.55	727,205.05
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	4,853	93.38	453,173.14
NATIONAL BANK OF CANADA	3,743	62.09	232,402.87
ROYAL BANK OF CANADA	15,266	93.72	1,430,729.52
TORONTO-DOMINION BANK	19,449	60.58	1,178,220.42
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	14,601	44.97	656,606.97
CI FINANCIAL CORP	775	18.21	14,112.75
IGM FINANCIAL INC	81	33.24	2,692.44
ONEX CORPORATION	908	60.32	54,770.56
TMX GROUP LTD	540	140.85	76,059.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	425.35	138,664.10
GREAT-WEST LIFECO INC	1,846	23.91	44,137.86
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	44.73	56,091.42
INTACT FINANCIAL CORP	1,647	137.36	226,231.92
MANULIFE FINANCIAL CORP	21,582	18.68	403,151.76
POWER CORP OF CANADA	4,873	23.91	116,513.43
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,585	53.20	350,322.00
BLACKBERRY LTD	1,407	6.23	8,765.61
CGI INC	2,689	86.69	233,109.41

	CONSTELLATION SOFTWARE INC	221	1,546.32	341,736.72
	OPEN TEXT CORP	3,074	59.71	183,548.54
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,120	1,247.01	1,396,651.20
	BCE INC	1,116	55.88	62,362.08
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	4,128	54.33	224,274.24
	TELUS CORP	4,085	22.91	93,587.35
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	4,426	17.78	78,694.28
	ALTAGAS LTD	2,930	16.73	49,018.90
	ATCO LTD -CLASS I	863	40.51	34,960.13
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	33.43	32,995.41
	EMERA INC	2,818	54.27	152,932.86
	FORTIS INC	5,178	52.56	272,155.68
	HYDRO ONE LTD	2,283	27.67	63,170.61
	カナダドル 小計	394,066		19,466,015.76 (1,538,009,905)
ユーロ	ENI SPA	27,906	8.52	237,759.12
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	10.35	76,693.50
	NESTE OYJ	4,759	41.39	196,975.01
	OMV AG	1,475	29.56	43,601.00
	REPSOL SA	16,357	7.39	120,878.23
	TENARIS SA	5,062	5.63	28,509.18
	TOTAL SE	26,503	32.65	865,322.95
	VOPAK	762	47.57	36,248.34
	AIR LIQUIDE SA	5,102	139.10	709,688.20
	AKZO NOBEL	2,205	82.02	180,854.10
	ARCELORMITTAL	8,506	9.87	83,996.75
	ARKEMA	822	88.56	72,796.32
	BASF SE	10,010	52.20	522,522.00
	COVESTRO AG	1,223	35.95	43,966.85
	CRH PLC	8,512	32.81	279,278.72
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	24.42	43,785.06
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	56	37.84	2,119.04
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,382	52.28	72,250.96
	KONINKLIJKE DSM NV	1,888	130.30	246,006.40
	LANXESS AG	745	46.98	35,000.10

SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,286	27.00	61,722.00
SOLVAY SA	925	70.60	65,305.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	5,614	11.18	62,792.59
SYMRISE AG	1,484	107.25	159,159.00
THYSSENKRUPP AG	2,040	7.11	14,512.56
UMICORE	2,388	44.77	106,910.76
UPM-KYMMENE OYJ	6,116	24.63	150,637.08
VOESTALPINE AG	712	19.41	13,819.92
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	22.28	64,055.00
AIRBUS SE	6,372	63.93	407,361.96
ALSTOM	2,236	49.36	110,368.96
ANDRITZ AG	1,260	31.34	39,488.40
BOUYGUES SA	1,779	31.41	55,878.39
BRENTAG AG	1,535	54.60	83,811.00
CNH INDUSTRIAL NV	9,590	6.45	61,913.04
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	5,754	33.32	191,723.28
DASSAULT AVIATION SA	11	782.00	8,602.00
EIFFAGE	782	77.80	60,839.60
FERROVIAL SA	5,381	22.40	120,534.40
GEA GROUP AG	1,676	32.28	54,101.28
HOCHTIEF AG	17	78.00	1,326.00
KINGSPAN GROUP PLC	1,226	63.30	77,605.80
KION GROUP AG	740	70.00	51,800.00
KNORR-BREMSE AG	297	106.60	31,660.20
KONE OYJ-B	3,785	66.46	251,551.10
LEGRAND SA	2,956	70.38	208,043.28
LEONARDO SPA	3,148	6.14	19,341.31
MTU AERO ENGINES AG	622	147.60	91,807.20
PRYSMIAN SPA	2,867	22.85	65,510.95
SAFRAN SA	3,499	88.54	309,801.46
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,966	99.18	591,707.88
SIEMENS AG-REG	8,245	112.20	925,089.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	19.08	43,780.99
THALES SA	1,244	66.80	83,099.20
VINCI SA	5,581	79.40	443,131.40

WARTSILA OYJ ABP	2,705	7.45	20,157.66
BUREAU VERITAS SA	2,067	20.20	41,753.40
RANDSTAD NV	825	43.14	35,590.50
TELEPERFORMANCE	652	237.60	154,915.20
WOLTERS KLUWER	2,960	67.36	199,385.60
ADP	314	91.00	28,574.00
AENA SME SA	754	116.00	87,464.00
ATLANTIA SPA	3,792	13.57	51,457.44
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	8.20	11,537.40
DEUTSCHE POST AG-REG	10,833	34.70	375,905.10
FRAPORT AG FRANKFURT AIRPORT	385	35.94	13,836.90
GETLINK	4,655	13.30	61,911.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	3,692	60.45	223,181.40
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	46.96	29,068.24
CONTINENTAL AG	1,275	90.30	115,132.50
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,370	40.04	375,221.65
FAURECIA	800	34.75	27,800.00
FERRARI NV	1,388	154.50	214,446.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	12,480	9.07	113,268.48
MICHELIN (CGDE)	1,878	92.38	173,489.64
PEUGEOT SA	5,130	14.83	76,103.55
PIRELLI & C SPA	1,734	3.61	6,275.34
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	53.66	95,246.50
RENAULT SA	1,817	25.24	45,861.08
VALEO SA	2,418	22.68	54,840.24
VOLKSWAGEN AG	194	150.10	29,119.40
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,047	141.12	288,872.64
ADIDAS AG	2,090	239.50	500,555.00
ESSILORLUXOTTICA	3,129	114.80	359,209.20
HERMES INTERNATIONAL	353	741.60	261,784.80
KERING	831	495.00	411,345.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	2,986	399.10	1,191,712.60
MONCLER SPA	2,414	33.62	81,158.68
PUMA SE	750	66.70	50,025.00
SEB SA	151	146.40	22,106.40

ACCOR SA	2,330	22.62	52,704.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,706	126.00	214,956.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	27.24	21,955.44
SODEXO	1,088	60.24	65,541.12
ALTICE EUROPE NV	7,300	3.70	27,031.90
BOLLORE	3,240	2.95	9,583.92
JC DECAUX SA	60	15.15	909.00
PUBLICIS GROUPE	1,962	29.65	58,173.30
SCOUT24 AG	1,002	74.45	74,598.90
SES	2,232	6.13	13,686.62
TELENET GROUP HOLDING NV	192	36.48	7,004.16
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	71.04	77,788.80
VIVENDI	9,266	22.75	210,801.50
DELIVERY HERO SE	1,478	90.00	133,020.00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	11,861	22.88	271,379.68
JUST EAT TAKEAWAY	1,360	89.84	122,182.40
PROSUS NV	5,265	82.20	432,783.00
ZALANDO SE	1,415	63.36	89,654.40
CARREFOUR SA	7,042	13.55	95,419.10
CASINO GUICHARD PERRACHON	625	26.90	16,812.50
COLRUYT SA	290	49.05	14,224.50
JERONIMO MARTINS	2,258	14.37	32,458.75
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	11,963	25.00	299,075.00
METRO AG	1,970	8.63	17,005.04
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,347	46.96	392,016.85
DANONE	6,690	60.74	406,350.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	3,500	8.16	28,577.50
HEINEKEN HOLDING NV	1,282	74.80	95,893.60
HEINEKEN NV	2,819	82.88	233,638.72
KERRY GROUP PLC-A	1,722	108.70	187,181.40
PERNOD RICARD SA	2,311	144.25	333,361.75
REMY COINTREAU	264	135.00	35,640.00
BEIERSDORF AG	1,128	101.70	114,717.60
HENKEL AG & CO KGAA	966	75.60	73,029.60
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,965	85.82	168,636.30

L'OREAL	2,682	284.90	764,101.80
UNILEVER NV	15,554	50.54	786,099.16
BIOMERIEUX	402	129.30	51,978.60
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	88.15	21,596.75
DIASORIN SPA	256	162.70	41,651.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,391	76.50	182,911.50
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,660	44.24	206,158.40
KONINKLIJKE PHILIPS NV	9,839	44.60	438,868.59
ORPEA	501	108.00	54,108.00
SARTORIUS AG-VORZUG	339	327.00	110,853.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,563	43.82	68,498.47
BAYER AG-REG	10,613	60.76	644,845.88
EUROFINS SCIENTIFIC	153	554.80	84,884.40
GALAPAGOS NV	507	167.60	84,973.20
GRIFOLS SA	3,329	25.09	83,524.61
IPSEN	158	78.20	12,355.60
MERCK KGAA	1,467	111.80	164,010.60
ORION OYJ-CLASS B	739	43.40	32,072.60
QIAGEN N.V.	2,679	41.85	112,116.15
RECORDATI SPA	830	46.96	38,976.80
SANOFI	12,084	88.81	1,073,180.04
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	298	259.60	77,360.80
UCB SA	1,446	109.95	158,987.70
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	7.69	29,283.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	72,029	3.11	224,514.39
BANCO SANTANDER SA	178,371	2.12	379,216.74
BANKINTER SA	2,829	4.63	13,101.09
BNP PARIBAS	12,137	37.14	450,768.18
CAIXABANK S.A	25,249	2.10	53,199.64
COMMERZBANK AG	5,632	4.57	25,743.87
CREDIT AGRICOLE SA	10,156	8.90	90,469.64
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	21.10	82,733.10
FINECOBANK SPA	7,003	12.82	89,778.46
ING GROEP NV-CVA	42,087	6.39	268,978.01
INTESA SANPAOLO	162,128	1.81	294,327.17



KBC GROEP NV	2,393	52.52	125,680.36
MEDIOBANCA SPA	6,857	7.08	48,547.56
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	15.97	19,419.52
SOCIETE GENERALE SA	9,028	14.69	132,621.32
UNICREDIT SPA	23,350	8.68	202,701.35
AMUNDI SA	618	70.90	43,816.20
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	22,388	8.24	184,544.28
DEUTSCHE BOERSE AG	2,100	166.50	349,650.00
EURAZEO	403	45.66	18,400.98
EXOR NV	1,318	49.55	65,306.90
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,384	75.00	103,800.00
NATIXIS	3,105	2.21	6,874.47
SOFINA	168	233.00	39,144.00
WENDEL	294	80.45	23,652.30
AEGON NV	16,557	2.65	43,876.05
AGEAS	1,697	33.05	56,085.85
ALLIANZ SE-REG	4,511	183.76	828,941.36
ASSICURAZIONI GENERALI	10,310	13.59	140,112.90
AXA SA	21,127	17.90	378,342.31
CNP ASSURANCES	1,015	10.54	10,698.10
HANNOVER RUECK SE	718	151.70	108,920.60
MAPFRE SA	942	1.64	1,544.88
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,592	233.60	371,891.20
NN GROUP NV	2,804	31.94	89,559.76
POSTE ITALIANE SPA	5,374	8.14	43,787.35
SAMPO OYJ-A SHS	5,388	32.77	176,564.76
SCOR SE	1,565	23.50	36,777.50
AROUNDTOWN SA	10,475	4.92	51,557.95
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,021	40.87	164,338.27
LEG IMMOBILIEN AG	667	116.60	77,772.20
VONOVIA SE	5,762	54.42	313,568.04
ADYEN NV	195	1,355.00	264,225.00
AMADEUS IT GROUP SA	4,673	46.23	216,032.79
ATOS SE	1,004	75.00	75,300.00
CAPGEMINI SA	1,778	104.00	184,912.00

DASSAULT SYSTEMES SA	1,443	145.80	210,389.40
EDENRED	2,756	43.30	119,334.80
NEMETSCHKE SE	536	62.75	33,634.00
NEXI SPA	3,732	14.97	55,886.70
SAP SE	11,190	135.44	1,515,573.60
TEAMVIEWER AG	1,207	45.82	55,304.74
WORLDFINE SA	1,544	73.74	113,854.56
INGENICO GROUP	708	138.50	98,058.00
NOKIA OYJ	63,040	3.72	234,760.96
CELLNEX TELECOM SA	2,835	58.42	165,620.70
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	36,498	14.90	543,820.20
ELISA OYJ	1,241	52.50	65,152.50
ILIAD SA	98	176.40	17,287.20
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	8.97	22,186.20
KONINKLIJKE KPN NV	41,469	2.39	99,359.72
ORANGE	22,373	10.64	238,048.72
PROXIMUS	918	17.98	16,510.23
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.38	27,498.76
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.37	26,968.62
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.48	31,325.52
TELEFONICA SA	54,127	3.86	209,254.98
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	39.58	30,318.28
(Right)EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL-RTS	23,881	0.10	2,390.48
E.ON SE	24,963	10.34	258,117.42
EDF	6,102	9.48	57,846.96
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	23,881	4.44	106,246.56
ELIA GROUP SA/NV	345	94.30	32,533.50
ENAGAS SA	2,667	22.00	58,674.00
ENDESA SA	3,177	23.88	75,866.76
ENEL SPA	87,598	7.94	695,878.51
ENGIE	20,132	10.92	219,841.44
FORTUM OYJ	3,981	18.03	71,777.43
IBERDROLA SA	63,685	11.04	703,400.82
NATURGY ENERGY GROUP SA	2,145	16.65	35,724.97
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.86	82,732.02

	RWE AG	6,560	32.89	215,758.40
	SNAM SPA	23,547	4.62	108,951.96
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	2,245	10.26	23,044.92
	TERNA SPA	16,305	6.29	102,656.28
	UNIPER SE	1,464	29.94	43,832.16
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	6,127	19.65	120,395.55
	VERBUND AG	797	44.60	35,546.20
	ASML HOLDING NV	4,536	322.55	1,463,086.80
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	13,665	21.68	296,257.20
	STMICROELECTRONICS NV	6,064	25.89	156,996.96
	ユーロ 小計	1,963,957		40,436,050.71 (5,001,939,472)
英債券	BP PLC	217,822	2.98	649,327.38
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	44,346	12.42	551,043.39
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	40,202	11.93	479,690.26
	ANGLO AMERICAN PLC	13,552	19.56	265,158.43
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	10.29	44,452.80
	BHP GROUP PLC	23,014	17.09	393,493.37
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,494	57.26	85,546.44
	EVRAZ PLC	3,072	3.05	9,375.74
	GLENCORE PLC	111,426	1.82	203,686.72
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	22.90	41,288.70
	MONDI PLC	5,627	14.42	81,141.34
	RIO TINTO PLC	12,131	47.47	575,919.22
	ASHTREAD GROUP PLC	4,156	25.81	107,266.36
	BAE SYSTEMS PLC	35,791	4.77	171,045.18
	BUNZL PLC	3,344	22.33	74,671.52
	DCC PLC	823	70.08	57,675.84
	FERGUSON PLC	2,523	69.92	176,408.16
	MELROSE INDUSTRIES PLC	44,562	1.04	46,500.44
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	22,239	2.68	59,622.75
	SMITHS GROUP PLC	3,824	14.36	54,912.64
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	105.05	89,082.40
	EXPERIAN PLC	9,883	27.76	274,352.08
	INTERTEK GROUP PLC	1,825	54.16	98,842.00

RELX PLC	20,911	16.71	349,422.81
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.44	113,656.17
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	5.18	62,883.74
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	44.52	66,690.96
BURBERRY GROUP PLC	3,298	13.08	43,154.33
PERSIMMON PLC	3,796	24.63	93,495.48
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.30	56,384.90
COMPASS GROUP PLC	19,967	11.20	223,630.40
GVC HOLDINGS PLC	6,950	7.41	51,541.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,670	37.68	62,925.60
WHITBREAD PLC	1,474	22.90	33,754.60
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.27	59,764.96
INFORMA PLC	17,619	4.00	70,634.57
ITV PLC	42,960	0.61	26,394.62
PEARSON PLC	7,332	5.44	39,930.07
WPP PLC	14,514	6.17	89,609.43
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	5.98	29,700.48
KINGFISHER PLC	12,732	2.48	31,613.55
NEXT PLC	1,278	51.46	65,765.88
OCADO GROUP PLC	4,239	20.83	88,298.37
SAINSBURY (J) PLC	9,573	1.91	18,289.21
TESCO PLC	107,991	2.20	238,336.13
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.88	43,278.04
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,281	18.33	60,157.13
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	24,652	26.92	663,631.84
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	20.59	37,803.24
DIAGEO PLC	25,139	27.96	702,886.44
IMPERIAL BRANDS PLC	10,573	13.95	147,546.21
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,596	77.12	585,803.52
UNILEVER PLC	12,511	46.78	585,264.58
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	9,733	16.11	156,798.63
ASTRAZENECA PLC	14,047	86.52	1,215,346.44
GLAXOSMITHKLINE PLC	53,822	15.80	850,495.24
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	21.52	29,095.04

	BARCLAYS PLC	189,992	1.13	215,830.91	
	HSBC HOLDINGS PLC	217,809	3.64	794,676.13	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	768,979	0.29	228,348.31	
	NATWEST GROUP PLC	42,392	1.15	48,750.80	
	STANDARD CHARTERED PLC	30,372	4.26	129,475.83	
	3I GROUP PLC	8,862	8.70	77,099.40	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	17.07	52,386.10	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	3,469	83.68	290,285.92	
	M&G PLC	21,579	1.62	35,152.19	
	SCHRODERS PLC	1,161	29.60	34,365.60	
	ST JAMES'S PLACE PLC	3,582	9.52	34,129.29	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	18,736	2.59	48,563.71	
	ADMIRAL GROUP PLC	1,104	23.46	25,899.84	
	AVIVA PLC	45,209	2.81	127,037.29	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	7,462	2.93	21,871.12	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	67,979	2.16	147,310.49	
	PRUDENTIAL PLC	28,477	11.50	327,485.50	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	9,396	4.41	41,445.75	
	AVEVA GROUP PLC	700	41.15	28,805.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	9,110	7.48	68,161.02	
	HALMA PLC	4,416	22.30	98,476.80	
	BT GROUP PLC	82,529	1.12	92,721.33	
	VODAFONE GROUP PLC	294,236	1.22	359,438.69	
	NATIONAL GRID PLC	38,223	9.03	345,153.69	
	SEVERN TRENT PLC	2,734	24.22	66,217.48	
	SSE PLC	11,557	13.28	153,476.96	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	8.82	69,120.37	
	英ポンド 小計	3,088,056		15,546,172.49	(2,109,149,221)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	580	18.15	10,527.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	797.50	62,205.00	
	GIVAUDAN-REG	101	3,768.00	380,568.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD-REG	5,780	44.10	254,898.00	
	SIKA AG-REG	1,557	203.00	316,071.00	
	ABB LTD-REG	19,969	23.78	474,862.82	

GEBERIT AG-REG	411	506.20	208,048.20	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	231.00	49,665.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	231.10	106,999.30	
ADECCO SA-REG	1,516	45.77	69,387.32	
SGS SA-REG	67	2,423.00	162,341.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	609	159.70	97,257.30	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5,752	59.02	339,483.04	
SWATCH GROUP AG/THE-BR	198	188.70	37,362.60	
SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	36.26	9,101.26	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	21	1,911.00	40,131.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	8	7,190.00	57,520.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	78,900.00	78,900.00	
NESTLE SA-REG	31,738	109.48	3,474,676.24	
ALCON INC	5,350	55.10	294,785.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	614	203.80	125,133.20	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	917.00	106,372.00	
LONZA GROUP AG-REG	806	563.20	453,939.20	
NOVARTIS AG-REG	22,944	78.07	1,791,238.08	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	7,497	318.90	2,390,793.30	
VIFOR PHARMA AG	329	134.15	44,135.35	
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	97.00	26,481.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	26,865	9.82	263,868.03	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,587	41.45	107,231.15	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	211	889.60	187,705.60	
UBS GROUP AG-REG	39,921	11.26	449,710.06	
BALOISE HOLDING AG - REG	344	142.30	48,951.20	
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	348.50	128,248.00	
SWISS RE AG	3,271	74.44	243,493.24	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,622	347.70	563,969.40	
SWISS PRIME SITE-REG	620	83.30	51,646.00	
TEMENOS GROUP AG-REG	737	146.20	107,749.40	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	1,569	63.70	99,945.30	
SWISSCOM AG-REG	301	494.10	148,724.10	
スイスフラン 小計	185,660		13,864,122.69 (1,595,344,597)	

スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	221.00	242,879.00	
	BOLIDEN AB	1,948	245.00	477,260.00	
	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	6,034	105.90	639,000.60	
	ALFA LAVAL AB	2,277	217.30	494,792.10	
	ASSA ABLOY AB-B	11,374	202.70	2,305,509.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	7,490	400.20	2,997,498.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	3,771	350.50	1,321,735.50	
	EPIROC AB-A	5,706	124.05	707,829.30	
	EPIROC AB-B	4,649	121.10	562,993.90	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	179.50	262,788.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	3,084	216.00	666,144.00	
	SANDVIK AB	12,786	168.00	2,148,048.00	
	SKANSKA AB-B SHS	2,462	183.40	451,530.80	
	SKF AB-B SHARES	4,538	168.05	762,610.90	
	VOLVO AB-B SHS	16,718	157.65	2,635,592.70	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	129.65	496,948.45	
	ELECTROLUX AB-SER B	1,532	167.25	256,227.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	81.12	230,137.44	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,225	603.00	738,675.00	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	135.00	1,294,785.00	
	ICA GRUPPEN AB	510	431.40	220,014.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	679.80	1,358,920.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,724	287.30	1,931,805.20	
	NORDEA BANK ABP	36,261	71.04	2,575,981.44	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	18,719	88.26	1,652,138.94	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	17,862	86.08	1,537,560.96	
	SWEDBANK AB - A SHARES	10,556	145.96	1,540,753.76	
	EQT AB	2,344	205.80	482,395.20	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	633	218.80	138,500.40	
	INVESTOR AB-B SHS	5,160	522.80	2,697,648.00	
	KINNEVIK AB - B	2,331	305.80	712,819.80	
LUNDBERGS AB-B SHS	920	419.80	386,216.00		
ERICSSON LM-B SHS	32,774	100.65	3,298,703.10		
HEXAGON AB-B SHS	3,268	572.40	1,870,603.20		
TELE2 AB-B SHS	3,777	130.10	491,387.70		

	TELIA CO AB	31,100	35.52	1,104,672.00
	スウェーデンクローナ 小計	279,356		41,693,105.39 (501,151,126)
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	9,617	144.50	1,389,656.50
	NORSK HYDRO ASA	8,106	26.74	216,754.44
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,707	377.80	644,904.60
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	288.60	159,307.20
	MOWI ASA	5,643	167.55	945,484.65
	ORKLA ASA	6,749	87.78	592,427.22
	DNB ASA	9,301	144.50	1,343,994.50
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	190.30	508,862.20
	TELENOR ASA	9,278	149.15	1,383,813.70
	ノルウェークローネ 小計	53,627		7,185,205.01 (83,563,934)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	722.20	879,639.60
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,451	387.00	948,537.00
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,207	848.00	1,871,536.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	7,780.00	303,420.00
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	74	8,390.00	620,860.00
	DSV PANALPINA A S	2,319	863.20	2,001,760.80
	PANDORA A/S	1,082	400.40	433,232.80
	CARLSBERG AS-B	1,203	935.00	1,124,805.00
	AMBU A/S-B	1,526	219.50	334,957.00
	COLOPLAST-B	1,315	1,058.00	1,391,270.00
	DEMANT A/S	550	195.30	107,415.00
	GN STORE NORD A/S	1,197	380.40	455,338.80
	GENMAB A/S	717	2,234.00	1,601,778.00
	H LUNDBECK A/S	120	223.50	26,820.00
	NOVO NORDISK A/S-B	18,959	424.35	8,045,251.65
	DANSKE BANK A/S	6,042	105.95	640,149.90
TRYG A/S	694	191.70	133,039.80	
ORSTED A/S	2,091	905.20	1,892,773.20	
	デンマーククローネ 小計	43,804		22,812,584.55 (379,145,155)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	27.53	82,920.36
	OIL SEARCH LTD	14,702	3.14	46,164.28



ORIGIN ENERGY LTD	14,373	5.71	82,069.83
SANTOS LTD	14,669	5.58	81,853.02
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	20.28	7,239.96
WOODSIDE PETROLEUM LTD	8,473	20.99	177,848.27
BHP GROUP LTD	31,786	37.08	1,178,624.88
BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	11.75	73,508.00
EVOLUTION MINING LTD	16,140	5.82	93,934.80
FORTESCUE METALS GROUP LTD	19,086	16.29	310,910.94
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	3,901	28.37	110,671.37
NEWCREST MINING LTD	9,074	34.60	313,960.40
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	7,377	15.50	114,343.50
ORICA LTD	2,575	17.34	44,650.50
RIO TINTO LTD	4,114	102.92	423,412.88
SOUTH32 LTD	38,772	2.19	84,910.68
CIMIC GROUP LTD	682	22.64	15,440.48
BRAMBLES LTD	17,428	10.67	185,956.76
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	4.66	107,347.76
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	3.64	31,668.00
SYDNEY AIRPORT	12,027	5.40	64,945.80
TRANSURBAN GROUP	30,019	13.70	411,260.30
ARISTOCRAT LEISURE LTD	6,885	25.99	178,941.15
CROWN RESORTS LTD	773	9.07	7,011.11
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	3.64	77,288.12
REA GROUP LTD	563	107.32	60,421.16
SEEK LTD	3,309	22.02	72,864.18
WESFARMERS LTD	12,403	46.36	575,003.08
COLES GROUP LTD	15,036	17.78	267,340.08
WOOLWORTHS GROUP LTD	13,807	38.63	533,364.41
COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	8.83	45,642.27
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	11.14	78,537.00
COCHLEAR LTD	742	193.96	143,918.32
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,421	63.41	90,105.61
SONIC HEALTHCARE LTD	5,181	32.05	166,051.05
CSL LTD	4,873	277.02	1,349,918.46
AUST AND NZ BANKING GROUP	30,789	18.29	563,130.81

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	18,999	72.86	1,384,267.14	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	34,635	17.98	622,737.30	
	WESTPAC BANKING CORP	39,063	17.76	693,758.88	
	AMP LTD	36,656	1.71	62,681.76	
	ASX LTD	2,263	83.44	188,824.72	
	MACQUARIE GROUP LTD	3,726	125.79	468,693.54	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	58.56	91,177.92	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	19,356	5.32	102,973.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.95	99,173.10	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	17,256	10.40	179,462.40	
	SUNCORP GROUP LTD	11,553	8.98	103,745.94	
	LENDLEASE GROUP	8,292	11.93	98,923.56	
	AFTERPAY LTD	2,039	69.81	142,342.59	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	13.51	75,710.04	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	20.74	33,184.00	
	TELSTRA CORP LTD	50,525	3.33	168,248.25	
	TPG TELECOM LTD	287	8.02	2,301.74	
	AGL ENERGY LTD	7,599	17.23	130,930.77	
	APA GROUP	13,816	11.11	153,495.76	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.76	2,529.12	
	オーストラリアドル 小計	725,674		13,058,342.03 (984,207,238)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	8,112	6.34	51,430.08	
	A2 MILK CO LTD	7,857	20.84	163,739.88	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	35.24	233,852.64	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	13.35	73,505.10	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.85	111,147.45	
	MERCURY NZ LTD	7,200	4.69	33,768.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	9,402	4.75	44,659.50	
	ニュージーランドドル 小計	67,630		712,102.65 (50,160,510)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	31,500	49.80	1,568,700.00	
	NWS HOLDINGS LTD	10,000	6.59	65,900.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	16,500	82.10	1,354,650.00	
	MTR CORP	19,500	38.30	746,850.00	

	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	26,000	50.05	1,301,300.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	29.25	906,750.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	8.27	16,540.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	12.98	67,496.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	23.75	522,500.00	
	WH GROUP LTD	91,500	6.79	621,285.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	17.58	63,288.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	21.90	963,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	9,000	124.30	1,118,700.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	13,200	360.40	4,757,280.00	
	AIA GROUP LTD	130,600	71.90	9,390,140.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	26,000	43.30	1,125,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	19.02	513,540.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	28.60	397,997.60	
	KERRY PROPERTIES LTD	500	18.50	9,250.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	15,000	37.25	558,750.00	
	SINO LAND CO	18,000	9.34	168,120.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	15,700	92.45	1,451,465.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	38.10	160,020.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	17.52	87,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	28.00	644,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	11.50	379,500.00	
	PCCW LTD	4,000	4.36	17,440.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	38.30	168,520.00	
	CLP HOLDINGS LTD	16,000	71.50	1,144,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.95	246,450.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	104,874	11.04	1,157,808.96	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	42.35	762,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	98.05	156,880.00	
	香港ドル 小計	816,790		32,614,420.56 (445,186,840)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.71	108,490.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.25	39,000.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,500	0.92	1,387.50	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	9,600	3.62	34,752.00	

	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.75	60,600.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	100	20.00	2,000.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.29	108,108.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	19,900	20.64	410,736.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	37,200	8.98	334,056.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	13,400	20.23	271,082.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	8.32	95,680.00	
	CAPITALAND LTD	21,200	2.82	59,784.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	8.26	24,780.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	6.67	14,007.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	16.98	69,618.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	80,700	2.48	200,136.00	
	シンガポールドル 小計	341,300		1,834,216.50 (140,592,694)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	4,122	11.06	45,589.32	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	463.00	176,403.00	
	BANK HAPOLIM BM	9,996	19.83	198,220.68	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	17.19	308,113.56	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	10.63	79,926.97	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	70.58	99,800.12	
	AZRIELI GROUP	234	158.80	37,159.20	
	NICE SYSTEMS LTD	731	675.90	494,082.90	
	イスラエルシュケル 小計	42,321		1,439,295.75 (44,632,561)	
	合 計	11,099,889		44,096,852,265 (44,096,852,265)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	4,823	65,206.96	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,379	232,430.45	
		AMERICAN TOWER CORP	4,757	1,219,361.81	

ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	114,736.05	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,572	230,848.20	
BOSTON PROPERTIES INC	1,674	151,781.58	
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	99,199.24	
CROWN CASTLE INTL CORP	4,493	748,983.10	
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,875	422,596.25	
DUKE REALTY CORP	4,194	156,268.44	
EQUINIX INC	925	682,085.75	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,548	101,502.36	
EQUITY RESIDENTIAL	4,162	226,163.08	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	753	161,232.36	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,476	140,810.40	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	617	45,034.83	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	5,755	151,011.20	
HOST HOTELS & RESORTS INC	6,508	68,334.00	
INVITATION HOMES INC	4,955	136,411.15	
IRON MOUNTAIN INC	2,044	55,678.56	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	112,233.44	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,301	144,762.27	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	1,474	50,705.60	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	72,696.00	
PROLOGIS INC	7,985	797,781.35	
PUBLIC STORAGE	1,734	321,414.24	
REALTY INCOME CORP	3,751	215,382.42	
REGENCY CENTERS CORP	1,514	60,499.44	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,229	367,077.72	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3,443	208,542.51	
SUN COMMUNITIES INC	1,063	150,818.44	
UDR INC	3,355	119,068.95	
VENTAS INC	4,246	151,879.42	
VEREIT INC	11,100	68,931.00	
VICI PROPERTIES INC	5,335	112,195.05	
VORNADO REALTY TRUST	1,259	44,077.59	
WELLTOWER INC	4,601	236,583.42	
WEYERHAEUSER CO	8,460	220,890.60	

	WP CAREY INC	1,458	96,811.20
	米ドル 小計	143,235	8,762,026.43 (927,197,636)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	45,182.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	1,901	25,055.18
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	22,812.30
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	53	1,075.37
	カナダドル 小計	4,434	94,124.85 (7,436,804)
ユーロ	COVIVIO	522	32,076.90
	GECINA SA	569	61,679.60
	ICADE	30	1,701.00
	KLEPIERRE	1,289	20,437.09
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,196	57,790.72
	ユーロ 小計	3,606	173,685.31 (21,484,872)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,737	20,567.14
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	36,138.52
	SEGRO PLC	13,859	128,195.75
	英ポンド 小計	26,244	184,901.41 (25,085,574)
オーストラリアドル	DEXUS	13,745	123,430.10
	GOODMAN GROUP	18,868	306,793.68
	GPT GROUP	15,542	64,033.04
	MIRVAC GROUP	32,387	67,688.83
	SCENTRE GROUP	51,996	109,711.56
	STOCKLAND	29,890	96,544.70
	VICINITY CENTRES	42,168	57,770.16
	オーストラリアドル 小計	204,596	825,972.07 (62,253,514)
香港ドル	LINK REIT	24,600	1,448,940.00
	香港ドル 小計	24,600	1,448,940.00 (19,778,031)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	143,724.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	25,500	43,860.00
	CAPITALAND MALL TRUST	22,000	43,560.00

	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	43,240.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	82,390.00	
	SUNTEC REIT	8,500	11,815.00	
	シンガポールドドル 小計	158,800	368,589.00 (28,252,346)	
	合計		1,091,488,777 (1,091,488,777)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 589銘柄	97.1%		69.1%
	投資証券 39銘柄		2.9%	2.1%
カナダドル	株式 81銘柄	99.5%		3.4%
	投資証券 4銘柄		0.5%	0.0%
ユーロ	株式 240銘柄	99.6%		11.1%
	投資証券 5銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式 85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%		3.5%
スウェーデンクローナ	株式 36銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 18銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	94.1%		2.2%
	投資証券 7銘柄		5.9%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 33銘柄	95.7%		1.0%
	投資証券 1銘柄		4.3%	0.0%
シンガポールドドル	株式 16銘柄	83.3%		0.3%
	投資証券 6銘柄		16.7%	0.1%
イスラエルシェケル	株式 8銘柄	100.0%		0.1%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）	
2020年 7月27日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	1,582,580,750
コール・ローン	33,558,014
株式	6,562,354,201
投資証券	5,606,676
派生商品評価勘定	180,252,524
未収入金	531,423
未収配当金	26,163,198
差入委託証拠金	492,748,714
流動資産合計	8,883,795,500
資産合計	8,883,795,500
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	684,865
未払解約金	2,756,000
未払利息	91
流動負債合計	3,440,956
負債合計	3,440,956
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	6,916,953,326
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,963,401,218
元本等合計	8,880,354,544
純資産合計	8,880,354,544
負債純資産合計	8,883,795,500

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	5,621,258,113円
期中追加設定元本額	9,872,215,520円
期中一部解約元本額	8,576,520,307円
期末元本額	6,916,953,326円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	467,124,977円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	986,354,630円
りそなラップ型ファンド(成長型)	967,570,455円
DCりそな グローバルバランス	9,331,064円
つみたてバランスファンド	299,837,531円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	245,415,727円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	120,602,466円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	71,930,092円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,798,132円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,027,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,428,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,317,501円
リスクコントロール・オープン	4,408,067円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	51,526,635円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,528,919,087円
Smart-i 新興国株式インデックス	896,443,719円
Smart-i 8資産バランス 安定型	29,007,992円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	86,519,492円
Smart-i 8資産バランス 成長型	100,907,658円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	291,379,776円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	210,003,653円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	132,897,894円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	85,578,569円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	273,245,665円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	44,385,757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）	991,375円
2. 計算日における受益権の総数	6,916,953,326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	1.2839円
(10,000口当たり純資産額)	(12,839円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 7月27日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		42,194,598
投資証券		2,759,435
合計		39,435,163

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2020年 7月27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	2,112,800,532	-	2,292,764,373	179,963,841
合計		2,112,800,532	-	2,292,764,373	179,963,841

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

(通貨関連)

(2020年 7月27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	28,864,757	-	28,467,194	397,563
	米ドル	19,457,277	-	19,197,194	260,083
	香港ドル	5,534,000	-	5,460,000	74,000
	南アフリカランド	3,873,480	-	3,810,000	63,480
	売建	47,000	-	45,619	1,381
	コロンビアペソ	43,574	-	42,244	1,330
	オフショア人民元	3,426	-	3,375	51
合計		28,911,757	-	28,512,813	396,182

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1)株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	62,002	5.14	319,186.29	
	INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	8,200	0.71	5,846.60	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	4,306	69.00	297,114.00	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	987	152.10	150,122.70	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	13,717	4.96	68,091.18	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	5.23	77,006.85	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	2,578	46.92	120,959.76	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	6.66	12,654.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	2,090	11.06	23,115.40	
	MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	3,150	7.09	22,333.50	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	6,724	26.43	177,715.32	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,251	20.06	25,095.06	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	1,201	12.04	14,460.04	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	723	104.70	75,698.10	
	SEVERSTAL - GDR REG S	1,901	12.40	23,572.40	
	SOUTHERN COPPER CORP	785	43.08	33,817.80	
	51JOB INC-ADR	300	66.48	19,944.00	
	BEST INC - ADR	1,500	4.16	6,240.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	3,900	34.88	136,032.00	
	NIO INC - ADR	9,400	11.82	111,108.00	
GSX TECHEDU INC- ADR	800	81.20	64,960.00		
HUAZHU GROUP LTD-ADR	1,400	33.56	46,984.00		

NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,450	138.05	200,172.50
TAL EDUCATION GROUP- ADR	3,900	75.74	295,386.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	3,650	52.64	192,136.00
58.COM INC-ADR	960	55.06	52,857.60
AUTOHOME INC-ADR	620	77.76	48,211.20
BAIDU INC - SPON ADR	2,750	119.02	327,305.00
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,000	40.10	40,100.00
HUYA INC-ADR	500	22.47	11,235.00
IQIYI INC-ADR	2,300	20.40	46,920.00
JOYY INC	620	76.60	47,492.00
MOMO INC-SPON ADR	1,350	17.61	23,773.50
NETEASE INC-ADR	782	448.33	350,594.06
SINA CORP	630	40.02	25,212.60
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	3,800	15.62	59,356.00
WEIBO CORP-SPON ADR	630	33.72	21,243.60
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	18,930	249.00	4,713,570.00
BAOZUN INC-SPN ADR	500	37.81	18,905.00
JD.COM INC-ADR	8,620	60.88	524,785.60
PINDUODUO INC-ADR	2,600	78.95	205,270.00
TRIP.COM GROUP LTD	4,950	27.10	134,145.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	4,600	20.43	93,978.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,288	15.66	67,150.08
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,456	38.74	56,405.44
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	600	25.80	15,480.00
ZAI LAB LTD-ADR	500	76.02	38,010.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	15,674	3.85	60,344.90
CREDICORP LTD	644	127.27	81,961.88
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	28,306	12.02	340,379.65
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.00	22,256.71
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	29.54	14,770.00
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.83	8,406.72
GDS HOLDINGS LTD - ADR	800	78.15	62,520.00
GLOBANT SA	340	164.69	55,994.60
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,500	8.91	49,005.00
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	10.05	8,743.50

	米ドル 小計	300,327		10,146,134.14 (1,073,663,914)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	142,300	6.24	887,952.00
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	32,300	58.98	1,905,054.00
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,375	315.06	433,207.50
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	7,800	34.21	266,838.00
	ALFA S.A.B.-A	34,600	11.14	385,444.00
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	3,400	44.67	151,878.00
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	3,700	145.54	538,498.00
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	2,070	219.86	455,110.20
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	159.92	439,780.00
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	26,000	23.65	614,900.00
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	70.01	154,022.00
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	53,400	56.49	3,016,566.00
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	108.60	521,280.00
	BEACLE SAB DE CV	5,300	43.21	229,013.00
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	5,600	92.96	520,576.00
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	19,800	134.00	2,653,200.00
	GRUMA S.A.B.-B	2,115	260.27	550,471.05
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	15,000	38.94	584,100.00
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	35.27	581,955.00
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	26,700	79.78	2,130,126.00
GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	17,800	15.94	283,732.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	341,600	14.64	5,001,024.00	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	62.62	388,244.00	
	メキシコペソ 小計	773,310		22,692,970.75 (108,018,540)
ブラジルリアル	COSAN SA	1,200	82.44	98,928.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	37,700	23.33	879,541.00
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	48,200	22.73	1,095,586.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	7,600	19.15	145,540.00
	BRASKEM SA-PREF A	2,300	24.14	55,522.00
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	7,300	11.61	84,753.00
	GERDAU SA-PREF	11,500	17.14	197,110.00
	KLABIN SA - UNIT	7,400	21.45	158,730.00

SUZANO SA	5,007	42.30	211,796.10	
VALE SA	37,400	58.60	2,191,640.00	
WEG SA	8,650	66.71	577,041.50	
CCR SA	13,400	14.64	196,176.00	
LOCALIZA RENT A CAR	6,610	44.70	295,467.00	
RUMO SA	10,100	22.30	225,230.00	
COGNA EDUCACAO	18,400	8.28	152,352.00	
B2W CIA DIGITAL	2,100	121.59	255,339.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	9,200	35.53	326,876.00	
LOJAS RENNER S.A.	8,100	41.20	333,720.00	
MAGAZINE LUIZA SA	7,400	79.67	589,558.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	7,000	22.95	160,650.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.63	61,890.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	74.90	127,330.00	
RAIA DROGASIL SA	2,200	114.15	251,130.00	
AMBEV SA	47,800	14.93	713,654.00	
BRF SA	5,900	20.33	119,947.00	
JBS SA	9,700	22.07	214,079.00	
NATURA &CO HOLDING SA	7,000	42.60	298,200.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	2,400	65.69	157,656.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	5,000	68.06	340,300.00	
HYPERA SA	4,000	34.25	137,000.00	
BANCO BRADESCO S.A.	13,720	20.72	284,278.40	
BANCO BRADESCO SA-PREF	44,890	22.64	1,016,309.60	
BANCO DO BRASIL S.A.	8,900	33.95	302,155.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	29.03	127,732.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	49,000	26.47	1,297,030.00	
ITAUSA SA	45,100	10.45	471,295.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	21,200	65.35	1,385,420.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	2,600	86.92	225,992.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	7,300	28.00	204,400.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,200	8.34	43,368.00	
PORTO SEGURO SA	700	53.64	37,548.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	3,100	51.03	158,193.00	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	6,000	10.30	61,800.00	



	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	21.37	47,014.00	
	CIELO SA	11,700	5.27	61,659.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.-PREF	4,100	49.27	202,007.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	9,000	14.41	129,690.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	2,000	39.05	78,100.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	3,200	38.10	121,920.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	10,200	12.01	122,502.00	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	63.03	69,333.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	3,600	61.54	221,544.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	32.22	74,106.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	48.00	96,000.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	44.19	100,532.25	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	8,900	24.64	219,296.00	
	ブラジルリアル 小計	619,952		17,811,965.85	(360,336,069)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	4,205	6,200.00	26,071,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	10,523	1,700.00	17,889,100.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,062	23,370.00	24,818,940.00	
	FALABELLA SA	6,932	2,610.10	18,093,213.20	
	CENCOSUD SA	13,424	1,245.00	16,712,880.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	5,830.00	10,115,050.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,859.00	5,298,150.00	
	BANCO DE CHILE	481,649	73.55	35,425,283.95	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	565	27,990.00	15,814,350.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	716,617	32.70	23,433,375.90	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,389.90	7,234,429.50	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	1,858	5,490.00	10,200,420.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	18,006	269.13	4,845,954.78	
	COLBUN SA	83,944	136.50	11,458,356.00	
	ENEL AMERICAS SA	362,665	119.01	43,160,761.65	
	ENEL CHILE SA	262,172	61.13	16,026,574.36	
	チリペソ 小計	1,973,412		286,597,839.34	(39,091,945)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	49,667	2,220.00	110,260,740.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	25,480.00	64,770,160.00	

	BANCOLOMBIA SA-PREF	4,580	25,700.00	117,706,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	20,180.00	52,225,840.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	4,890	19,800.00	96,822,000.00	
	コロンビアペソ 小計	64,267		441,784,740.00 (12,635,043)	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	784	12.12	9,502.08	
	OPAP SA	2,135	8.02	17,122.70	
	JUMBO SA	765	16.73	12,798.45	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	2,534	12.64	32,029.76	
	ユーロ 小計	6,218		71,452.99 (8,838,734)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	917	87.35	80,099.95	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	16,119	8.37	134,916.03	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	3,955	35.08	138,741.40	
	KOC HOLDING AS	8,691	17.45	151,657.95	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	1,500	17.92	26,880.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	11.74	64,570.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	77.50	41,152.50	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	4,769	73.85	352,190.65	
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	1,920	20.70	39,744.00	
	AKBANK T.A.S.	29,649	5.78	171,371.22	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	21,853	7.91	172,857.23	
	TURKIYE IS BANKASI-C	12,100	5.29	64,009.00	
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.36	69,884.32	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	9.13	110,098.67	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	11,983	16.06	192,446.98	
	トルコリラ 小計	161,158		1,810,619.90 (27,974,077)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	550.00	411,950.00	
	MONETA MONEY BANK AS	3,886	53.30	207,123.80	
	CEZ AS	1,547	465.00	719,355.00	
	チェココルナ 小計	6,182		1,338,428.80 (6,303,999)	
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	3,029	1,729.00	5,237,141.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	1,497	6,455.00	9,663,135.00	

	OTP BANK PLC	2,319	11,000.00	25,509,000.00	
	ハンガリーフォリント 小計	6,845		40,409,276.00	(14,458,438)
ポーランドズロチ	GRUPA LOTOS SA	682	51.58	35,177.56	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	2,810	57.82	162,474.20	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	19,031	5.36	102,044.22	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,355	119.20	161,516.00	
	LPP SA	14	6,210.00	86,940.00	
	CD PROJEKT SA	697	388.00	270,436.00	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	29.30	93,525.60	
	DINO POLSKA SA	528	200.00	105,600.00	
	BANK PEKAO SA	1,997	54.88	109,595.36	
	MBANK SA	165	206.00	33,990.00	
	PKO BANK POLSKI SA	9,155	23.10	211,480.50	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	265	161.40	42,771.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	5,729	28.25	161,844.25	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.97	32,775.52	
	PGE SA	9,929	7.34	72,958.29	
	ポーランドズロチ 小計	60,248		1,683,128.50	(47,295,910)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	12,000	6.24	74,880.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	250,000	3.45	862,500.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	35,500	13.12	465,760.00	
	CNOOC LTD	182,000	8.52	1,550,640.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-H	10,000	3.55	35,500.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	220,000	2.86	629,200.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	5.97	83,580.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	30,000	1.97	59,100.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	13,000	57.10	742,300.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	13,000	4.55	59,150.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	27,000	2.97	80,190.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	42,000	9.10	382,200.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	28,000	10.10	282,800.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	9.12	136,800.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	10,000	4.67	46,700.00	

NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	7.55	151,000.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	34,000	1.78	60,520.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	10.02	130,260.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	54,000	4.68	252,720.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	26,000	4.45	115,700.00	
BOC AVIATION LTD	2,200	45.95	101,090.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	42,000	4.43	186,060.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	4.97	139,160.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	17,000	33.65	572,050.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	14.08	183,040.00	
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H	23,500	6.20	145,700.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	4.06	178,640.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	16,000	4.70	75,200.00	
CITIC LTD	62,000	7.30	452,600.00	
CRRG CORP LTD - H	51,000	3.43	174,930.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	24,500	9.45	231,525.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	17.50	140,000.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	20,000	2.36	47,200.00	
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	4,000	11.40	45,600.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	17,500	3.75	65,625.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	23.85	190,800.00	
WEICHAO POWER CO LTD-H	19,000	16.90	321,100.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	6,000	6.70	40,200.00	
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRI-H	6,700	26.80	179,560.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	10,400	7.97	82,888.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD-H	4,750	45.50	216,125.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	41,000	4.46	182,860.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	14,000	43.85	613,900.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	10,000	10.68	106,800.00	
AIR CHINA LTD-H	18,000	4.72	84,960.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.32	106,400.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	14,000	2.76	38,640.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	8.86	159,480.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	12,000	3.56	42,720.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	18,500	2.70	49,950.00	

COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	4.10	73,800.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	12,000	8.72	104,640.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY CO-H	4,000	7.29	29,160.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	10,500	12.64	132,720.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	5.84	105,120.00	
BAIC MOTOR CORP LTD-H	12,500	3.79	47,375.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.69	261,460.00	
BYD CO LTD-H	6,000	72.45	434,700.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	5.07	162,240.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	5,200	22.30	115,960.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	61,000	15.88	968,680.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	35,000	8.16	285,600.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	28,000	6.24	174,720.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	11,000	70.75	778,250.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	24,000	2.11	50,640.00	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	14,000	24.80	347,200.00	
LI NING CO LTD	22,000	24.80	545,600.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	8,500	91.00	773,500.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	18.68	112,080.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	4,000	13.50	54,000.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.11	85,320.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	8,000	35.10	280,800.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	37.10	92,750.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.11	155,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	2,800	51.55	144,340.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	57,700	528.00	30,465,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	72,000	1.10	79,200.00	
MEITUAN DIANPING-CLASS B	35,900	190.70	6,846,130.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	8,400	13.40	112,560.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	9.04	126,560.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	6,000	46.70	280,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	25,500	11.18	285,090.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	79.15	87,065.00	
CHINA FEIHE LTD	9,000	15.58	140,220.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	28,000	34.65	970,200.00	

CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	16,000	51.60	825,600.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	14,500	4.67	67,715.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	18,000	13.52	243,360.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	4,000	65.50	262,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	8.20	123,000.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	53,000	5.79	306,870.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	5,000	93.70	468,500.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	7,000	66.95	468,650.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	28.90	115,600.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	24.90	99,600.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	38,000	20.85	792,300.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	3,900	117.20	457,080.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	24,000	19.24	461,760.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	6,400	13.40	85,760.00
SINOPHARM GROUP CO-H	12,400	18.64	231,136.00
3SBIO INC	13,000	9.98	129,740.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	215.00	129,000.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	9.47	151,520.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.36	47,960.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	3.93	94,320.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	58,000	15.34	889,720.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	10,000	16.84	168,400.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	6,000	36.00	216,000.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	10,000	50.05	500,500.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	4.73	82,775.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	35.85	215,100.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	107,250	9.94	1,066,065.00
SSY GROUP LTD	10,000	5.07	50,700.00
WUXI APPTec CO LTD-H	2,324	112.40	261,217.60
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	9,500	145.20	1,379,400.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	285,000	2.78	792,300.00
BANK OF CHINA LTD-H	806,000	2.64	2,127,840.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	92,000	4.35	400,200.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	96,000	3.39	325,440.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	971,000	5.86	5,690,060.00

CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	24,000	2.93	70,320.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	40,000	36.80	1,472,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	54,100	4.92	266,172.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.14	56,520.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	615,000	4.68	2,878,200.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	104,000	4.41	458,640.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.48	155,400.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	8,000	12.90	103,200.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	41,000	4.70	192,700.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.93	95,790.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	13,600	17.84	242,624.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	21,000	17.68	371,280.00
FAR EAST HORIZON LTD	17,000	6.66	113,220.00
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	9.06	141,336.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-H	7,600	13.16	100,016.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	30,400	7.06	214,624.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	13.70	238,380.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	76,000	18.00	1,368,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	28,800	22.65	652,320.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	55,000	0.85	46,750.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	17,800	14.02	249,556.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	9,000	30.95	278,550.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	92,000	2.48	228,160.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	72,000	6.13	441,360.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	60,000	83.40	5,004,000.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	3,600	42.30	152,280.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	10,000	9.80	98,000.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	9.60	134,400.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	20,000	20.65	413,000.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	56,000	5.14	287,840.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	39,500	23.60	932,200.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	8.40	126,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	32,000	33.15	1,060,800.00
CHINA VANKE CO LTD-H	17,900	25.10	449,290.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	30,000	6.60	198,000.00

COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	79,000	9.89	781,310.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	15,200	9.10	138,320.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	18,000	3.33	59,940.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	12.92	180,880.00	
LOGAN GROUP CO LTD	14,000	13.44	188,160.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	18,500	37.85	700,225.00	
POLY PROPERTY DEVELOPMENT -H	1,200	83.75	100,500.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	7.34	176,160.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	24,000	2.47	59,280.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	13,000	31.80	413,400.00	
SHUI ON LAND LTD	28,000	1.18	33,040.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	23,000	1.88	43,240.00	
SOHO CHINA LTD	12,000	2.91	34,920.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	26,000	35.40	920,400.00	
WHARF HOLDINGS LTD	14,000	13.08	183,120.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	52,000	1.46	75,920.00	
YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD	14,000	3.35	46,900.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.67	56,040.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	25,000	18.64	466,000.00	
KINGSOFT CORP LTD	8,000	35.75	286,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	9,000	13.52	121,680.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	7,000	57.45	402,150.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	5,000	22.20	111,000.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	15,000	3.45	51,750.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	5,000	22.35	111,750.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	8,000	8.32	66,560.00	
LEGEND HOLDINGS CORP-H	3,400	10.00	34,000.00	
LENOVO GROUP LTD	66,000	4.57	301,620.00	
SUNNY OPTICAL TECH	7,400	138.10	1,021,940.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	107,200	15.10	1,618,720.00	
ZTE CORP-H	8,800	22.15	194,920.00	
CHINA MOBILE LTD	62,000	53.50	3,317,000.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	142,000	2.29	325,180.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	460,000	1.42	653,200.00	
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	56,000	4.33	242,480.00	



	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	27.00	162,000.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.13	181,540.00	
	CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.63	179,300.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	27,400	23.40	641,160.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	38,000	4.51	171,380.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.43	84,370.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	10,000	37.95	379,500.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	20,000	9.63	192,600.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	8,300	92.35	766,505.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	32,000	13.04	417,280.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	30,000	3.34	100,200.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	38,000	6.51	247,380.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	28.35	141,750.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	34,000	25.65	872,100.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	42,000	8.24	346,080.00	
	香港ドル 小計	9,004,224		114,484,149.60	(1,562,708,642)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	36,700	3.79	139,093.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	20.62	59,798.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	22,500	6.26	140,850.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	4.70	78,490.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.45	72,450.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.62	65,512.00	
	IJM CORP BHD	20,200	1.65	33,330.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.13	70,503.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.20	67,080.00	
	MISC BHD	13,100	7.90	103,490.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	3.65	24,820.00	
	GENTING BHD	23,100	3.96	91,476.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.33	75,958.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA B	1,000	25.50	25,500.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	1,000	32.00	32,000.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	10.24	30,720.00	
	IOI CORP BHD	23,300	4.47	104,151.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	4,700	22.70	106,690.00	

	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	700	140.00	98,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	5,920	19.00	112,480.00	
	QL RESOURCES BHD	7,100	9.63	68,373.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	22,400	5.18	116,032.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	17,700	17.68	312,936.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	24,100	5.39	129,899.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	16,100	25.44	409,584.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	12,700	3.03	38,481.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	67,500	3.57	240,975.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	15.00	108,000.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	13.90	25,020.00	
	MALAYAN BANKING BHD	40,900	7.85	321,065.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	29,900	17.72	529,828.00	
	RHB BANK BHD	18,100	4.97	89,957.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.23	98,192.00	
	DIGI.COM BHD	28,400	4.19	118,996.00	
	MAXIS BHD	21,600	5.25	113,400.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	8,100	3.97	32,157.00	
	PETRONAS GAS BHD	7,500	16.28	122,100.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	24,300	11.24	273,132.00	
	YTL CORP BHD	19,380	0.74	14,438.10	
	マレーシアリングット 小計	694,000		4,694,956.10 (116,763,558)	
タイパーツ	IRPC PCL - NVDR	137,700	2.62	360,774.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	15,000	93.25	1,398,750.00	
	PTT PCL-NVDR	117,400	38.50	4,519,900.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	43.25	570,900.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	26.25	433,125.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	25,000	48.50	1,212,500.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	8,100	382.00	3,094,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	45,100	55.25	2,491,775.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	8.95	801,025.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	75,200	10.50	789,600.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.02	250,044.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	35,100	19.60	687,960.00	

	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	28.75	592,968.75	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	64,600	15.10	975,460.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	8,800	38.75	341,000.00	
	CP ALL PCL-NVDR	60,100	67.00	4,026,700.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	41,700	33.00	1,376,100.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	41.75	271,375.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	24,200	13.40	324,280.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	100,800	21.70	2,187,360.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	3,300	114.50	377,850.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	4,100	104.00	426,400.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	13,300	85.75	1,140,475.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.10	252,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	70.75	700,425.00	
	TMB BANK PCL-NVDR	215,000	1.02	219,300.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	24.40	446,520.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	32.50	266,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	51.00	387,600.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	51.75	465,750.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	20,800	49.00	1,019,200.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	7.55	727,820.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	12,500	185.00	2,312,500.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-F	18,400	56.75	1,044,200.00	
	TOTAL ACCESS COMM-FOREIGN	3,100	39.25	121,675.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.40	289,340.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	51.50	489,250.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	2,800	245.00	686,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	47.75	854,725.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	71.75	523,775.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	20,500	34.50	707,250.00	
	RATCH GROUP PCL-FOREIGN	3,200	62.50	200,000.00	
	タイパーツ 小計	1,578,525		40,364,851.75 (134,818,604)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	50.00	1,168,000.00	
	AYALA CORPORATION	2,690	742.00	1,995,980.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	700	437.80	306,460.00	

	JG SUMMIT HOLDINGS INC	27,220	65.00	1,769,300.00	
	SM INVESTMENTS CORP	2,595	900.50	2,336,797.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	97.00	1,134,900.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	4,500	128.50	578,250.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	48.00	456,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,750	122.00	1,189,500.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	6,630	69.50	460,785.00	
	BDO UNIBANK INC	21,220	93.05	1,974,521.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	13,312	36.05	479,897.60	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.15	456,750.00	
	AYALA LAND INC	85,400	32.50	2,775,500.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	3.07	300,860.00	
	ROBINSONS LAND CO	24,500	15.90	389,550.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	105,800	30.50	3,226,900.00	
	GLOBE TELECOM INC	250	2,090.00	522,500.00	
	PLDT INC	980	1,340.00	1,313,200.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	25.90	414,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	1,660	261.00	433,260.00	
	フィリピンベソ 小計	610,767		23,683,311.10 (50,919,118)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,090.00	164,481,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	12,700	19,450.00	247,015,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	254,100	1,175.00	298,567,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	7,675.00	206,457,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	13,300	12,225.00	162,592,500.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	9,275.00	298,655,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	208,300	5,050.00	1,051,915,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,640.00	82,000,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	78,300	6,000.00	469,800,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	3,300	47,700.00	157,410,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	91,100	1,685.00	153,503,500.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	17,300	9,175.00	158,727,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	6,475.00	312,095,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	78,700	8,050.00	633,535,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,570.00	355,605,000.00	

	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	100,000	30,500.00	3,050,000,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	191,200	5,600.00	1,070,720,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	78,800	4,610.00	363,268,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	563,900	3,090.00	1,742,451,000.00	
	TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER	508,200	3,020.00	1,534,764,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	28,000	2,760.00	77,280,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,220.00	160,430,000.00	
	インドネシアルピア 小計	2,893,400		12,751,272,500.00 (93,084,289)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	35,350.00	17,321,500.00	
	S-OIL CORP	483	61,700.00	29,801,100.00	
	SK INNOVATION CO LTD	573	132,000.00	75,636,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,199	25,950.00	31,114,050.00	
	HYUNDAI STEEL CO	787	25,450.00	20,029,150.00	
	KOREA ZINC CO LTD	93	395,500.00	36,781,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	89,300.00	19,467,400.00	
	LG CHEM LTD	469	516,000.00	242,004,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	253,500.00	22,308,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	188	173,000.00	32,524,000.00	
	POSCO	761	194,000.00	147,634,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	161	71,300.00	11,479,300.00	
	CJ CORP	193	85,200.00	16,443,600.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO LTD	313	86,500.00	27,074,500.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTRUCTION CO.	1,310	3,450.00	4,519,500.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	23,650.00	12,156,100.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	27,500.00	15,950,000.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	439	26,800.00	11,765,200.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	35,350.00	30,683,800.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	233,000.00	25,630,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	540	24,550.00	13,257,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	393	88,300.00	34,701,900.00	
	LG CORP	994	72,100.00	71,667,400.00	
	LOTTE CORP	242	31,750.00	7,683,500.00	
	POSCO INTERNATIONAL CORP	500	14,200.00	7,100,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	883	106,000.00	93,598,000.00	

SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	1,604	12,100.00	19,408,400.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	5,232	5,620.00	29,403,840.00	
SK HOLDINGS CO LTD	364	224,500.00	81,718,000.00	
S-1 CORPORATION	120	85,000.00	10,200,000.00	
CJ LOGISTICS	65	152,500.00	9,912,500.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	115,000.00	25,185,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	18,400.00	17,572,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	3,580.00	11,731,660.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	552	25,650.00	14,158,800.00	
HANON SYSTEMS	1,394	9,130.00	12,727,220.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	689	203,500.00	140,211,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,541	122,500.00	188,772,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	273	67,500.00	18,427,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	170	66,200.00	11,254,000.00	
KIA MOTORS CORP	2,715	36,900.00	100,183,500.00	
COWAY CO LTD	531	74,500.00	39,559,500.00	
FILA HOLDINGS CORP	364	33,800.00	12,303,200.00	
HLB INC	411	87,600.00	36,003,600.00	
LG ELECTRONICS INC	1,102	74,100.00	81,658,200.00	
KANGWON LAND INC	869	22,950.00	19,943,550.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	499	17,300.00	8,632,700.00	
KAKAO CORP	573	324,500.00	185,938,500.00	
NAVER CORP	1,247	281,000.00	350,407,000.00	
NCSOFT CORP	168	802,000.00	134,736,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	193	124,500.00	24,028,500.00	
PEARL ABYSS CORP	70	189,200.00	13,244,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	116,000.00	13,108,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	233	70,100.00	16,333,300.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	100	59,800.00	5,980,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	78,200.00	6,256,000.00	
SHINSEGAE INC	54	208,000.00	11,232,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	128,000.00	7,296,000.00	
E-MART INC	157	110,500.00	17,348,500.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	35,250.00	6,873,750.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	369,000.00	32,472,000.00	

KT&G CORP	1,195	80,400.00	96,078,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	133,000.00	33,383,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	552,000.00	7,176,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	302	163,500.00	49,377,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	209	53,400.00	11,160,600.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	96	1,323,000.00	127,008,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	15	698,000.00	10,470,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	708	102,300.00	72,428,400.00	
CELLTRION INC	956	319,000.00	304,964,000.00	
CELLTRION PHARM INC	150	126,700.00	19,005,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	46	250,000.00	11,500,000.00	
HELIXMITH CO LTD	165	56,900.00	9,388,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	169	755,000.00	127,595,000.00	
YUHAN CORP	514	56,500.00	29,041,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	2,545	5,080.00	12,928,600.00	
HANA FINANCIAL GROUP	3,100	28,850.00	89,435,000.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	8,250.00	21,375,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	4,037	35,400.00	142,909,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	4,683	30,500.00	142,831,500.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	5,693	8,800.00	50,098,400.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	317	50,200.00	15,913,400.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,145.00	7,286,965.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	2,997	7,530.00	22,567,410.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	8,630.00	13,290,200.00	
SAMSUNG CARD CO	217	28,100.00	6,097,700.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	28,800.00	23,731,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	482	45,800.00	22,075,600.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	451	23,150.00	10,440,650.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	322	177,000.00	56,994,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	752	46,300.00	34,817,600.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	190	105,500.00	20,045,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	366	170,500.00	62,403,000.00	
KMW CO LTD	187	71,900.00	13,445,300.00	
LG DISPLAY CO LTD	2,534	12,350.00	31,294,900.00	
LG INNOTEK CO LTD	153	156,000.00	23,868,000.00	

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	584	137,500.00	80,300,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	48,081	54,200.00	2,605,990,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	8,329	47,150.00	392,712,350.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	564	375,500.00	211,782,000.00	
	LG UPLUS CORP	2,330	11,300.00	26,329,000.00	
	SK TELECOM	213	208,000.00	44,304,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	2,411	19,500.00	47,014,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	225	25,500.00	5,737,500.00	
	SK HYNIX INC	5,510	83,700.00	461,187,000.00	
	韓国ウォン 小計	148,997		8,380,332,245.00 (741,659,403)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	10,000	84.70	847,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	22,000	41.85	920,700.00	
	CHINA STEEL CORP	120,000	20.15	2,418,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	36,000	69.80	2,512,800.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	39,000	79.70	3,108,300.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	52,000	63.10	3,281,200.00	
	TAIWAN CEMENT	47,121	45.00	2,120,445.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,000	559.00	559,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	25,000	29.20	730,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	2,111	304.50	642,799.50	
	CHINA AIRLINES LTD	17,000	7.98	135,660.00	
	EVA AIRWAYS CORP	26,023	11.00	286,253.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	10.70	337,585.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	34.60	761,200.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	15,000	34.50	517,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	326.00	658,520.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	3,400	177.00	601,800.00	
	FORMOSA TAFFETA CO., LTD.	10,000	31.25	312,500.00	
	GIANT MANUFACTURING	3,000	304.00	912,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	316.50	633,000.00	
	POU CHEN	24,000	29.30	703,200.00	
	TATUNG CO LTD	15,000	20.60	309,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	3,000	710.00	2,130,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	6,000	288.00	1,728,000.00	



STANDARD FOODS CORP	3,120	63.00	196,560.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	49,000	71.30	3,493,700.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	51,554	19.10	984,681.40	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	179,000	19.50	3,490,500.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	106,425	28.95	3,081,003.75	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	102,551	23.25	2,384,310.75	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	82,778	20.00	1,655,560.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	110,000	32.15	3,536,500.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	102,995	10.80	1,112,346.00	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	85,785	13.45	1,153,808.25	
TAIWAN BUSINESS BANK	44,672	10.35	462,355.20	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	91,626	21.05	1,928,727.30	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	35,000	43.55	1,524,250.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	11,997	123.00	1,475,631.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	98,000	18.00	1,764,000.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	80,000	40.10	3,208,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	129,000	8.75	1,128,750.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	26,320	21.00	552,720.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	68,000	42.00	2,856,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	111,835	8.52	952,834.20	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,000	42.80	256,800.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	6,320	48.50	306,520.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	5,000	236.50	1,182,500.00	
ACER INC	22,000	19.85	436,700.00	
ADVANTECH CO LTD	3,000	328.50	985,500.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	7,000	218.00	1,526,000.00	
AU OPTRONICS CORP	86,000	9.42	810,120.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	7,000	215.00	1,505,000.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	87.00	436,305.00	
COMPAL ELECTRONICS	46,000	18.45	848,700.00	
DELTA ELECTRONICS INC	20,000	184.50	3,690,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	7,000	54.20	379,400.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	125,800	80.00	10,064,000.00	
INNOLUX CORP	90,000	8.18	736,200.00	
INVENTEC CORP	28,000	24.80	694,400.00	

	LARGAN PRECISION CO LTD	1,000	3,800.00	3,800,000.00	
	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	19,000	46.50	883,500.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	7,000	134.50	941,500.00	
	PEGATRON CORP	18,000	61.20	1,101,600.00	
	QUANTA COMPUTER INC	30,000	79.90	2,397,000.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	10,000	43.50	435,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	3,000	177.00	531,000.00	
	WISTRON CORP	29,951	34.10	1,021,329.10	
	WIWYNN CORP	1,000	773.00	773,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	17,960	44.50	799,220.00	
	YAGEO CORPORATION	4,198	389.50	1,635,121.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	127.50	765,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	38,000	109.00	4,142,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	17,000	63.50	1,079,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	17,000	106.00	1,802,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	33,000	69.90	2,306,700.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	2,000	408.00	816,000.00	
	MEDIATEK INC	15,000	675.00	10,125,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	12,000	60.40	724,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	6,000	271.50	1,629,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	317.00	317,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	6,000	104.50	627,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	5,000	360.50	1,802,500.00	
	SILERGY CORP	1,000	1,735.00	1,735,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	248,000	386.00	95,728,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	114,000	19.75	2,251,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	7,000	89.00	623,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	3,000	321.00	963,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	22,000	13.20	290,400.00	
	新台湾ドル 小計	3,262,127		230,012,515.45 (825,744,930)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	6,798	448.40	3,048,223.20	
	COAL INDIA LTD	9,401	131.60	1,237,171.60	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	4,566	228.40	1,042,874.40	
	INDIAN OIL CORP LTD	14,264	92.80	1,323,699.20	

OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	81.00	2,145,690.00
PETRONET LNG LTD	4,527	241.25	1,092,138.75
RELIANCE INDUSTRIES LTD	28,830	2,146.15	61,873,504.50
AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	200.95	1,555,353.00
ASIAN PAINTS LTD	3,027	1,712.05	5,182,375.35
BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	524.10	1,383,099.90
GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	582.70	1,883,286.40
HINDALCO INDUSTRIES LTD	12,818	156.20	2,002,171.60
JSW STEEL LTD	9,306	205.00	1,907,730.00
PIDILITE INDUSTRIES LTD	1,165	1,378.65	1,606,127.25
SHREE CEMENT LTD	83	21,332.75	1,770,618.25
TATA STEEL LTD	3,946	346.10	1,365,710.60
ULTRATECH CEMENT LTD	1,198	3,782.50	4,531,435.00
UPL LTD	5,324	454.15	2,417,894.60
VEDANTA LTD	19,986	112.05	2,239,431.30
HAVELLS INDIA LTD	2,780	606.70	1,686,626.00
LARSEN & TOUBRO LTD	4,499	904.40	4,068,895.60
SIEMENS LTD	766	1,161.10	889,402.60
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	4,572	309.40	1,414,576.80
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	1,562	448.40	700,400.80
INTERGLOBE AVIATION LTD	699	948.25	662,826.75
BAJAJ AUTO LTD	881	2,985.50	2,630,225.50
BHARAT FORGE LTD	1,595	384.10	612,639.50
BOSCH LTD	73	13,199.35	963,552.55
EICHER MOTORS LTD	140	20,800.35	2,912,049.00
HERO MOTOCORP LTD	1,024	2,740.70	2,806,476.80
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	7,702	598.70	4,611,187.40
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,249	6,000.70	7,494,874.30
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	7,207	95.45	687,908.15
TATA MOTORS LTD	18,122	103.75	1,880,157.50
PAGE INDUSTRIES LTD	54	19,454.75	1,050,556.50
TITAN CO LTD	2,882	1,057.60	3,048,003.20
JUBILANT FOODWORKS LTD	681	1,725.85	1,175,303.85
INFO EDGE INDIA LTD	655	3,165.80	2,073,599.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	151.70	1,413,388.90

AVENUE SUPERMARTS LTD	1,602	2,031.40	3,254,302.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	626	3,818.45	2,390,349.70
ITC LTD	35,192	199.60	7,024,323.20
NESTLE INDIA LTD	238	17,251.85	4,105,940.30
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	4,017	408.45	1,640,743.65
UNITED SPIRITS LTD	3,058	598.80	1,831,130.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	700	1,384.20	968,940.00
DABUR INDIA LTD	5,557	471.50	2,620,125.50
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	3,680	680.00	2,502,400.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	8,321	2,209.30	18,383,585.30
MARICO LTD	4,834	357.10	1,726,221.40
AUROBINDO PHARMA LTD	2,600	810.65	2,107,690.00
BIOCON LTD	2,750	415.15	1,141,662.50
CIPLA LTD	3,668	666.05	2,443,071.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	854	2,349.10	2,006,131.40
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,211	4,065.95	4,923,865.45
LUPIN LTD	2,363	853.80	2,017,529.40
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	728	1,492.00	1,086,176.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	8,695	485.60	4,222,292.00
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,325.30	1,116,144.00
AXIS BANK LTD	21,278	445.60	9,481,476.80
BANDHAN BANK LTD	3,094	341.35	1,056,136.90
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	16,605	1,841.30	30,574,786.50
ICICI BANK LTD	48,487	381.80	18,512,336.60
LIC HOUSING FINANCE LTD	2,327	272.60	634,340.20
STATE BANK OF INDIA	16,134	191.95	3,096,921.30
BAJAJ FINANCE LTD	1,885	3,251.85	6,129,737.25
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	330	2,465.25	813,532.50
REC LTD	7,000	106.45	745,150.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	654	706.85	462,279.90
BAJAJ FINSERV LTD	402	6,270.30	2,520,660.60
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	6,678	622.40	4,156,387.20
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	1,977	1,297.55	2,565,256.35
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	440.00	1,639,880.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	3,755	867.40	3,257,087.00

	DLF LTD	4,542	138.90	630,883.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	11,236	679.95	7,639,918.20	
	INFOSYS LTD	34,508	922.85	31,845,707.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	9,183	2,157.40	19,811,404.20	
	TECH MAHINDRA LTD	4,862	652.60	3,172,941.20	
	WIPRO LTD	11,992	270.55	3,244,435.60	
	BHARTI AIRTEL LTD	24,902	559.45	13,931,423.90	
	BHARTI INFRATEL LTD	2,400	195.70	469,680.00	
	GAIL INDIA LTD	17,471	99.55	1,739,238.05	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	2,160	407.55	880,308.00	
	NTPC LTD	25,698	89.40	2,297,401.20	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	17,317	182.00	3,151,694.00	
	インドルピー 小計	623,578		384,364,815.05 (545,798,037)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	3,800	16.23	61,674.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	2.09	101,574.00	
	INDUSTRIES QATAR	17,213	8.08	139,149.89	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	3.91	85,190.40	
	MASRAF AL RAYAN	33,102	3.88	128,435.76	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	5,838	8.25	48,198.52	
	QATAR ISLAMIC BANK	12,416	16.00	198,656.00	
	QATAR NATIONAL BANK	46,167	18.09	835,161.03	
	BARWA REAL ESTATE CO	14,730	3.25	47,872.50	
	OORED00 QPSC	5,987	6.68	40,005.13	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	6,015	16.80	101,052.00	
	カタールリアル 小計	215,628		1,786,969.23 (51,875,716)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	136.92	383,376.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	500	1,433.16	716,580.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	4,253	577.38	2,455,597.14	
	GOLD FIELDS LTD	9,048	210.00	1,900,080.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	8,260	155.00	1,280,300.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	703	540.01	379,627.03	
	NORTHAM PLATINUM LTD	3,813	139.00	530,007.00	
	SASOL LTD	5,312	137.73	731,621.76	

	SIBANYE STILLWATER LTD	23,563	46.91	1,105,340.33
	BIDVEST GROUP LTD	2,876	137.70	396,025.20
	MULTICHOICE GROUP LTD	4,613	107.00	493,591.00
	MR PRICE GROUP LTD	2,802	126.29	353,864.58
	NASPERS LTD-N SHS	4,489	3,079.50	13,823,875.50
	PEPKOR HOLDINGS LTD	9,951	10.54	104,883.54
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	7,365	30.67	225,884.55
	BID CORP LTD	3,419	278.54	952,328.26
	CLICKS GROUP LTD	2,589	216.90	561,554.10
	PICK N PAY STORES LTD	2,743	44.95	123,297.85
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	4,619	100.48	464,117.12
	SPAR GROUP LIMITED/THE	1,441	165.41	238,355.81
	TIGER BRANDS LTD	1,150	175.00	201,250.00
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	12,763	18.71	238,795.73
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	3,574	138.09	493,533.66
	ABSA GROUP LTD	7,463	84.93	633,832.59
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	486	869.32	422,489.52
	NEDBANK GROUP LTD	3,923	113.00	443,299.00
	STANDARD BANK GROUP LTD	13,209	109.00	1,439,781.00
	FIRSTRAND LTD	49,293	39.00	1,922,427.00
	PSG GROUP LTD	1,806	159.95	288,869.70
	REINET INVESTMENTS SCA	1,613	319.76	515,772.88
	REMGRO LTD	5,030	91.90	462,257.00
	DISCOVERY LTD	4,144	108.94	451,447.36
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS LIMITED	10,082	17.50	176,435.00
	OLD MUTUAL LTD	48,784	12.26	598,091.84
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	5,580	31.25	174,375.00
	SANLAM LTD	19,161	61.30	1,174,569.30
	NEPI ROCKCASTLE PLC	4,106	91.52	375,781.12
	MTN GROUP LTD	17,388	66.40	1,154,563.20
	VODACOM GROUP LTD	6,615	128.29	848,638.35
	南アフリカランド 小計	321,329		39,236,516.02 (249,544,241)
アラブディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	28,809	5.11	147,213.99
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	3.78	77,263.20

	EMIRATES NBD PJSC	11,600	8.93	103,588.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	27,831	10.68	297,235.08	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	29,017	1.72	49,909.24	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.38	42,330.12	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	36,755	2.60	95,563.00	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	17,750	16.90	299,975.00	
	アラブディルハム 小計	202,876		1,113,077.63 (32,123,420)	
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	6.20	12,400.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.00	47,200.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	1,500	15.48	23,220.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.84	3,124.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.80	2,400.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	5,100	4.50	22,950.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	7.94	19,850.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	6.27	1,881.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	6.54	24,198.00	
	SHANXI XISHAN COAL & ELEC-A	520	4.17	2,168.40	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	30.30	27,270.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	9.10	9,018.10	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.23	6,783.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-A	780	2.64	2,059.20	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	58.85	164,780.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	8,000	4.91	39,280.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	3.15	2,835.00	
	BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,200	51.97	62,364.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	11.75	34,075.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	4.22	28,696.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	12.34	6,170.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	5.02	17,570.00	
	GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	7.76	10,864.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	51.30	25,650.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	15.80	57,196.00	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	10.52	20,514.00	
	HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.20	3,300.00	

HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	25.70	28,270.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.42	15,470.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.16	20,764.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	4.86	17,010.00	
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	10.69	20,311.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	87.49	26,247.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	15.23	4,569.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	200	55.33	11,066.00	
JINDUICHENG MOLYBDENUM CO -A	400	6.45	2,580.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	22.43	38,131.00	
MAANSHAN IRON & STEEL-A	700	2.72	1,904.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.14	15,408.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	16.31	55,454.00	
SANSTEEL MINGUANG CO LTD -A	2,100	6.94	14,574.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,120	40.45	45,304.00	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	22.09	30,926.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	2.33	23,300.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	34.38	27,504.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.69	25,718.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	99.60	29,880.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.47	16,656.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.67	2,202.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	18.43	20,273.00	
TIANQI LITHIUM CORP-A	200	24.75	4,950.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	14.20	21,300.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.16	3,240.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.76	7,488.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	62.11	142,853.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	73.32	29,328.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	14.96	17,952.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	1,700	18.75	31,875.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	69.57	41,742.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	38.68	10,056.80	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	7.08	16,284.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	14.35	5,740.00	



ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	10.93	4,372.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	8,800	5.63	49,544.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	18.97	18,970.00
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	34.21	47,894.00
AVIC AIRCRAFT CO LTD-A	400	23.08	9,232.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.49	31,470.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	100	65.80	6,580.00
AVICOPTER PLC-A	500	54.30	27,150.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	30.18	42,252.00
BOHAI LEASING CO LTD-A	10,000	3.03	30,300.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.60	17,480.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	17.44	1,744.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-A	300	7.94	2,382.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.62	3,310.00
CHINA MEHECO CO LTD -A	900	15.48	13,932.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	5.73	2,865.00
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-A	7,400	9.02	66,748.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	9,200	5.59	51,428.00
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	10,300	5.06	52,118.00
CHINA SPACESAT CO LTD -A	100	33.99	3,399.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.06	150,788.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,300	198.68	258,284.00
COSCO SHIPPING DEVELOPME-A	1,500	2.05	3,075.00
CRRC CORP LTD-A	18,500	5.86	108,410.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	9.64	5,784.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	56.08	85,241.60
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.65	2,773.05
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	24.06	24,060.00
GUOCHENG MINING CO LTD-A	900	22.00	19,800.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	53.25	31,950.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	37.52	11,256.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	11.29	15,806.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	59.19	61,320.84
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	11.15	28,990.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.79	5,022.00

NANYANG TOPSEC TECHNOLOGIE-A	900	23.57	21,213.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	20.91	74,000.49
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	4.25	17,000.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	21.10	130,820.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.12	17,472.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.37	4,296.00
SHANGHAI TUNNEL ENGINEERIN-A	300	6.02	1,806.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	700	48.69	34,083.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	15.80	20,540.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	20.88	27,144.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	9.17	3,668.00
TBEA CO LTD-A	400	8.20	3,280.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	2,700	16.16	43,632.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	6.32	6,952.00
XIAMEN C & D INC-A	300	9.30	2,790.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	10.93	4,372.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	200	27.18	5,436.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	82.28	34,557.60
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	21.80	65,182.00
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	13.61	17,693.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	13.09	2,618.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	900	8.24	7,416.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	8.59	22,334.00
CENTRE TESTING INTL GROUP-A	1,400	23.07	32,298.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	60.40	48,320.00
AIR CHINA LTD-A	800	6.96	5,568.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.42	5,746.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.42	49,322.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	1,200	4.09	4,908.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.44	71,484.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	14.19	11,352.00
JUNEYAO AIRLINES CO LTD-A	700	9.25	6,475.00
NINGBO ZHOUSHAN PORT CO LT-A	5,500	3.99	21,945.00
S F HOLDING CO LTD-A	1,800	63.55	114,390.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	300	68.37	20,511.00

SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.41	4,410.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	8.60	16,340.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	3.31	6,620.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	38.83	3,883.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	24.00	28,080.00
BAIC BLUEPARK NEW ENERGY -A	3,200	6.51	20,832.00
BYD CO LTD -A	800	83.00	66,400.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	135.05	27,010.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	500	11.13	5,565.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	200	23.32	4,664.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	20.62	28,868.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	22.11	26,532.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	32.91	26,328.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	3,510	17.96	63,039.60
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	23.04	2,304.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	21.22	2,122.00
ZHEJIANG WANFENG AUTO -A	2,000	6.79	13,580.00
GREE ELECTRIC APPLIANCES I-A	1,400	57.16	80,024.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	2,800	16.57	46,396.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	35.43	3,543.00
JOYOUNG CO LTD -A	600	35.22	21,132.00
NAVINFO CO LTD-A	900	18.46	16,614.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	87.09	12,192.60
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	22.58	9,032.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	6.10	37,820.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	59.55	17,865.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	8.30	3,320.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	84.00	25,200.00
BTG HOTELS GROUP CO LTD-A	800	18.63	14,904.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	31.45	31,450.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	37.55	22,530.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.17	7,887.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	18.40	19,872.00
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	13.80	17,940.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	24.35	19,480.00

CHINA FILM CO LTD-A	200	14.70	2,940.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.45	2,090.00
CHINESE UNIVERSE PUBLISHING & MEDIA-A	100	12.38	1,238.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	5.98	72,358.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	573.98	57,398.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	20.15	4,030.00
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.43	14,063.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	64.66	84,704.60
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	19.13	21,043.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.98	2,994.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	37.77	50,989.50
WANDA FILM HOLDING CO LTD-A	900	17.72	15,948.00
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	43.14	38,826.00
YOUZU INTERACTIVE CO LTD-A	400	21.00	8,400.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	11.33	33,990.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,300	204.54	265,902.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	27.91	5,582.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	9.99	49,950.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	10.29	33,957.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.50	27,000.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	200	104.45	20,890.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	86.00	36,120.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	9.28	28,768.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	61.56	43,092.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	181.25	54,375.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	48.40	24,200.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.87	4,935.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	62.29	37,374.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	7.71	18,504.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	48.60	19,440.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	69.60	27,840.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	36.68	25,676.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	1,800	137.07	246,726.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	27.71	24,939.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	54.46	70,798.00

HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	18.80	47,000.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	1,200	51.30	61,560.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	34.03	142,926.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	41.90	41,900.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,000	130.14	130,140.00
JIANGXI ZHENGBO TECH -A	2,000	19.33	38,660.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	64.58	19,374.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	80.17	24,051.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	800	1,595.30	1,276,240.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	113.98	113,980.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,040	89.25	182,070.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	31.43	81,718.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	400	162.88	65,152.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	66.00	26,400.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	56.02	28,010.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	23.61	77,913.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	80.33	8,033.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	2,760	23.43	64,666.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	2,400	201.39	483,336.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	16.97	18,667.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	21.06	27,378.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	23.98	23,980.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	166.47	16,647.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	43.31	25,986.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	2,221	44.00	97,724.00
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	156.78	15,678.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	45.15	9,030.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	38.68	15,472.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	91.35	18,270.00
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	300	93.50	28,050.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	26.12	6,268.80
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	69.00	26,220.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	34.43	17,215.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	17.60	3,520.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	42.01	29,407.00

MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	14.99	7,195.20
OVCTEK CHINA INC-A	300	60.27	18,081.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	19.00	3,800.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	332.39	232,673.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	165.88	16,588.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	22.59	23,493.60
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	23.30	20,970.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	220.00	44,000.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	42.27	45,651.60
BEIJING TONGRENTANG CO-A	200	26.34	5,268.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	135.16	40,548.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	151.16	45,348.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	200	447.22	89,444.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	45.46	27,276.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	29.13	2,913.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	900	149.10	134,190.00
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	32.98	19,788.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	34.52	3,452.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	34.28	6,856.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	104.99	31,497.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	53.88	42,026.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	24.62	17,234.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	2,980	94.79	282,474.20
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	16.78	16,780.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	26.07	23,463.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	19.41	31,056.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	51.23	25,615.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	45.65	29,672.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	26.76	6,957.60
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	48.12	57,744.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	9.27	26,883.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	23.88	21,492.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	300	206.50	61,950.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	32.26	3,226.00
SHIJIAZHANG YILING PHARMA-A	1,000	29.08	29,080.00

SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	21.35	4,270.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	5.23	11,506.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.90	2,580.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	65.80	39,480.00
WUXI APPTec CO LTD-A	1,440	107.05	154,152.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	29.02	29,020.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	500	105.75	52,875.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	300	188.99	56,697.00
ZHEJIANG CONBA PHARMACEUTI-A	2,200	5.65	12,430.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	37.27	45,096.70
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	28.55	50,819.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	63.00	25,200.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.23	162,469.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	7,500	4.79	35,925.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	8.21	12,315.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.35	54,605.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.77	129,744.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	500	9.36	4,680.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.97	19,104.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	2,400	7.76	18,624.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	3,400	30.08	102,272.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.13	71,625.30
CHINA CITIC BANK CORP LTD-A	600	5.12	3,072.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.12	18,360.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	18,400	3.78	69,552.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	13,000	34.60	449,800.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	16,400	5.52	90,528.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.33	27,852.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	4.98	180,276.00
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	13,700	15.66	214,542.00
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	13.50	176,850.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	10.42	202,148.00
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	4.76	4,284.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	13.05	19,575.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	800	8.63	6,904.00

CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	12.75	35,700.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	2,600	20.70	53,820.00	
CITIC SECURITIES CO-A	6,900	28.50	196,650.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	1,300	45.83	59,579.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	12.89	2,578.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	5,920	25.01	148,059.20	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	23.46	75,072.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	10.01	5,005.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.36	60,192.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	2,700	15.15	40,905.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	600	12.90	7,740.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	3,500	18.35	64,225.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	9.97	4,985.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	3,700	13.80	51,060.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	200	140.40	28,080.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	7.80	3,120.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	20.53	112,915.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	12.03	3,609.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	700	7.87	5,509.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	15.16	24,256.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	10.59	31,770.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	11.27	58,604.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	4.16	13,312.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	600	14.32	8,592.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	5.51	13,775.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.99	3,196.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	5.49	83,448.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	300	13.63	4,089.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.79	2,937.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.43	20,634.00	
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	7.01	30,143.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.74	4,870.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	15.69	20,397.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	1,200	35.40	42,480.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	29.37	129,228.00	



HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	5.62	3,372.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	900	51.89	46,701.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	7.06	24,710.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	6,800	77.00	523,600.00
BEIJING CAPITAL DEVELOPMEN-A	2,200	6.70	14,740.00
CHINA ENTERPRISE CO LTD - A	3,400	4.17	14,178.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	17.84	25,511.20
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	35.26	24,682.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	17.08	61,488.00
CHINA VANKE CO LTD -A	6,500	27.03	175,695.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.79	2,716.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	32.79	26,232.00
GEMDALE CORP-A	3,300	13.80	45,540.00
GRANDJOY HOLDINGS GROUP-A	2,700	5.44	14,688.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	7.69	9,228.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	9.82	30,442.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	9.10	6,370.00
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	4.17	5,004.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	15.87	131,721.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	8.26	4,956.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	20.31	18,279.00
SICHUAN LANGUANG DEVELOPME-A	2,500	5.37	13,425.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.32	3,984.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.97	23,698.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.51	20,181.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	3.47	17,697.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	300	18.84	5,652.00
AISINO CORP-A	200	17.49	3,498.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	400	49.46	19,784.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	36.29	3,629.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	25.16	17,612.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	90.85	18,170.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	22.70	15,890.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	11.82	4,728.00
GLODON CO LTD-A	500	70.85	35,425.00

HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	102.31	70,491.59
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	35.95	35,950.00
NEWLAND DIGITAL TECHNOLOGY-A	500	16.66	8,330.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	215.00	21,500.00
SHANGHAI 2345 NETWORK HOLD-A	780	2.98	2,324.40
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	70.49	28,196.00
SHENZHEN KINGDOM SCI-TECH-A	400	19.14	7,656.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	94.03	28,209.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	39.07	15,628.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	8.58	7,722.00
WONDERS INFORMATION CO LTD-A	900	27.55	24,795.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	43.75	100,975.00
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	32.10	19,260.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	44.24	39,816.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	20,500	4.52	92,660.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	26.66	18,662.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	16.01	41,626.00
DAWNING INFORMATION INDUST-A	1,120	41.95	46,984.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	28.01	30,811.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	14.16	53,808.00
GOERTEK INC -A	2,000	32.95	65,900.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	13.46	29,612.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	10.51	26,275.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	13.54	4,062.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	102.36	51,180.00
HANGZHOU HIKVISION DIGITAL-A	5,500	33.63	184,965.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	16.08	3,216.00
HOLITECH TECHNOLOGY CO LTD-A	2,800	5.09	14,252.00
HUBEI KAILE SCIENCE & TECH-A	900	13.26	11,934.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	36.87	22,122.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	1,300	28.37	36,881.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.33	14,559.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	4,133	53.10	219,462.30
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	178.59	35,718.00
NINESTAR CORP-A	100	35.80	3,580.00

OFILM GROUP CO LTD-A	400	18.00	7,200.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	27.17	27,170.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	151.50	42,420.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	23.40	23,400.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	49.09	44,181.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	26.00	18,200.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	39.66	27,762.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	15.77	4,731.00
TUNGHSU OPTOELECTRONIC TEC-A	800	2.73	2,184.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,340	42.60	57,084.00
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	20.15	26,195.00
WESTONE INFORMATION INDUST-A	800	21.59	17,272.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	135.85	95,095.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	39.16	53,257.60
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	23.49	37,584.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	43.15	17,260.00
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	61.73	18,519.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	19.59	47,016.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	56.30	28,150.00
ZTE CORP-A	2,700	37.92	102,384.00
CHINA UNITED NETWORK-A	13,800	5.10	70,380.00
CHENGDU XINGRONG ENVIRONME-A	2,500	4.97	12,425.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.31	18,533.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	12,400	18.20	225,680.00
GD POWER DEVELOPMENT CO -A	2,800	1.98	5,544.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.79	4,927.00
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.66	3,728.00
HUBEI ENERGY GROUP CO LTD-A	600	3.71	2,226.00
INNER MONGOLIA MENGDIAN HU-A	4,900	2.62	12,838.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	1,100	8.43	9,273.00
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.54	16,588.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.59	3,913.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.51	3,306.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	700	9.31	6,517.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	2.96	12,728.00

	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	140	225.59	31,582.60	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	17.04	34,080.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	51.20	133,120.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	1,600	24.29	38,864.00	
	SG MICRO CORP-A	100	345.15	34,515.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	206.11	51,527.50	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	23.67	54,441.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	15.19	28,861.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	24.00	19,200.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	116.75	58,375.00	
	VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	16.10	17,710.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	400	199.35	79,740.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	11.24	16,860.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	23.38	21,042.00	
	オフショア人民元 小計	1,101,144		19,346,391.47 (292,323,975)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	12.82	20,858.14	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	12,204	32.75	399,681.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	52.00	61,048.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	10.30	38,954.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	14.68	51,380.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	2,161	77.40	167,261.40	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	4,523	35.70	161,471.10	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	9,130	87.60	799,788.00	
	SAUDI CEMENT	565	56.30	31,809.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	1,544	18.04	27,853.76	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	8.14	66,243.32	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	2,789	51.20	142,796.80	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	80.20	33,844.40	
	JARIR MARKETING CO	611	149.00	91,039.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	116.00	47,096.00	
	ALMARAI CO	2,209	53.70	118,623.30	
	SAVOLA	2,712	46.85	127,057.20	
	AL RAJHI BANK	12,412	58.90	731,066.80	
	ALINMA BANK	8,696	14.64	127,309.44	

ARAB NATIONAL BANK	6,307	19.24	121,346.68	
BANK AL-JAZIRA	3,069	12.16	37,319.04	
BANK ALBILAD	3,925	23.50	92,237.50	
BANQUE SAUDI FRANSI	6,113	30.10	184,001.30	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	14,926	35.90	535,843.40	
RIYAD BANK	13,885	16.80	233,268.00	
SAMBA FINANCIAL GROUP	10,048	26.40	265,267.20	
SAUDI BRITISH BANK	6,357	24.32	154,602.24	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	536	117.00	62,712.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	80.80	53,408.80	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	7.26	28,618.92	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	7.09	30,451.55	
ETIHAD ETISALAT CO	3,984	27.05	107,767.20	
SAUDI TELECOM CO	6,089	97.10	591,241.90	
SAUDI ELECTRICITY CO	9,159	15.72	143,979.48	
サウジアラビアリアル 小計	171,901		5,887,246.97	(166,373,599)
合 計	24,800,415		6,562,354,201	(6,562,354,201)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	34,100	606,298.00	
	メキシコペソ 小計		34,100	606,298.00	(2,885,978)
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	31,594	427,782.76	
	南アフリカランド 小計		31,594	427,782.76	(2,720,698)
合 計				5,606,676	(5,606,676)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 57銘柄	100.0%		16.3%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.4%		1.6%
	投資証券 1銘柄		2.6%	0.0%
ブラジルリアル	株式 56銘柄	100.0%		5.5%
チリペソ	株式 16銘柄	100.0%		0.6%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 4銘柄	100.0%		0.1%
トルコリラ	株式 15銘柄	100.0%		0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 15銘柄	100.0%		0.7%
香港ドル	株式 205銘柄	100.0%		23.9%
マレーシアリングット	株式 39銘柄	100.0%		1.8%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%		2.1%
フィリピンペソ	株式 21銘柄	100.0%		0.8%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%		1.4%
韓国ウォン	株式 105銘柄	100.0%		11.3%
新台湾ドル	株式 88銘柄	100.0%		12.6%
インドルピー	株式 86銘柄	100.0%		8.3%
カタールリアル	株式 11銘柄	100.0%		0.8%
南アフリカランド	株式 39銘柄	98.9%		3.8%
	投資証券 1銘柄		1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式 8銘柄	100.0%		0.5%
オフショア人民元	株式 461銘柄	100.0%		4.5%
サウジアラビアリアル	株式 34銘柄	100.0%		2.5%

(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国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2020年 7月27日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	707,891
コール・ローン	607,497,408
国債証券	70,823,456,760
地方債証券	4,464,013,900
特殊債券	5,422,360,819
社債券	3,506,701,000
未収利息	140,457,076
前払費用	14,452,731
流動資産合計	84,979,647,585
資産合計	84,979,647,585
負債の部	
流動負債	
未払解約金	10,256,000
未払利息	1,647
流動負債合計	10,257,647
負債合計	10,257,647
純資産の部	
元本等	
元本	80,757,065,940
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,212,323,998
元本等合計	84,969,389,938
純資産合計	84,969,389,938
負債純資産合計	84,979,647,585

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	67,774,379,684円
期中追加設定元本額	76,762,565,706円
期中一部解約元本額	63,779,879,450円
期末元本額	80,757,065,940円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,980,983,874円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,964,043,553円
りそなラップ型ファンド(成長型)	350,101,001円
DCりそな グローバルバランス	400,696,997円
つみたてバランスファンド	1,474,116,724円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,099,549,046円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	220,947,305円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	51,553,417円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,226,977円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	4,532,123円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	475,408円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	153,646円
リスクコントロール・オープン	51,075,428円
FWりそな円建債券アクティブファンド	758,551,102円
FWりそな国内債券インデックスファンド	45,642,293,152円
Smart-i 国内債券インデックス	785,467,874円
Smart-i 8資産バランス 安定型	341,188,044円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	236,133,349円
Smart-i 8資産バランス 成長型	85,132,911円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,417,471,336円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,449,822,255円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,555,728,332円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,001,854,612円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	3,195,138,463円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	519,535,603円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	9,231,726円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,010,693,098円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	137,368,584円
2. 計算日における受益権の総数	80,757,065,940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	1.0522円
(10,000口当たり純資産額)	(10,522円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額



## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在
<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、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <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

2020年 7月27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</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお</p> <p>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</p> <p>が異なることもあります。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

2020年 7月27日現在
該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		902,153,760
地方債証券		24,011,100
特殊債券		33,464,083
社債券		26,991,000
合計		986,619,943

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

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403回利付国債（2年）	280,000,000	280,736,400	
	第404回利付国債（2年）	420,000,000	421,197,000	
	第405回利付国債（2年）	200,000,000	200,624,000	
	第406回利付国債（2年）	250,000,000	250,822,500	
	第407回利付国債（2年）	330,000,000	331,155,000	
	第408回利付国債（2年）	610,000,000	612,269,200	
	第409回利付国債（2年）	180,000,000	180,709,200	
	第410回利付国債（2年）	410,000,000	411,664,600	
	第411回利付国債（2年）	440,000,000	441,958,000	

第4 1 2 回利付国債(2年)	330,000,000	331,481,700	
第4 1 3 回利付国債(2年)	550,000,000	552,486,000	
第1 2 9 回利付国債(5年)	450,000,000	451,318,500	
第1 3 0 回利付国債(5年)	240,000,000	240,856,800	
第1 3 1 回利付国債(5年)	360,000,000	361,479,600	
第1 3 2 回利付国債(5年)	40,000,000	40,186,000	
第1 3 3 回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,286,745,600	
第1 3 4 回利付国債(5年)	1,060,000,000	1,066,243,400	
第1 3 5 回利付国債(5年)	860,000,000	865,590,000	
第1 3 6 回利付国債(5年)	850,000,000	856,179,500	
第1 3 7 回利付国債(5年)	510,000,000	514,029,000	
第1 3 8 回利付国債(5年)	860,000,000	867,335,800	
第1 3 9 回利付国債(5年)	780,000,000	786,996,600	
第1 4 0 回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,080,058,000	
第1 4 1 回利付国債(5年)	620,000,000	626,076,000	
第1 4 2 回利付国債(5年)	680,000,000	686,915,600	
第1 4 3 回利付国債(5年)	450,000,000	454,725,000	
第1 回利付国債(40年)	40,000,000	59,031,200	
第2 回利付国債(40年)	100,000,000	143,493,000	
第3 回利付国債(40年)	110,000,000	158,892,800	
第4 回利付国債(40年)	150,000,000	218,338,500	
第5 回利付国債(40年)	150,000,000	211,761,000	
第6 回利付国債(40年)	170,000,000	236,789,600	
第7 回利付国債(40年)	190,000,000	254,926,800	
第8 回利付国債(40年)	200,000,000	251,296,000	
第9 回利付国債(40年)	270,000,000	254,142,900	
第1 0 回利付国債(40年)	300,000,000	331,515,000	
第1 1 回利付国債(40年)	240,000,000	257,505,600	
第1 2 回利付国債(40年)	250,000,000	242,537,500	
第1 3 回利付国債(40年)	50,000,000	48,476,000	
第3 1 7 回利付国債(10年)	40,000,000	40,577,200	
第3 1 8 回利付国債(10年)	366,000,000	370,860,480	
第3 1 9 回利付国債(10年)	240,000,000	244,216,800	
第3 2 0 回利付国債(10年)	202,000,000	205,266,340	
第3 2 1 回利付国債(10年)	241,000,000	245,566,950	
第3 2 2 回利付国債(10年)	220,000,000	223,806,000	
第3 2 3 回利付国債(10年)	340,000,000	346,752,400	
第3 2 4 回利付国債(10年)	183,000,000	186,286,680	
第3 2 5 回利付国債(10年)	330,000,000	336,718,800	
第3 2 6 回利付国債(10年)	280,000,000	285,689,600	
第3 2 7 回利付国債(10年)	387,000,000	395,796,510	
第3 2 8 回利付国債(10年)	411,000,000	419,125,470	

第329回利付国債(10年)	297,000,000	305,161,560
第330回利付国債(10年)	257,000,000	264,720,280
第331回利付国債(10年)	90,000,000	92,134,800
第332回利付国債(10年)	532,000,000	545,619,200
第333回利付国債(10年)	225,000,000	231,140,250
第334回利付国債(10年)	261,000,000	268,563,780
第335回利付国債(10年)	345,000,000	354,135,600
第336回利付国債(10年)	210,000,000	215,896,800
第337回利付国債(10年)	170,000,000	173,270,800
第338回利付国債(10年)	631,000,000	646,472,120
第339回利付国債(10年)	385,000,000	394,856,000
第340回利付国債(10年)	814,000,000	836,140,800
第341回利付国債(10年)	520,000,000	532,006,800
第342回利付国債(10年)	190,000,000	192,428,200
第343回利付国債(10年)	680,000,000	689,084,800
第344回利付国債(10年)	690,000,000	699,618,600
第345回利付国債(10年)	640,000,000	649,280,000
第346回利付国債(10年)	870,000,000	883,110,900
第347回利付国債(10年)	190,000,000	192,973,500
第348回利付国債(10年)	470,000,000	477,454,200
第349回利付国債(10年)	390,000,000	396,255,600
第350回利付国債(10年)	620,000,000	629,789,800
第351回利付国債(10年)	470,000,000	477,289,700
第352回利付国債(10年)	790,000,000	801,660,400
第353回利付国債(10年)	510,000,000	517,104,300
第354回利付国債(10年)	640,000,000	648,332,800
第355回利付国債(10年)	680,000,000	688,187,200
第356回利付国債(10年)	910,000,000	920,428,600
第357回利付国債(10年)	760,000,000	767,858,400
第358回利付国債(10年)	590,000,000	595,687,600
第1回利付国債(30年)	60,000,000	75,471,600
第7回利付国債(30年)	40,000,000	50,242,800
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,766,500
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,992,400
第13回利付国債(30年)	90,000,000	111,573,900
第14回利付国債(30年)	60,000,000	77,789,400
第15回利付国債(30年)	160,000,000	210,179,200
第16回利付国債(30年)	100,000,000	131,735,000
第17回利付国債(30年)	50,000,000	65,348,000
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,760,000
第19回利付国債(30年)	100,000,000	129,906,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	133,228,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	117,529,200

第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,987,000	
第23回利付国債(30年)	160,000,000	214,873,600	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	134,713,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	131,771,000	
第26回利付国債(30年)	145,000,000	193,883,850	
第27回利付国債(30年)	215,000,000	292,617,150	
第28回利付国債(30年)	110,000,000	150,425,000	
第29回利付国債(30年)	70,000,000	94,972,500	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	255,513,900	
第31回利付国債(30年)	130,000,000	173,313,400	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	292,058,150	
第33回利付国債(30年)	210,000,000	274,438,500	
第34回利付国債(30年)	255,000,000	344,497,350	
第35回利付国債(30年)	316,000,000	415,799,120	
第36回利付国債(30年)	285,000,000	376,205,700	
第37回利付国債(30年)	320,000,000	417,232,000	
第38回利付国債(30年)	220,000,000	283,067,400	
第39回利付国債(30年)	210,000,000	275,205,000	
第40回利付国債(30年)	155,000,000	199,914,350	
第41回利付国債(30年)	195,000,000	247,646,100	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	241,528,000	
第43回利付国債(30年)	60,000,000	76,346,400	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	229,257,000	
第45回利付国債(30年)	220,000,000	270,483,400	
第46回利付国債(30年)	220,000,000	270,943,200	
第47回利付国債(30年)	250,000,000	314,012,500	
第48回利付国債(30年)	253,000,000	306,259,030	
第49回利付国債(30年)	230,000,000	278,530,000	
第50回利付国債(30年)	250,000,000	267,045,000	
第51回利付国債(30年)	230,000,000	217,704,200	
第52回利付国債(30年)	230,000,000	228,677,500	
第53回利付国債(30年)	220,000,000	223,823,600	
第54回利付国債(30年)	230,000,000	245,357,100	
第55回利付国債(30年)	120,000,000	127,927,200	
第56回利付国債(30年)	220,000,000	234,374,800	
第57回利付国債(30年)	230,000,000	245,147,800	
第58回利付国債(30年)	350,000,000	372,785,000	
第59回利付国債(30年)	220,000,000	228,533,800	
第60回利付国債(30年)	190,000,000	207,217,800	
第61回利付国債(30年)	220,000,000	228,384,200	
第62回利付国債(30年)	220,000,000	216,739,600	
第63回利付国債(30年)	210,000,000	201,142,200	

第64回利付国債(30年)	180,000,000	172,135,800
第65回利付国債(30年)	150,000,000	143,398,500
第66回利付国債(30年)	230,000,000	219,525,800
第52回利付国債(20年)	190,000,000	194,938,100
第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,630,000
第54回利付国債(20年)	180,000,000	185,922,000
第55回利付国債(20年)	100,000,000	103,548,000
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,407,700
第57回利付国債(20年)	110,000,000	114,275,700
第58回利付国債(20年)	100,000,000	104,406,000
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,775,200
第60回利付国債(20年)	30,000,000	31,114,800
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,519,000
第62回利付国債(20年)	80,000,000	82,198,400
第63回利付国債(20年)	60,000,000	63,393,600
第64回利付国債(20年)	120,000,000	127,760,400
第65回利付国債(20年)	380,000,000	406,527,800
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,494,200
第68回利付国債(20年)	90,000,000	97,713,000
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,922,400
第70回利付国債(20年)	110,000,000	120,920,800
第71回利付国債(20年)	100,000,000	109,145,000
第72回利付国債(20年)	210,000,000	229,576,200
第73回利付国債(20年)	180,000,000	196,956,000
第75回利付国債(20年)	100,000,000	110,392,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	109,458,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,985,000
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,960,500
第79回利付国債(20年)	20,000,000	22,082,600
第80回利付国債(20年)	90,000,000	99,814,500
第81回利付国債(20年)	30,000,000	33,294,300
第82回利付国債(20年)	170,000,000	189,548,300
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,206,000
第84回利付国債(20年)	120,000,000	133,819,200
第85回利付国債(20年)	150,000,000	168,921,000
第86回利付国債(20年)	100,000,000	113,751,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	101,863,800
第88回利付国債(20年)	185,000,000	211,582,650
第89回利付国債(20年)	120,000,000	136,530,000
第90回利付国債(20年)	170,000,000	194,427,300
第91回利付国債(20年)	80,000,000	91,990,400
第92回利付国債(20年)	255,000,000	291,493,050
第93回利付国債(20年)	80,000,000	91,358,400

第94回利付国債(20年)	140,000,000	160,813,800	
第95回利付国債(20年)	185,000,000	216,129,950	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	80,805,200	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	151,689,200	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	81,174,100	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	99,009,700	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	177,751,160	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,851,200	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	173,711,450	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	119,006,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,741,500	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	14,139,600	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	47,460,000	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	94,583,200	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	256,390,200	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	93,501,600	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	231,295,350	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,972,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	244,056,600	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	101,560,550	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	191,753,600	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	120,787,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	169,702,400	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	270,567,000	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	156,694,340	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	176,455,500	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	231,322,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	243,906,950	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	224,137,300	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	321,521,850	
第124回利付国債(20年)	140,000,000	168,411,600	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	147,315,600	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	120,645,000	
第127回利付国債(20年)	70,000,000	83,710,200	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	269,669,250	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	213,787,800	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	214,326,000	
第131回利付国債(20年)	170,000,000	200,540,500	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	200,989,300	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	292,427,100	
第134回利付国債(20年)	205,000,000	245,110,300	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	47,366,000	

	第136回利付国債(20年)	40,000,000	46,905,600
	第137回利付国債(20年)	170,000,000	201,739,000
	第138回利付国債(20年)	90,000,000	104,688,900
	第139回利付国債(20年)	210,000,000	246,739,500
	第140回利付国債(20年)	380,000,000	451,614,800
	第141回利付国債(20年)	185,000,000	220,301,700
	第142回利付国債(20年)	150,000,000	180,451,500
	第143回利付国債(20年)	245,000,000	289,259,250
	第144回利付国債(20年)	230,000,000	268,692,900
	第145回利付国債(20年)	405,000,000	484,108,650
	第146回利付国債(20年)	400,000,000	479,012,000
	第147回利付国債(20年)	335,000,000	397,487,550
	第148回利付国債(20年)	405,000,000	475,870,950
	第149回利付国債(20年)	380,000,000	447,089,000
	第150回利付国債(20年)	370,000,000	430,791,000
	第151回利付国債(20年)	445,000,000	506,209,750
	第152回利付国債(20年)	460,000,000	523,581,200
	第153回利付国債(20年)	290,000,000	334,448,300
	第154回利付国債(20年)	188,000,000	214,222,240
	第155回利付国債(20年)	350,000,000	388,342,500
	第156回利付国債(20年)	430,000,000	437,731,400
	第157回利付国債(20年)	240,000,000	236,536,800
	第158回利付国債(20年)	300,000,000	309,477,000
	第159回利付国債(20年)	330,000,000	345,199,800
	第160回利付国債(20年)	350,000,000	371,602,000
	第161回利付国債(20年)	190,000,000	198,527,200
	第162回利付国債(20年)	280,000,000	292,504,800
	第163回利付国債(20年)	300,000,000	313,068,000
	第164回利付国債(20年)	490,000,000	502,627,300
	第165回利付国債(20年)	290,000,000	297,073,100
	第166回利付国債(20年)	490,000,000	518,821,800
	第167回利付国債(20年)	290,000,000	296,493,100
	第168回利付国債(20年)	350,000,000	351,218,000
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	275,564,800
	第170回利付国債(20年)	370,000,000	363,739,600
	第171回利付国債(20年)	250,000,000	245,497,500
	第172回利付国債(20年)	310,000,000	310,000,000
	国債証券合計	65,483,000,000	70,823,456,760
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	117,022,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,698,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	102,314,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,319,000



	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,061,000	
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,844,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,930,000	
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,817,000	
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,140,000	
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,843,000	
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,715,900	
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,414,000	
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,309,000	
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,858,000	
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,759,000	
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	102,206,000	
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,584,000	
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,652,000	
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,999,000	
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,118,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,570,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,012,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	119,009,000	
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,376,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,202,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,715,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,712,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,305,000	
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,669,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,454,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,484,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,253,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,939,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,238,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,100,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	118,579,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,185,000	
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,971,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,207,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,284,000	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	99,989,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,925,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,233,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,464,013,900	
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	102,035,000	

第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,372,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,285,000	
第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,795,000	
第27回道路債券	100,000,000	108,647,000	
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	116,832,900	
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	129,832,100	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,016,000	
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	102,334,000	
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	105,822,200	
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	135,271,640	
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	100,683,000	
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	100,989,000	
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	101,288,000	
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	100,735,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	127,105,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	110,393,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,810,510	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,970,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,805,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,196,250	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,372,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,532,280	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,064,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,316,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,367,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,024,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	114,404,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	94,313,000	94,043,264	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,023,000	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,623,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,874,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	109,412,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,847,000	88,989,011	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,999,000	88,897,469	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,267,000	90,037,374	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,719,000	89,607,964	

	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,101,000	92,800,046	
	第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,053,000	94,322,242	
	第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,347,000	96,648,048	
	第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,964,000	98,990,720	
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	66,795,000	66,780,305	
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	69,590,000	69,621,315	
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	73,843,000	73,927,181	
	第327回信金中金債	100,000,000	100,063,000	
	第340回信金中金債	100,000,000	100,202,000	
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,333,000	
	第39回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,006,000	
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,075,000	
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,804,000	
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	99,984,000	
	特殊債券合計	5,201,838,000	5,422,360,819	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	98,624,000	
	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	100,252,000	
	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	98,544,000	
	第7回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,973,000	
	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	99,731,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,860,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,369,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	97,913,000	
	第12回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,681,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,269,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,145,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,167,000	
	第26回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	100,234,000	
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,540,000	
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,897,000	
	第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	100,000,000	99,847,000	
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,770,000	
	第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	98,386,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,219,000	
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,959,000	

第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	98,485,000	
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	100,101,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,858,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,508,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,353,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,475,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,843,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,239,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,939,000	
第521回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,078,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,155,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,534,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,929,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	99,940,000	
社債券合計	3,500,000,000	3,506,701,000	
合計		84,216,532,479	

## 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)

2020年 7月27日現在

資産の部	
流動資産	
預金	30,999,557
コール・ローン	211,443,246
国債証券	25,536,153,425
派生商品評価勘定	146,566
未収利息	153,656,298
前払費用	17,019,555
流動資産合計	25,949,418,647

2020年 7月27日現在

資産合計	25,949,418,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	377,982
未払金	89,547,628
未払利息	573
流動負債合計	89,926,183
負債合計	89,926,183
純資産の部	
元本等	
元本	24,423,897,140
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,435,595,324
元本等合計	25,859,492,464
純資産合計	25,859,492,464
負債純資産合計	25,949,418,647

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	36,298,086,669円
期中追加設定元本額	14,920,761,187円
期中一部解約元本額	26,794,950,716円
期末元本額	24,423,897,140円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	3,016,415,576円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	422,914,688円
りそなラップ型ファンド(成長型)	219,654,805円
DCりそな グローバルバランス	60,133,128円
つみたてバランスファンド	361,996,029円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	595,153,436円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	119,139,010円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	27,819,435円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	7,198,311円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,501,354円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	263,298円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	57,905円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	177,309,634円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	69,372,284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)	17,886,693,976円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	417,945,347円
Smart-i 8資産バランス 安定型	189,929,617円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	120,854,792円
Smart-i 8資産バランス 成長型	47,885,039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)	645,692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)	680,013,784円
2. 計算日における受益権の総数	24,423,897,140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	1.0588円
(10,000口当たり純資産額)	(10,588円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

1.金融商品に対する取組方針

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

2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.時価の算定方法	
国債証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2020年 7月27日現在	
該当事項はありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		808,020,703
合計		808,020,703

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2020年 7月27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	82,762,652	-	82,531,236	231,416
	米ドル	33,977,077	-	33,668,742	308,335
	カナダドル	3,796,022	-	3,776,200	19,822
	ユーロ	35,577,994	-	35,724,560	146,566
	英ポンド	5,829,234	-	5,819,814	9,420
	オーストラリアドル	3,582,325	-	3,541,920	40,405
	合計	82,762,652	-	82,531,236	231,416

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券



種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ド	US TREASURY N/B	420,000.00	423,880.04	
		US TREASURY N/B	240,000.00	245,760.93	
		US TREASURY N/B	470,000.00	474,672.45	
		US TREASURY N/B	180,000.00	182,928.51	
		US TREASURY N/B	550,000.00	561,440.38	
		US TREASURY N/B	390,000.00	400,656.43	
		US TREASURY N/B	250,000.00	252,685.52	
		US TREASURY N/B	620,000.00	629,130.43	
		US TREASURY N/B	390,000.00	401,486.70	
		US TREASURY N/B	340,000.00	343,891.53	
		US TREASURY N/B	600,000.00	613,898.40	
		US TREASURY N/B	80,000.00	82,650.00	
		US TREASURY N/B	680,000.00	689,442.95	
		US TREASURY N/B	390,000.00	396,634.56	
		US TREASURY N/B	810,000.00	829,538.01	
		US TREASURY N/B	570,000.00	590,116.95	
		US TREASURY N/B	590,000.00	602,595.08	
		US TREASURY N/B	600,000.00	613,910.10	
		US TREASURY N/B	700,000.00	712,673.78	
		US TREASURY N/B	500,000.00	517,099.60	
		US TREASURY N/B	560,000.00	574,710.92	
		US TREASURY N/B	500,000.00	510,498.00	
		US TREASURY N/B	600,000.00	620,601.54	
		US TREASURY N/B	380,000.00	387,718.75	
		US TREASURY N/B	490,000.00	502,709.37	
		US TREASURY N/B	500,000.00	509,218.75	
		US TREASURY N/B	340,000.00	349,748.41	
		US TREASURY N/B	470,000.00	481,951.91	
		US TREASURY N/B	650,000.00	667,824.17	
		US TREASURY N/B	700,000.00	725,429.67	
		US TREASURY N/B	410,000.00	420,954.66	
		US TREASURY N/B	460,000.00	473,260.92	
US TREASURY N/B	500,000.00	518,007.80			

US TREASURY N/B	470,000.00	483,218.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	721,218.75	
US TREASURY N/B	280,000.00	288,039.05	
US TREASURY N/B	510,000.00	526,166.59	
US TREASURY N/B	550,000.00	566,156.25	
US TREASURY N/B	470,000.00	484,191.78	
US TREASURY N/B	390,000.00	404,784.93	
US TREASURY N/B	410,000.00	422,604.26	
US TREASURY N/B	650,000.00	649,746.04	
US TREASURY N/B	450,000.00	464,124.01	
US TREASURY N/B	360,000.00	373,373.42	
US TREASURY N/B	400,000.00	413,843.72	
US TREASURY N/B	270,000.00	278,163.26	
US TREASURY N/B	390,000.00	404,030.83	
US TREASURY N/B	480,000.00	494,793.74	
US TREASURY N/B	560,000.00	576,209.36	
US TREASURY N/B	520,000.00	538,037.50	
US TREASURY N/B	350,000.00	363,145.47	
US TREASURY N/B	430,000.00	441,615.03	
US TREASURY N/B	430,000.00	446,712.85	
US TREASURY N/B	410,000.00	427,056.61	
US TREASURY N/B	630,000.00	651,200.94	
US TREASURY N/B	670,000.00	698,841.35	
US TREASURY N/B	270,000.00	279,481.61	
US TREASURY N/B	720,000.00	754,312.46	
US TREASURY N/B	300,000.00	309,908.19	
US TREASURY N/B	400,000.00	415,953.12	
US TREASURY N/B	560,000.00	591,062.47	
US TREASURY N/B	650,000.00	680,443.33	
US TREASURY N/B	300,000.00	310,417.95	
US TREASURY N/B	390,000.00	403,985.12	
US TREASURY N/B	410,000.00	435,640.99	
US TREASURY N/B	700,000.00	701,667.96	
US TREASURY N/B	150,000.00	156,032.22	
US TREASURY N/B	420,000.00	449,867.53	

US TREASURY N/B	640,000.00	668,349.94
US TREASURY N/B	530,000.00	529,409.95
US TREASURY N/B	320,000.00	333,256.22
US TREASURY N/B	400,000.00	429,320.28
US TREASURY N/B	250,000.00	250,605.45
US TREASURY N/B	470,000.00	486,615.20
US TREASURY N/B	550,000.00	589,509.74
US TREASURY N/B	40,000.00	41,299.21
US TREASURY N/B	320,000.00	344,793.72
US TREASURY N/B	460,000.00	492,622.23
US TREASURY N/B	190,000.00	197,013.75
US TREASURY N/B	130,000.00	140,316.20
US TREASURY N/B	540,000.00	560,503.31
US TREASURY N/B	480,000.00	521,034.33
US TREASURY N/B	540,000.00	565,407.37
US TREASURY N/B	150,000.00	163,122.06
US TREASURY N/B	710,000.00	769,933.94
US TREASURY N/B	440,000.00	468,471.08
US TREASURY N/B	340,000.00	370,467.16
US TREASURY N/B	140,000.00	149,862.88
US TREASURY N/B	450,000.00	487,450.17
US TREASURY N/B	420,000.00	450,261.29
US TREASURY N/B	690,000.00	752,409.94
US TREASURY N/B	490,000.00	523,792.75
US TREASURY N/B	340,000.00	366,496.06
US TREASURY N/B	890,000.00	952,612.83
US TREASURY N/B	320,000.00	341,512.48
US TREASURY N/B	850,000.00	923,760.70
US TREASURY N/B	560,000.00	598,270.28
US TREASURY N/B	390,000.00	417,170.48
US TREASURY N/B	420,000.00	445,191.76
US TREASURY N/B	220,000.00	236,719.12
US TREASURY N/B	420,000.00	445,651.16
US TREASURY N/B	790,000.00	858,584.95
US TREASURY N/B	400,000.00	426,898.40

US TREASURY N/B	600,000.00	625,042.92
US TREASURY N/B	220,000.00	237,320.68
US TREASURY N/B	260,000.00	273,721.08
US TREASURY N/B	310,000.00	336,434.75
US TREASURY N/B	530,000.00	558,425.38
US TREASURY N/B	750,000.00	814,526.32
US TREASURY N/B	400,000.00	432,679.68
US TREASURY N/B	450,000.00	474,521.44
US TREASURY N/B	400,000.00	435,335.92
US TREASURY N/B	400,000.00	426,476.56
US TREASURY N/B	430,000.00	473,461.90
US TREASURY N/B	550,000.00	577,757.78
US TREASURY N/B	730,000.00	787,772.63
US TREASURY N/B	340,000.00	378,781.25
US TREASURY N/B	250,000.00	277,495.10
US TREASURY N/B	600,000.00	606,750.00
US TREASURY N/B	250,000.00	280,922.85
US TREASURY N/B	600,000.00	603,234.36
US TREASURY N/B	570,000.00	620,542.92
US TREASURY N/B	240,000.00	270,107.80
US TREASURY N/B	600,000.00	599,707.02
US TREASURY N/B	290,000.00	325,156.81
US TREASURY N/B	470,000.00	530,686.87
US TREASURY N/B	580,000.00	629,877.68
US TREASURY N/B	310,000.00	348,634.95
US TREASURY N/B	230,000.00	261,988.86
US TREASURY N/B	570,000.00	650,345.49
US TREASURY N/B	450,000.00	495,958.00
US TREASURY N/B	480,000.00	545,371.87
US TREASURY N/B	300,000.00	337,300.77
US TREASURY N/B	330,000.00	371,507.79
US TREASURY N/B	570,000.00	610,579.09
US TREASURY N/B	350,000.00	392,205.05
US TREASURY N/B	430,000.00	476,325.74
US TREASURY N/B	450,000.00	502,154.28

US TREASURY N/B	900,000.00	965,654.28	
US TREASURY N/B	470,000.00	518,138.24	
US TREASURY N/B	450,000.00	489,919.90	
US TREASURY N/B	590,000.00	642,869.48	
US TREASURY N/B	610,000.00	651,127.59	
US TREASURY N/B	320,000.00	339,224.98	
US TREASURY N/B	400,000.00	430,335.92	
US TREASURY N/B	300,000.00	322,898.43	
US TREASURY N/B	850,000.00	934,933.53	
US TREASURY N/B	300,000.00	323,074.20	
US TREASURY N/B	100,000.00	108,542.96	
US TREASURY N/B	840,000.00	939,848.36	
US TREASURY N/B	530,000.00	532,484.37	
US TREASURY N/B	580,000.00	655,751.13	
US TREASURY N/B	470,000.00	472,001.16	
US TREASURY N/B	800,000.00	900,484.31	
US TREASURY N/B	610,000.00	688,537.50	
US TREASURY N/B	850,000.00	993,653.31	
US TREASURY N/B	680,000.00	804,352.28	
US TREASURY N/B	120,000.00	167,657.80	
US TREASURY N/B	700,000.00	831,003.87	
US TREASURY N/B	690,000.00	836,341.96	
US TREASURY N/B	310,000.00	433,297.63	
US TREASURY N/B	730,000.00	858,035.12	
US TREASURY N/B	680,000.00	787,471.82	
US TREASURY N/B	560,000.00	613,473.39	
US TREASURY N/B	710,000.00	787,406.61	
US TREASURY N/B	1,160,000.00	1,260,820.24	
US TREASURY N/B	120,000.00	185,456.24	
US TREASURY N/B	150,000.00	150,530.26	
US TREASURY N/B	200,000.00	298,527.34	
US TREASURY N/B	80,000.00	124,010.93	
US TREASURY N/B	90,000.00	149,603.90	
US TREASURY N/B	30,000.00	47,380.07	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,382.81	

US TREASURY N/B	70,000.00	100,942.18
US TREASURY N/B	140,000.00	220,368.75
US TREASURY N/B	190,000.00	308,415.99
US TREASURY N/B	40,000.00	64,148.43
US TREASURY N/B	190,000.00	314,286.71
US TREASURY N/B	210,000.00	338,674.20
US TREASURY N/B	650,000.00	661,946.27
US TREASURY N/B	150,000.00	228,480.46
US TREASURY N/B	210,000.00	335,479.09
US TREASURY N/B	230,000.00	390,249.78
US TREASURY N/B	50,000.00	81,397.46
US TREASURY N/B	230,000.00	347,735.73
US TREASURY N/B	130,000.00	181,002.14
US TREASURY N/B	180,000.00	251,367.17
US TREASURY N/B	80,000.00	109,667.18
US TREASURY N/B	300,000.00	396,533.19
US TREASURY N/B	190,000.00	251,030.06
US TREASURY N/B	320,000.00	447,174.97
US TREASURY N/B	360,000.00	485,437.50
US TREASURY N/B	360,000.00	541,701.54
US TREASURY N/B	320,000.00	490,587.48
US TREASURY N/B	410,000.00	618,683.56
US TREASURY N/B	390,000.00	569,095.29
US TREASURY N/B	430,000.00	605,577.71
US TREASURY N/B	380,000.00	525,721.06
US TREASURY N/B	350,000.00	446,591.77
US TREASURY N/B	390,000.00	541,033.58
US TREASURY N/B	480,000.00	653,765.61
US TREASURY N/B	290,000.00	403,955.26
US TREASURY N/B	330,000.00	423,192.75
US TREASURY N/B	460,000.00	590,947.23
US TREASURY N/B	380,000.00	467,296.07
US TREASURY N/B	350,000.00	481,284.16
US TREASURY N/B	440,000.00	619,557.79
US TREASURY N/B	400,000.00	564,093.72

	US TREASURY N/B	380,000.00	514,439.82
	US TREASURY N/B	420,000.00	569,723.40
	US TREASURY N/B	520,000.00	737,790.61
	US TREASURY N/B	530,000.00	769,410.91
	US TREASURY N/B	630,000.00	897,762.28
	US TREASURY N/B	560,000.00	851,484.36
	US TREASURY N/B	640,000.00	916,024.96
	US TREASURY N/B	590,000.00	828,143.35
	US TREASURY N/B	470,000.00	587,756.99
	US TREASURY N/B	530,000.00	680,118.31
	US TREASURY N/B	540,000.00	643,517.54
	US TREASURY N/B	520,000.00	521,584.33
	米ドル 小計	96,050,000.00	107,761,993.26 (11,403,374,126)
カナダドル	GOV OF CANADA	60,000.00	60,808.20
	GOV OF CANADA	210,000.00	211,318.80
	GOV OF CANADA	180,000.00	182,413.80
	GOV OF CANADA	100,000.00	101,958.00
	GOV OF CANADA	210,000.00	210,978.60
	GOV OF CANADA	200,000.00	204,520.00
	GOV OF CANADA	120,000.00	125,590.80
	GOV OF CANADA	510,000.00	518,200.80
	GOV OF CANADA	250,000.00	259,685.00
	GOV OF CANADA	190,000.00	196,667.10
	GOV OF CANADA	200,000.00	210,656.00
	GOV OF CANADA	110,000.00	117,730.80
	GOV OF CANADA	160,000.00	173,502.40
	GOV OF CANADA	120,000.00	125,878.80
	GOV OF CANADA	200,000.00	208,558.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	163,884.00
	GOV OF CANADA	250,000.00	252,230.00
	GOV OF CANADA	140,000.00	149,427.60
	GOV OF CANADA	120,000.00	125,096.40
	GOV OF CANADA	60,000.00	90,816.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	168,423.00

	GOV OF CANADA	120,000.00	175,141.20
	GOV OF CANADA	130,000.00	150,394.40
	GOV OF CANADA	320,000.00	343,280.00
	GOV OF CANADA	130,000.00	211,837.60
	GOV OF CANADA	130,000.00	216,808.80
	GOV OF CANADA	140,000.00	223,269.20
	GOV OF CANADA	190,000.00	299,616.70
	GOV OF CANADA	170,000.00	245,780.90
	GOV OF CANADA	180,000.00	230,673.60
	GOV OF CANADA	50,000.00	82,198.50
	カナダドル 小計	5,250,000.00	6,037,345.00 (477,010,628)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	2,630,000.00	2,722,603.35
	UNITED MEXICAN STATE	3,200,000.00	3,309,978.56
	UNITED MEXICAN STATE	2,010,000.00	2,115,223.50
	UNITED MEXICAN STATE	2,970,000.00	3,273,831.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,600,000.00	2,904,096.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,900,000.00	3,477,448.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,320,000.00	2,383,660.80
	UNITED MEXICAN STATE	3,360,000.00	3,750,734.40
	UNITED MEXICAN STATE	3,400,000.00	4,050,386.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,570,000.00	1,791,621.20
	UNITED MEXICAN STATE	1,110,000.00	1,269,817.80
	UNITED MEXICAN STATE	880,000.00	1,201,516.80
	UNITED MEXICAN STATE	2,230,000.00	2,685,767.40
	UNITED MEXICAN STATE	2,350,000.00	2,617,195.00
	UNITED MEXICAN STATE	1,820,000.00	2,071,851.60
	メキシコペソ 小計	35,350,000.00	39,625,731.41 (188,618,481)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	198,837.28
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	128,918.40
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	121,596.24
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	65,640.96
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	101,626.90
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	122,124.72
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	161,536.50



GOV OF AUSTRIA	60,000.00	61,366.44
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	131,548.08
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	152,920.55
GOV OF AUSTRIA	120,000.00	157,116.48
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	150,930.92
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	138,393.32
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	191,283.04
GOV OF AUSTRIA	110,000.00	119,537.88
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	139,198.54
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	81,960.00
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	134,126.50
GOV OF AUSTRIA	140,000.00	236,119.24
GOV OF AUSTRIA	80,000.00	136,762.36
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	133,047.00
GOV OF AUSTRIA	30,000.00	34,149.99
GOV OF AUSTRIA	50,000.00	116,479.42
GOV OF AUSTRIA	74,000.00	150,119.36
GOV OF AUSTRIA	30,000.00	46,750.95
GOV OF BELGIUM	180,000.00	190,253.52
GOV OF BELGIUM	160,000.00	172,504.00
GOV OF BELGIUM	200,000.00	221,372.49
GOV OF BELGIUM	160,000.00	173,416.96
GOV OF BELGIUM	120,000.00	123,151.52
GOV OF BELGIUM	190,000.00	213,721.69
GOV OF BELGIUM	160,000.00	167,132.96
GOV OF BELGIUM	200,000.00	213,063.60
GOV OF BELGIUM	130,000.00	166,976.43
GOV OF BELGIUM	190,000.00	206,294.40
GOV OF BELGIUM	140,000.00	151,376.96
GOV OF BELGIUM	60,000.00	61,460.26
GOV OF BELGIUM	290,000.00	421,229.58
GOV OF BELGIUM	140,000.00	152,361.31
GOV OF BELGIUM	190,000.00	209,469.11
GOV OF BELGIUM	120,000.00	123,199.96
GOV OF BELGIUM	150,000.00	168,037.35

GOV OF BELGIUM	50,000.00	73,846.32	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	127,881.38	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	126,940.14	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	463,471.09	
GOV OF BELGIUM	60,000.00	72,337.57	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	116,029.80	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	70,668.78	
GOV OF BELGIUM	220,000.00	390,250.08	
GOV OF BELGIUM	120,000.00	212,688.36	
GOV OF BELGIUM	130,000.00	165,218.30	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	131,471.80	
GOV OF BELGIUM	60,000.00	92,291.82	
GOV OF BELGIUM	80,000.00	127,182.81	
GOV OF FINLAND	60,000.00	60,630.24	
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,893.56	
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,196.78	
GOV OF FINLAND	20,000.00	20,382.20	
GOV OF FINLAND	90,000.00	98,838.99	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,216.95	
GOV OF FINLAND	80,000.00	98,413.12	
GOV OF FINLAND	50,000.00	53,694.45	
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,216.40	
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,958.83	
GOV OF FINLAND	60,000.00	75,082.74	
GOV OF FINLAND	60,000.00	64,220.34	
GOV OF FINLAND	80,000.00	85,764.56	
GOV OF FINLAND	60,000.00	66,235.68	
GOV OF FINLAND	50,000.00	58,253.17	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,041.51	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,414.40	
GOV OF FINLAND	50,000.00	77,625.84	
GOV OF FINLAND	40,000.00	52,617.83	
GOV OF FRANCE	330,000.00	345,942.63	
GOV OF FRANCE	400,000.00	403,946.86	
GOV OF FRANCE	580,000.00	616,917.00	

GOV OF FRANCE	340,000.00	343,883.48	
GOV OF FRANCE	480,000.00	511,134.24	
GOV OF FRANCE	250,000.00	253,811.25	
GOV OF FRANCE	500,000.00	508,132.00	
GOV OF FRANCE	620,000.00	661,534.78	
GOV OF FRANCE	560,000.00	649,262.88	
GOV OF FRANCE	440,000.00	449,239.56	
GOV OF FRANCE	410,000.00	454,829.40	
GOV OF FRANCE	430,000.00	473,456.23	
GOV OF FRANCE	450,000.00	460,980.90	
GOV OF FRANCE	510,000.00	535,617.30	
GOV OF FRANCE	340,000.00	458,218.00	
GOV OF FRANCE	350,000.00	378,335.89	
GOV OF FRANCE	270,000.00	276,763.50	
GOV OF FRANCE	520,000.00	640,398.20	
GOV OF FRANCE	440,000.00	465,081.76	
GOV OF FRANCE	490,000.00	511,148.40	
GOV OF FRANCE	380,000.00	416,513.59	
GOV OF FRANCE	570,000.00	701,131.92	
GOV OF FRANCE	390,000.00	423,160.92	
GOV OF FRANCE	390,000.00	424,246.68	
GOV OF FRANCE	620,000.00	938,111.46	
GOV OF FRANCE	380,000.00	405,719.50	
GOV OF FRANCE	510,000.00	520,310.16	
GOV OF FRANCE	520,000.00	659,535.33	
GOV OF FRANCE	510,000.00	601,379.76	
GOV OF FRANCE	490,000.00	843,882.90	
GOV OF FRANCE	320,000.00	373,893.79	
GOV OF FRANCE	410,000.00	695,151.72	
GOV OF FRANCE	410,000.00	482,493.33	
GOV OF FRANCE	360,000.00	607,160.52	
GOV OF FRANCE	280,000.00	359,374.82	
GOV OF FRANCE	450,000.00	833,325.65	
GOV OF FRANCE	320,000.00	535,837.44	
GOV OF FRANCE	330,000.00	462,662.97	

GOV OF FRANCE	270,000.00	344,259.72	
GOV OF FRANCE	120,000.00	126,691.68	
GOV OF FRANCE	220,000.00	458,867.20	
GOV OF FRANCE	190,000.00	418,904.38	
GOV OF FRANCE	170,000.00	245,754.72	
GOV OF GERMANY	200,000.00	207,321.00	
GOV OF GERMANY	250,000.00	258,112.25	
GOV OF GERMANY	200,000.00	201,469.40	
GOV OF GERMANY	210,000.00	211,639.41	
GOV OF GERMANY	220,000.00	221,991.48	
GOV OF GERMANY	180,000.00	187,041.01	
GOV OF GERMANY	230,000.00	232,427.42	
GOV OF GERMANY	260,000.00	262,927.04	
GOV OF GERMANY	30,000.00	30,374.25	
GOV OF GERMANY	360,000.00	377,024.58	
GOV OF GERMANY	260,000.00	272,104.56	
GOV OF GERMANY	240,000.00	243,634.80	
GOV OF GERMANY	270,000.00	285,345.18	
GOV OF GERMANY	280,000.00	285,333.44	
GOV OF GERMANY	250,000.00	265,509.00	
GOV OF GERMANY	340,000.00	368,350.22	
GOV OF GERMANY	160,000.00	163,651.20	
GOV OF GERMANY	320,000.00	348,187.20	
GOV OF GERMANY	360,000.00	369,252.00	
GOV OF GERMANY	210,000.00	227,711.61	
GOV OF GERMANY	290,000.00	310,085.11	
GOV OF GERMANY	320,000.00	329,194.56	
GOV OF GERMANY	310,000.00	326,917.13	
GOV OF GERMANY	250,000.00	257,943.00	
GOV OF GERMANY	320,000.00	347,443.20	
GOV OF GERMANY	410,000.00	436,956.68	
GOV OF GERMANY	370,000.00	384,769.66	
GOV OF GERMANY	310,000.00	328,302.09	
GOV OF GERMANY	140,000.00	210,727.51	
GOV OF GERMANY	360,000.00	388,848.60	

GOV OF GERMANY	100,000.00	104,318.58	
GOV OF GERMANY	170,000.00	250,500.69	
GOV OF GERMANY	360,000.00	390,401.87	
GOV OF GERMANY	190,000.00	272,313.89	
GOV OF GERMANY	300,000.00	320,221.80	
GOV OF GERMANY	200,000.00	213,898.60	
GOV OF GERMANY	290,000.00	303,715.45	
GOV OF GERMANY	210,000.00	348,115.42	
GOV OF GERMANY	310,000.00	324,565.66	
GOV OF GERMANY	110,000.00	115,055.05	
GOV OF GERMANY	300,000.00	491,933.94	
GOV OF GERMANY	240,000.00	416,392.43	
GOV OF GERMANY	120,000.00	124,905.84	
GOV OF GERMANY	330,000.00	569,220.35	
GOV OF GERMANY	230,000.00	430,844.44	
GOV OF GERMANY	250,000.00	504,687.95	
GOV OF GERMANY	240,000.00	424,939.14	
GOV OF GERMANY	350,000.00	575,108.10	
GOV OF GERMANY	380,000.00	639,114.40	
GOV OF GERMANY	250,000.00	341,838.75	
GOV OF GERMANY	180,000.00	181,514.70	
GOV OF IRELAND	80,000.00	81,820.27	
GOV OF IRELAND	50,000.00	50,632.23	
GOV OF IRELAND	90,000.00	100,724.20	
GOV OF IRELAND	110,000.00	125,711.96	
GOV OF IRELAND	140,000.00	178,182.28	
GOV OF IRELAND	140,000.00	151,276.16	
GOV OF IRELAND	80,000.00	82,629.60	
GOV OF IRELAND	100,000.00	108,944.93	
GOV OF IRELAND	120,000.00	133,493.58	
GOV OF IRELAND	120,000.00	149,712.00	
GOV OF IRELAND	70,000.00	71,909.74	
GOV OF IRELAND	70,000.00	80,499.58	
GOV OF IRELAND	60,000.00	69,553.96	
GOV OF IRELAND	50,000.00	51,746.60	

GOV OF IRELAND	60,000.00	74,423.28	
GOV OF IRELAND	120,000.00	164,482.08	
GOV OF IRELAND	50,000.00	62,885.45	
GOV OF ITALY	350,000.00	363,848.80	
GOV OF ITALY	310,000.00	326,742.48	
GOV OF ITALY	200,000.00	206,036.00	
GOV OF ITALY	190,000.00	191,252.86	
GOV OF ITALY	70,000.00	72,252.81	
GOV OF ITALY	260,000.00	281,426.08	
GOV OF ITALY	210,000.00	214,565.61	
GOV OF ITALY	220,000.00	225,435.54	
GOV OF ITALY	150,000.00	153,171.90	
GOV OF ITALY	170,000.00	173,352.40	
GOV OF ITALY	230,000.00	256,789.36	
GOV OF ITALY	210,000.00	216,657.00	
GOV OF ITALY	340,000.00	382,109.00	
GOV OF ITALY	190,000.00	190,254.22	
GOV OF ITALY	240,000.00	245,699.28	
GOV OF ITALY	200,000.00	204,824.40	
GOV OF ITALY	250,000.00	280,743.00	
GOV OF ITALY	180,000.00	182,835.54	
GOV OF ITALY	340,000.00	387,600.68	
GOV OF ITALY	340,000.00	365,045.08	
GOV OF ITALY	200,000.00	203,456.60	
GOV OF ITALY	340,000.00	391,805.46	
GOV OF ITALY	230,000.00	243,792.64	
GOV OF ITALY	200,000.00	211,288.80	
GOV OF ITALY	270,000.00	307,174.41	
GOV OF ITALY	200,000.00	209,449.00	
GOV OF ITALY	250,000.00	272,783.75	
GOV OF ITALY	150,000.00	149,816.22	
GOV OF ITALY	290,000.00	350,598.40	
GOV OF ITALY	200,000.00	209,530.00	
GOV OF ITALY	240,000.00	252,240.00	
GOV OF ITALY	160,000.00	170,607.92	

GOV OF ITALY	220,000.00	242,845.90	
GOV OF ITALY	240,000.00	258,939.84	
GOV OF ITALY	270,000.00	328,469.04	
GOV OF ITALY	240,000.00	254,201.28	
GOV OF ITALY	300,000.00	326,074.50	
GOV OF ITALY	280,000.00	290,900.12	
GOV OF ITALY	250,000.00	252,949.50	
GOV OF ITALY	150,000.00	164,850.00	
GOV OF ITALY	240,000.00	261,414.00	
GOV OF ITALY	350,000.00	490,416.50	
GOV OF ITALY	290,000.00	315,708.79	
GOV OF ITALY	300,000.00	391,489.44	
GOV OF ITALY	280,000.00	323,803.20	
GOV OF ITALY	250,000.00	295,106.00	
GOV OF ITALY	360,000.00	497,342.88	
GOV OF ITALY	320,000.00	393,792.64	
GOV OF ITALY	280,000.00	289,660.00	
GOV OF ITALY	200,000.00	198,963.20	
GOV OF ITALY	170,000.00	179,701.22	
GOV OF ITALY	270,000.00	403,554.44	
GOV OF ITALY	280,000.00	295,620.92	
GOV OF ITALY	260,000.00	394,669.75	
GOV OF ITALY	200,000.00	228,190.00	
GOV OF ITALY	310,000.00	452,900.11	
GOV OF ITALY	180,000.00	226,308.72	
GOV OF ITALY	160,000.00	161,053.62	
GOV OF ITALY	190,000.00	212,111.63	
GOV OF ITALY	300,000.00	407,091.00	
GOV OF ITALY	160,000.00	193,929.95	
GOV OF ITALY	270,000.00	417,523.24	
GOV OF ITALY	150,000.00	185,347.05	
GOV OF ITALY	280,000.00	435,611.68	
GOV OF ITALY	230,000.00	359,629.42	
GOV OF ITALY	210,000.00	268,590.37	
GOV OF ITALY	220,000.00	257,341.48	

GOV OF ITALY	200,000.00	265,580.00	
GOV OF ITALY	170,000.00	241,716.71	
GOV OF ITALY	100,000.00	111,372.50	
GOV OF ITALY	120,000.00	142,206.06	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	186,729.04	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	191,717.98	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	190,295.64	
GOV OF NETHERLANDS	180,000.00	199,739.16	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	214,307.62	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	194,080.63	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	210,030.56	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	197,999.00	
GOV OF NETHERLANDS	210,000.00	223,273.11	
GOV OF NETHERLANDS	60,000.00	61,940.64	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	173,945.92	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	218,033.70	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	175,581.60	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	179,873.68	
GOV OF NETHERLANDS	170,000.00	175,556.28	
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	188,679.40	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	337,908.57	
GOV OF NETHERLANDS	110,000.00	122,093.21	
GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	365,379.80	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	329,347.52	
GOV OF SPAIN	230,000.00	232,764.83	
GOV OF SPAIN	230,000.00	231,410.59	
GOV OF SPAIN	280,000.00	306,619.60	
GOV OF SPAIN	260,000.00	263,672.03	
GOV OF SPAIN	230,000.00	234,417.15	
GOV OF SPAIN	280,000.00	320,713.40	
GOV OF SPAIN	250,000.00	252,350.50	
GOV OF SPAIN	260,000.00	265,340.92	
GOV OF SPAIN	260,000.00	300,493.18	
GOV OF SPAIN	250,000.00	295,227.50	
GOV OF SPAIN	250,000.00	288,805.50	



GOV OF SPAIN	220,000.00	224,712.62	
GOV OF SPAIN	260,000.00	293,508.02	
GOV OF SPAIN	220,000.00	222,080.10	
GOV OF SPAIN	190,000.00	206,397.19	
GOV OF SPAIN	250,000.00	310,814.40	
GOV OF SPAIN	300,000.00	336,470.70	
GOV OF SPAIN	300,000.00	335,811.60	
GOV OF SPAIN	280,000.00	381,020.64	
GOV OF SPAIN	320,000.00	347,531.84	
GOV OF SPAIN	190,000.00	209,468.84	
GOV OF SPAIN	180,000.00	189,442.76	
GOV OF SPAIN	250,000.00	275,067.42	
GOV OF SPAIN	260,000.00	285,975.30	
GOV OF SPAIN	250,000.00	275,429.50	
GOV OF SPAIN	200,000.00	281,851.06	
GOV OF SPAIN	340,000.00	507,051.86	
GOV OF SPAIN	260,000.00	288,099.50	
GOV OF SPAIN	260,000.00	268,598.99	
GOV OF SPAIN	260,000.00	265,470.75	
GOV OF SPAIN	290,000.00	337,062.07	
GOV OF SPAIN	240,000.00	261,673.92	
GOV OF SPAIN	310,000.00	502,948.11	
GOV OF SPAIN	180,000.00	221,345.88	
GOV OF SPAIN	160,000.00	187,386.56	
GOV OF SPAIN	250,000.00	386,934.16	
GOV OF SPAIN	240,000.00	419,230.27	
GOV OF SPAIN	130,000.00	136,927.18	
GOV OF SPAIN	260,000.00	450,160.63	
GOV OF SPAIN	170,000.00	321,558.91	
GOV OF SPAIN	180,000.00	255,486.60	
GOV OF SPAIN	180,000.00	249,411.25	
GOV OF SPAIN	110,000.00	105,893.77	
GOV OF SPAIN	170,000.00	291,184.77	
□ 小計	70,374,000.00	84,602,420.34	(10,465,319,396)

英bond	UK TREASURY	170,000.00	177,193.21	
	UK TREASURY	180,000.00	191,879.10	
	UK TREASURY	300,000.00	303,584.76	
	UK TREASURY	320,000.00	332,537.34	
	UK TREASURY	150,000.00	150,828.00	
	UK TREASURY	240,000.00	246,315.60	
	UK TREASURY	230,000.00	246,907.30	
	UK TREASURY	310,000.00	323,156.52	
	UK TREASURY	40,000.00	44,736.09	
	UK TREASURY	250,000.00	309,019.40	
	UK TREASURY	270,000.00	279,540.93	
	UK TREASURY	240,000.00	266,147.52	
	UK TREASURY	170,000.00	186,150.00	
	UK TREASURY	190,000.00	206,932.80	
	UK TREASURY	180,000.00	236,555.35	
	UK TREASURY	180,000.00	203,703.51	
	UK TREASURY	170,000.00	253,895.00	
	UK TREASURY	180,000.00	192,995.28	
	UK TREASURY	200,000.00	203,860.00	
	UK TREASURY	190,000.00	279,972.60	
	UK TREASURY	210,000.00	307,509.00	
	UK TREASURY	160,000.00	250,565.74	
	UK TREASURY	230,000.00	361,409.12	
	UK TREASURY	320,000.00	383,324.09	
	UK TREASURY	190,000.00	330,450.66	
	UK TREASURY	190,000.00	317,274.08	
	UK TREASURY	220,000.00	374,110.90	
	UK TREASURY	90,000.00	101,146.64	
	UK TREASURY	240,000.00	434,060.64	
	UK TREASURY	230,000.00	359,700.15	
	UK TREASURY	280,000.00	459,727.80	
	UK TREASURY	220,000.00	410,839.26	
	UK TREASURY	250,000.00	301,956.35	
UK TREASURY	150,000.00	192,553.20		
UK TREASURY	160,000.00	313,308.48		

	UK TREASURY	50,000.00	49,345.95
	UK TREASURY	190,000.00	361,105.03
	UK TREASURY	120,000.00	156,198.48
	UK TREASURY	230,000.00	494,873.06
	UK TREASURY	210,000.00	289,946.79
	UK TREASURY	160,000.00	352,701.76
	UK TREASURY	70,000.00	68,000.80
	UK TREASURY	190,000.00	334,651.59
	UK TREASURY	180,000.00	402,413.11
	UK TREASURY	120,000.00	181,905.60
	英bond 小計	8,820,000.00	12,224,988.59 (1,658,564,202)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,320,000.00	1,413,470.52
	GOV OF SWEDEN	1,110,000.00	1,177,060.65
	GOV OF SWEDEN	840,000.00	953,631.84
	GOV OF SWEDEN	690,000.00	743,863.73
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	707,208.08
	GOV OF SWEDEN	660,000.00	710,117.10
	GOV OF SWEDEN	570,000.00	894,677.70
	スウェーデンクローナ 小計	5,850,000.00	6,600,029.62 (79,332,356)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	980,000.00	1,031,597.00
	GOV OF NORWAY	710,000.00	782,100.50
	GOV OF NORWAY	610,000.00	652,396.22
	GOV OF NORWAY	410,000.00	437,158.40
	GOV OF NORWAY	490,000.00	533,400.86
	GOV OF NORWAY	440,000.00	491,700.00
	GOV OF NORWAY	480,000.00	531,484.80
	GOV OF NORWAY	520,000.00	559,803.40
	ノルウェークローネ 小計	4,640,000.00	5,019,641.18 (58,378,426)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	820,000.00	858,403.88
	GOV OF DENMARK	470,000.00	479,213.68
	GOV OF DENMARK	710,000.00	759,455.05
	GOV OF DENMARK	910,000.00	1,021,168.14
	GOV OF DENMARK	970,000.00	1,036,388.74

	GOV OF DENMARK	1,070,000.00	1,153,845.20
	GOV OF DENMARK	1,620,000.00	3,060,375.68
	デンマーククローネ 小計	6,570,000.00	8,368,850.37 (139,090,293)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	320,000.00	325,502.59
	GOV OF POLAND	180,000.00	192,933.00
	GOV OF POLAND	500,000.00	519,323.00
	GOV OF POLAND	500,000.00	561,140.00
	GOV OF POLAND	550,000.00	582,556.19
	GOV OF POLAND	330,000.00	369,679.20
	GOV OF POLAND	340,000.00	366,296.11
	GOV OF POLAND	320,000.00	343,018.68
	GOV OF POLAND	360,000.00	404,051.36
	GOV OF POLAND	520,000.00	566,492.05
	GOV OF POLAND	390,000.00	426,128.66
	GOV OF POLAND	340,000.00	378,471.00
	GOV OF POLAND	80,000.00	110,648.00
	GOV OF POLAND	410,000.00	462,623.50
		ポーランドズロチ 小計	5,140,000.00
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	204,866.76
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	354,367.87
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	261,466.84
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	445,548.63
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	446,892.69
	GOV OF AUSTRALIA	250,000.00	248,660.29
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	453,369.54
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	496,886.24
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	407,743.16
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	402,143.00
	GOV OF AUSTRALIA	370,000.00	413,079.35
	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	371,222.27
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	482,754.91
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	410,045.40
	GOV OF AUSTRALIA	390,000.00	449,892.91
			250,000.00

	GOV OF AUSTRALIA		
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	179,884.82
	GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	206,007.82
	GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	297,556.77
	GOV OF AUSTRALIA	70,000.00	84,775.57
	GOV OF AUSTRALIA	150,000.00	204,210.31
	GOV OF AUSTRALIA	110,000.00	141,711.22
	GOV OF AUSTRALIA	90,000.00	108,298.00
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	216,160.18
	オーストラリアドル 小計	6,550,000.00	7,539,605.12 (568,260,037)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	60,708.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	102,594.50
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	127,224.00
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	41,488.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	117,887.00
	GOV OF SINGAPORE	10,000.00	10,580.00
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	121,660.00
	GOV OF SINGAPORE	20,000.00	21,803.50
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	54,520.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	106,605.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	79,940.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	106,020.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	59,850.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	77,970.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	58,782.50
	GOV OF SINGAPORE	40,000.00	48,617.60
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	91,630.00
	GOV OF SINGAPORE	70,000.00	94,640.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	35,589.15
	シンガポールドル 小計	1,240,000.00	1,418,109.25 (108,698,074)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	110,000.00	112,545.62
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	225,785.25
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	204,799.84
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,493.44

	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,245.92	
	GOV OF MALAYSIA	50,000.00	51,988.61	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	269,929.71	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	104,669.50	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	126,296.19	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	178,941.67	
	GOV OF MALAYSIA	200,000.00	216,148.28	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,921.25	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,795.52	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	207,021.83	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	212,279.09	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	142,194.41	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	131,637.92	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	107,372.50	
	GOV OF MALAYSIA	230,000.00	254,095.12	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	87,195.29	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	209,417.50	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	288,873.57	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	239,616.19	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	141,667.44	
	GOV OF MALAYSIA	40,000.00	47,099.73	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	109,673.76	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	78,045.87	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	214,063.25	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	144,734.25	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	236,530.84	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	167,474.72	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	93,782.25	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	181,399.98	
	GOV OF MALAYSIA	70,000.00	75,657.70	
	マレーシアリングット 小計	4,900,000.00	5,365,394.01 (133,437,349)	
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	220,000.00	244,046.00	
	GOV OF ISRAEL	480,000.00	486,408.00	
	GOV OF ISRAEL	50,000.00	51,762.50	

	GOV OF ISRAEL	380,000.00	400,349.00	
	GOV OF ISRAEL	100,000.00	101,135.00	
	GOV OF ISRAEL	220,000.00	239,569.00	
	GOV OF ISRAEL	210,000.00	295,827.00	
	GOV OF ISRAEL	240,000.00	266,364.00	
	GOV OF ISRAEL	240,000.00	277,260.00	
	GOV OF ISRAEL	100,000.00	103,620.00	
	GOV OF ISRAEL	220,000.00	397,419.00	
	GOV OF ISRAEL	210,000.00	311,377.50	
	イスラエルシュケル 小計	2,670,000.00	3,175,137.00 (98,460,998)	
	合計		25,536,153,425 (25,536,153,425)	

(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 220銘柄	100.0%	44.8%
カナダドル	国債証券 31銘柄	100.0%	1.9%
メキシコペソ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 320銘柄	100.0%	41.0%
英ポンド	国債証券 45銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 24銘柄	100.0%	2.2%
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git	国債証券 34銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券 12銘柄	100.0%	0.4%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

#### R A M新興国債券マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）	
2020年 7月27日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	21,845,899
コール・ローン	32,369,620
投資信託受益証券	4,563,128,476
未収配当金	74,691,677
流動資産合計	4,692,035,672
資産合計	4,692,035,672
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	15,973,053
未払解約金	1,117,000
未払利息	87
流動負債合計	17,090,140
負債合計	17,090,140
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	4,492,026,466
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	182,919,066
元本等合計	4,674,945,532
純資産合計	4,674,945,532
負債純資産合計	4,692,035,672

#### 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	為替予約取引



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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	2,904,392,071円
期中追加設定元本額	5,782,324,189円
期中一部解約元本額	4,194,689,794円
期末元本額	4,492,026,466円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	586,105,330円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	425,619,168円
りそなラップ型ファンド(成長型)	221,720,844円
DCりそな グローバルバランス	11,739,083円
つみたてバランスファンド	368,283,176円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	157,824,507円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	76,584,681円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	46,582,614円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	2,997,243円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,485,706円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	896,371円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,543,943円
リスクコントロール・オープン	1,379,388円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	68,393,904円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,721,497,948円
Smart-i 8資産バランス 安定型	23,809,063円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	61,287,205円
Smart-i 8資産バランス 成長型	61,135,328円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	183,199,474円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	131,675,317円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	83,655,722円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	53,876,350円

りそな・リスクコントロールファンド2020-03	171,192,549円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	27,892,044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)	649,508円
2. 計算日における受益権の総数	4,492,026,466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	1.0407円
(10,000口当たり純資産額)	(10,407円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

### (金融商品に関する注記)

#### 金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

## （関連当事者との取引に関する注記）

2020年 7月27日現在
該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		168,407,974
合計		168,407,974

(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	533,245	30,037,690.85	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	413,917	13,083,916.37	
		米ドル 小計	947,162	43,121,607.22 (4,563,128,476)	
	合計			4,563,128,476 (4,563,128,476)	

(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。

## R A M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2020年 7月27日現在

資産の部  
流動資産

2020年 7月27日現在

コール・ローン	381,489,801
投資証券	17,361,437,220
派生商品評価勘定	995,790
未収配当金	110,413,493
前払金	15,101,100
差入委託証拠金	64,965,000
流動資産合計	17,934,402,404
資産合計	17,934,402,404
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,385,440
未払解約金	36,789,000
未払利息	1,034
流動負債合計	50,175,474
負債合計	50,175,474
純資産の部	
元本等	
元本	15,468,007,281
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,416,219,649
元本等合計	17,884,226,930
純資産合計	17,884,226,930
負債純資産合計	17,934,402,404

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	11,378,192,415円
期中追加設定元本額	19,321,875,321円

期中一部解約元本額	15,232,060,455円
期末元本額	15,468,007,281円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	532,673,084円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	387,832,901円
りそなラップ型ファンド(成長型)	358,196,710円
DCりそな グローバルバランス	10,628,732円
つみたてバランスファンド	676,734,334円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	170,905,965円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	83,461,132円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	50,543,661円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	3,250,086円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,659,439円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	935,139円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,628,993円
リスクコントロール・オープン	1,228,751円
FWりそな国内リートインデックスオープン	3,320,684,790円
FWりそな国内リートインデックスファンド	2,288,566,569円
Smart-i Jリートインデックス	2,287,422,859円
Smart-i 8資産バランス 安定型	21,699,958円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	69,097,211円
Smart-i 8資産バランス 成長型	67,101,355円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	165,759,547円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	117,031,121円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	75,381,568円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	48,550,251円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	155,712,500円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	25,094,354円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	3,190,491,217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)	617,967円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,354,117,087円
2. 計算日における受益権の総数	15,468,007,281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	1.1562円
(10,000口当たり純資産額)	(11,562円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

2020年 7月27日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

### 1 有価証券に関する注記

#### 売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券	3,783,521,738	
合計	3,783,521,738	

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2020年 7月27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	519,452,150	-	507,062,500	12,389,650
合計		519,452,150	-	507,062,500	12,389,650

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 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	243	26,754,300	
	サンケイリアルエステート投資法人	289	27,830,700	
	S O S i L A 物流リート投資法人	444	65,001,600	
	日本アコモデーションファンド投資法人	663	455,481,000	



MCUBS MidCity投資法人	2,559	181,944,900
森ヒルズリート投資法人	2,295	319,464,000
産業ファンド投資法人	2,569	501,982,600
アドバンス・レジデンス投資法人	1,892	654,632,000
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,301	257,858,200
アクティビア・プロパティーズ投資法人	999	346,153,500
GLP投資法人	5,161	876,853,900
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	868	294,686,000
日本プロロジスリート投資法人	3,001	1,054,851,500
星野リゾート・リート投資法人	303	128,775,000
Oneリート投資法人	311	74,982,100
イオンリート投資法人	2,152	241,024,000
ヒューリックリート投資法人	1,696	209,456,000
日本リート投資法人	648	206,388,000
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	12,813	163,237,620
積水ハウス・リート投資法人	5,831	409,336,200
トーセイ・リート投資法人	434	44,224,600
ケネディクス商業リート投資法人	770	147,070,000
ヘルスケア&メディカル投資法人	425	52,445,000
サムティ・レジデンシャル投資法人	399	40,338,900
野村不動産マスターファンド投資法人	6,439	835,782,200
いちごホテルリート投資法人	330	20,493,000
ラサールロジポート投資法人	1,854	341,877,600
スターアジア不動産投資法人	662	60,970,200
マリモ地方創生リート投資法人	197	19,030,200
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	568	307,856,000
大江戸温泉リート投資法人	339	19,865,400
さくら総合リート投資法人	432	34,560,000
投資法人みらい	2,268	80,060,400
森トラスト・ホテルリート投資法人	468	42,775,200
三菱地所物流リート投資法人	393	178,422,000
CREロジスティクスファンド投資法人	454	72,503,800
ザイマックス・リート投資法人	289	25,143,000
タカラレーベン不動産投資法人	566	49,298,600
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	415	65,943,500
日本ビルファンド投資法人	1,931	1,162,462,000
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,994	1,102,682,000
日本リテールファンド投資法人	3,769	497,884,900
オリックス不動産投資法人	3,974	545,232,800
日本プライムリアルティ投資法人	1,311	384,647,400
プレミアム投資法人	1,801	211,797,600
東急リアル・エステート投資法人	1,337	183,035,300

グローバル・ワン不動産投資法人	1,385	136,007,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	4,478	456,756,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,425	177,127,500	
インヴィンシブル投資法人	8,748	226,573,200	
フロンティア不動産投資法人	708	216,648,000	
平和不動産リート投資法人	1,242	136,495,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,303	415,005,500	
福岡リート投資法人	1,031	129,390,500	
ケネディクス・オフィス投資法人	617	372,668,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,544	107,153,600	
大和証券オフィス投資法人	460	270,480,000	
阪急阪神リート投資法人	901	105,236,800	
スターツプロシード投資法人	311	64,439,200	
大和ハウスリート投資法人	2,846	788,626,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	6,425	267,280,000	
大和証券リビング投資法人	2,442	257,386,800	
ジャパンエクセレント投資法人	1,845	211,068,000	
合計	117,568	17,361,437,220	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R A M先進国リートマザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2020年 7月27日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	66,105,421
コール・ローン	35,554,433
投資証券	19,263,330,575
未収入金	19,548,139
未収配当金	31,796,000
流動資産合計	19,416,334,568
資産合計	19,416,334,568
<b>負債の部</b>	
流動負債	

2020年 7月27日現在

派生商品評価勘定	288,930
未払解約金	2,285,000
未払利息	96
流動負債合計	2,574,026
負債合計	2,574,026
純資産の部	
元本等	
元本	21,226,241,671
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,812,481,129
元本等合計	19,413,760,542
純資産合計	19,413,760,542
負債純資産合計	19,416,334,568

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 7月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2019年 7月26日
期首元本額	12,589,398,578円
期中追加設定元本額	23,606,312,069円
期中一部解約元本額	14,969,468,976円
期末元本額	21,226,241,671円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	660,159,361円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	772,425,009円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,781,771,879円
DCりそな グローバルバランス	13,285,803円
つみたてバランスファンド	412,484,360円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	243,549,256円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	118,394,934円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	70,945,949円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	4,439,325円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	3,748,786円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,306,546円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	2,303,190円
リスクコントロール・オープン	6,146,624円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,459,709,253円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,204,125,358円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,250,122,298円
Smart-i 8資産バランス 安定型	27,009,756円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	86,335,127円
Smart-i 8資産バランス 成長型	96,276,884円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	411,037,426円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	287,830,391円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	188,656,397円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	121,488,255円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	383,374,925円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	61,587,928円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,004,616円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,555,722,035円
2. 計算日における受益権の総数	21,226,241,671口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,812,481,129円
4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9146円
(10,000口当たり純資産額)	(9,146円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### (金融商品に関する注記)

##### 金融商品の状況に関する事項

2020年 7月27日現在

#### 1.金融商品に対する取組方針

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

#### 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2020年 7月27日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

#### デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## (関連当事者との取引に関する注記)

2020年 7月27日現在

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

### 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2020年 7月27日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		3,215,780,957
合計		3,215,780,957

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

## 2 デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2020年 7月27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	24,455,500	-	24,166,570	288,930
	米ドル	19,303,038	-	19,045,800	257,238
	英ポンド	1,291,237	-	1,288,770	2,467
	シンガポールドル	3,861,225	-	3,832,000	29,225
合計		24,455,500	-	24,166,570	288,930

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,937	174,613.53	
		AGREE REALTY CORP	9,155	570,356.50	
		ALEXANDER'S INC	368	91,367.04	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,283	3,587,249.65	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,232	210,492.24	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,565	810,164.70	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	135,144.72	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	42,494	1,158,811.38	
		AMERICOLD REALTY TRUST	33,424	1,281,141.92	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,027	892,212.55	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,978	308,505.96	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	66,200	26,480.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	1,169	4,886.42	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,732	3,485,044.20	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	25,342.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	24,404	2,212,710.68	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	5,009	11,871.33	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	27,601	294,226.66	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,116	560,296.88	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	9,842	109,935.14	
		BRT APARTMENTS CORP	877	9,024.33	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,240	1,453,967.20	
		CARETRUST REIT INC	15,511	264,307.44	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	17,115	3,399.03	
		CEDAR REALTY TRUST INC	15,920	14,057.36	
		CHATHAM LODGING TRUST	8,481	45,118.92	
CITY OFFICE REIT INC	8,644	82,290.88			

CLIPPER REALTY INC	1,350	8,842.50	
COLONY CAPITAL INC	83,392	150,105.60	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,542	215,828.88	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	161,245.76	
CORECIVIC INC	19,484	173,602.44	
COREPOINT LODGING INC	7,200	35,352.00	
CORESITE REALTY CORP	6,772	843,994.36	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,132	479,447.92	
COUSINS PROPERTIES INC	25,471	734,838.35	
CUBESMART	32,476	897,961.40	
CYRUSONE INC	19,556	1,552,061.94	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,147	163,905.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	45,252	6,651,591.48	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,700	144,351.00	
DOUGLAS EMMETT INC	27,619	791,836.73	
DUKE REALTY CORP	62,078	2,313,026.28	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,162	279,482.76	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,647	807,942.85	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	25,942	170,179.52	
EPR PROPERTIES	13,450	420,043.50	
EQUINIX INC	14,914	10,997,434.46	
EQUITY COMMONWEALTH	20,728	650,030.08	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	30,744	2,015,884.08	
EQUITY RESIDENTIAL	59,006	3,206,386.04	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,956	222,993.96	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,046	2,365,169.52	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,865	2,085,921.00	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	22,715.23	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,773	859,311.27	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,342	874,808.58	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,417	260,764.28	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	77,551.50	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	8,641	72,065.94	



GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,614	1,165,453.38	
GEO GROUP INC/THE	19,721	212,789.59	
GETTY REALTY CORP	6,175	182,780.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	112,316.04	
GLADSTONE LAND CORP	2,563	40,726.07	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	86,082.15	
GLOBAL NET LEASE INC	14,550	233,673.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,203	673,351.06	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	36,679	978,595.72	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	91,045	2,389,020.80	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	20,178.49	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,532	644,476.32	
HOST HOTELS & RESORTS INC	117,560	1,234,380.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,165	612,784.30	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,354	166,437.36	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,134	224,684.12	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,440	320,126.40	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	1,974	138,140.52	
INVITATION HOMES INC	91,686	2,524,115.58	
IRON MOUNTAIN INC	48,124	1,310,897.76	
JBG SMITH PROPERTIES	20,196	581,644.80	
KILROY REALTY CORP	17,696	999,647.04	
KIMCO REALTY CORP	72,457	778,912.75	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,699	131,099.43	
LEXINGTON REALTY TRUST	47,838	519,520.68	
LIFE STORAGE INC	8,049	751,696.11	
LTC PROPERTIES INC	6,359	236,681.98	
MACERICH CO/THE	20,631	164,016.45	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	211,345.93	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	256,400	185,890.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	88,138	1,667,570.96	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,314	2,149,068.78	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	15,850	222,534.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	28,790	990,376.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	9,977	291,428.17	

NATL HEALTH INVESTORS INC	7,223	427,240.45	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,695	53,519.95	
NEXPOINT RESIDENTIAL	4,057	142,887.54	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,819	189,728.03	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	37,989	1,185,256.80	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,170	36,911.70	
PARAMOUNT GROUP INC	30,907	215,421.79	
PARK HOTELS & RESORTS INC	40,506	345,516.18	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	22,138	227,357.26	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	8,385	9,978.15	
PHYSICIANS REALTY TRUST	34,938	610,366.86	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20,377	317,881.20	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	2,100	26,859.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	62,234.00	
PRIME US REIT	62,000	48,050.00	
PROLOGIS INC	124,359	12,424,707.69	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,480	456,088.80	
PUBLIC STORAGE	25,368	4,702,212.48	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,355	709,835.25	
REALTY INCOME CORP	57,874	3,323,125.08	
REGENCY CENTERS CORP	28,317	1,131,547.32	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,899	191,257.88	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	34,737	212,590.44	
RETAIL VALUE INC	1,615	19,380.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,570	861,471.60	
RLJ LODGING TRUST	28,086	226,373.16	
RPT REALTY	15,048	91,792.80	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,023	282,690.59	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,637	500,343.48	
SAFEHOLD INC	2,352	114,542.40	
SAUL CENTERS INC	2,130	64,602.90	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,842	46,628.46	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	190,370.64	
SIMON PROPERTY GROUP INC	51,511	3,120,021.27	
SITE CENTERS CORP	24,168	167,242.56	

	SL GREEN REALTY CORP	12,885	598,379.40
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,442	568,958.04
	STAG INDUSTRIAL INC	25,054	776,423.46
	STORE CAPITAL CORP	37,067	839,567.55
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	101,673.60
	SUN COMMUNITIES INC	16,597	2,354,782.36
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	35,478	257,925.06
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,020	110,970.40
	TAUBMAN CENTERS INC	9,971	379,296.84
	TERRENO REALTY CORP	11,502	644,342.04
	UDR INC	49,122	1,743,339.78
	UMH PROPERTIES INC	5,256	63,702.72
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,060	138,885.20
	URBAN EDGE PROPERTIES	17,978	181,757.58
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	53,182.24
	VENTAS INC	63,146	2,258,732.42
	VEREIT INC	178,972	1,111,416.12
	VICI PROPERTIES INC	79,446	1,670,749.38
	VORNADO REALTY TRUST	26,517	928,360.17
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	20,279	15,637.13
	WASHINGTON REIT	13,364	285,187.76
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	19,496	325,193.28
	WELLTOWER INC	70,479	3,624,030.18
	WHITESTONE REIT	7,716	49,536.72
	WP CAREY INC	29,193	1,938,415.20
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	20,048	170,408.00
	米ドル 小計	4,219,373	135,620,257.75 (14,351,335,675)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,085	413,585.85
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,997	70,086.63
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,226	126,315.14
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,701	651,619.56
	CHOICE PROPERTIES REIT	26,037	323,379.54
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,280	106,638.40
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	108,876.80

	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	121,394.45
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,223	140,957.18
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	4,061	81,220.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	246,017.88
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,848	360,206.40
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	25,054	242,522.72
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	158,197.23
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	143,515.61
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,894	34,016.24
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,047	29,026.46
	NORTHVIEW APARTMENT REAL EST	6,008	208,177.20
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,751	171,213.37
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	25,823	385,020.93
	SLATE OFFICE REIT	4,169	15,341.92
	SLATE RETAIL REIT - U	1,920	17,625.60
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,423	252,062.67
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,126	138,842.70
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	27,984.00
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,100	105,774.00
	カナダドル 小計	272,908	4,679,618.48 (369,736,656)
ユーロ	AEDIFICA	4,439	428,363.50
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,130	326,886.30
	ALTAREA	659	77,498.40
	BEFIMMO	4,044	153,267.60
	COFINIMMO	4,226	511,346.00
	COVIVIO	8,276	508,560.20
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	7,371	79,901.64
	GECINA SA	9,127	989,366.80
	HAMBORNER REIT AG	12,779	107,151.91
	HIBERNIA REIT PLC	124,814	140,540.56
	ICADE	4,706	266,830.20
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	4,951	15,694.67
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,440	286,921.80
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,158	68,844.40

	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	106,216.92
	KLEPIERRE	35,203	558,143.56
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	50,705.95
	MERCIALYS	3,481	23,061.62
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	60,185	414,072.80
	MONTEA	1,871	177,745.00
	NSI NV	3,090	95,944.50
	RETAIL ESTATES	1,989	113,373.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,902	1,106,624.64
	VASTNED RETAIL NV	2,560	53,888.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,050	570,323.25
	WERELDHAVE NV	7,169	55,129.61
	ユーロ 小計	502,892	7,286,402.83 (901,328,030)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	15,320.00
	ASSURA PLC	432,419	337,719.23
	BIG YELLOW GROUP PLC	26,421	257,340.54
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	78,960.00
	BRITISH LAND CO PLC	158,720	569,011.20
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	144,700	202,580.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	4,620	3,880.80
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	112,652	127,522.06
	DERWENT LONDON PLC	18,288	518,281.92
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	64,676.48
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	41,364	240,076.65
	HAMMERSON PLC	135,561	95,055.37
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	126,100	685,479.60
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	150,742	334,647.24
	LXI REIT PLC	94,678	100,548.03
	NEWRIVER REIT PLC	56,051	33,630.60
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	65,928.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	213,711	319,711.65
	RDI REIT PLC	48,350	42,548.00
	REGIONAL REIT LTD	68,961	46,893.48
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	33,857	250,880.37

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	35,863.78
	SEGRO PLC	201,616	1,864,948.00
	SHAFTESBURY PLC	36,422	178,467.80
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	49,939	50,937.78
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	294,977	440,105.68
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	124,710	81,685.05
	UNITE GROUP PLC	68,253	634,411.63
	WORKSPACE GROUP PLC	21,040	119,296.80
	英ボンド 小計	3,245,661	7,796,407.74 (1,057,738,638)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	66,607	180,504.97
	APN INDUSTRIA REIT	13,219	32,783.12
	ARENA REIT	52,557	118,253.25
	BWP TRUST	82,681	323,282.71
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	139,284.00
	CHARTER HALL GROUP	80,514	809,970.84
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	73,828	347,729.88
	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,091	270,773.02
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	137,235.67
	CROMWELL PROPERTY GROUP	324,502	288,806.78
	DEXUS	181,412	1,629,079.76
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	97,120.10
	GOODMAN GROUP	274,553	4,464,231.78
	GPT GROUP	322,528	1,328,815.36
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	172,124.56
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	21,020	59,486.60
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,899	229,535.40
	MIRVAC GROUP	653,152	1,365,087.68
	NATIONAL STORAGE REIT	158,638	301,412.20
	RURAL FUNDS GROUP	45,950	94,197.50
	SCENTRE GROUP	883,360	1,863,889.60
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	174,242	383,332.40
	STOCKLAND	407,672	1,316,780.56
	VICINITY CENTRES	670,328	918,349.36
	WAYPOINT REIT LTD	119,935	326,223.20

オーストラリアドル 小計		5,006,659	17,198,290.30 (1,296,235,139)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	187,009.90
	GOODMAN PROPERTY TRUST	187,660	409,098.80
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	272,970	281,159.10
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	314,830.99
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	49,526	129,510.49
ニュージーランドドル 小計		841,430	1,321,609.28 (93,094,157)
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,341,860.00
	FORTUNE REIT	239,000	1,589,350.00
	LINK REIT	347,600	20,473,640.00
	PROSPERITY REIT	226,000	515,280.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	136,000	495,040.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	939,600.00
香港ドル 小計		1,556,600	25,354,770.00 (346,092,610)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	98,942.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	175,200	105,996.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	501,600	1,745,568.00
	ASCOTT TRUST	316,596	296,017.26
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	490,600	843,832.00
	CAPITALAND MALL TRUST	487,500	965,250.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUS	140,500	179,840.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	143,100	144,531.00
	ESR REIT	305,700	122,280.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	80,100.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	107,400	64,440.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	126,100	301,379.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	60,833.50
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	396,379	499,437.54
	KEPPEL DC REIT	200,400	589,176.00
	KEPPEL REIT	327,600	360,360.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	127,100	80,073.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	199,100	24,688.40
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	353,400	664,392.00

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	262,400	829,184.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	506,400	1,083,696.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	354,900	319,410.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	446,000	176,170.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	70,900	241,769.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	60,838.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	69,535.50	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	100,900	41,873.50	
	SPH REIT	127,200	107,484.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	200,500	98,245.00	
	SUNTEC REIT	386,200	536,818.00	
	シンガポールドル 小計	7,480,875	10,792,158.70 (827,218,964)	
韓国ウォン	LOTTE REIT CO LTD	15,600	80,028,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	4,100	26,773,000.00	
	韓国ウォン 小計	19,700	106,801,000.00 (9,451,888)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	29,265	357,910.95	
	イスラエルシェケル 小計	29,265	357,910.95 (11,098,818)	
	合計		19,263,330,575 (19,263,330,575)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 157銘柄	100.0%	74.5%
カナダドル	投資証券 26銘柄	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券 26銘柄	100.0%	4.7%
英ポンド	投資証券 30銘柄	100.0%	5.5%
オーストラリアドル	投資証券 25銘柄	100.0%	6.7%
ニュージーランドドル	投資証券 5銘柄	100.0%	0.5%



香港ドル	投資証券	6銘柄	100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	100.0%	4.3%
韓国ウォン	投資証券	2銘柄	100.0%	0.0%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

**【中間財務諸表】**

- ( 1 ) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- ( 2 ) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期中間計算期間(2020年 7月28日から2021年 1月27日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

## 【つみたてバランスファンド】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 2020年 7月27日現在	第4期中間計算期間末 2021年 1月27日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	41,438,298	54,133,481
親投資信託受益証券	7,713,098,239	11,542,772,969
流動資産合計	7,754,536,537	11,596,906,450
資産合計	7,754,536,537	11,596,906,450
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	2,733,612	6,935,456
未払受託者報酬	683,592	1,053,244
未払委託者報酬	5,981,382	9,215,840
未払利息	112	146
その他未払費用	290,435	410,665
流動負債合計	9,689,133	17,615,351
負債合計	9,689,133	17,615,351
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	7,507,078,798	9,977,927,324
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	237,768,606	1,601,363,775
（分配準備積立金）	191,711,824	184,912,566
元本等合計	7,744,847,404	11,579,291,099
純資産合計	7,744,847,404	11,579,291,099
負債純資産合計	7,754,536,537	11,596,906,450

## （２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期中間計算期間 自 2019年 7月26日 至 2020年 1月25日	第4期中間計算期間 自 2020年 7月28日 至 2021年 1月27日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	347,002,577	1,167,174,730
<b>営業収益合計</b>	<b>347,002,577</b>	<b>1,167,174,730</b>
<b>営業費用</b>		
支払利息	10,540	26,765
受託者報酬	472,856	1,053,244
委託者報酬	4,137,418	9,215,840
その他費用	200,973	410,665
<b>営業費用合計</b>	<b>4,821,787</b>	<b>10,706,514</b>
営業利益又は営業損失（ ）	342,180,790	1,156,468,216
経常利益又は経常損失（ ）	342,180,790	1,156,468,216
中間純利益又は中間純損失（ ）	342,180,790	1,156,468,216
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	4,270,702	18,497,673
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	102,549,182	237,768,606
剰余金増加額又は欠損金減少額	120,739,872	237,621,424
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	120,739,872	237,621,424
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,638,692	11,996,798
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,638,692	11,996,798
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	556,560,450	1,601,363,775

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2020年 7月27日現在	第4期中間計算期間末 2021年 1月27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 3,188,872,917円	期首元本額 7,507,078,798円
期中追加設定元本額 4,603,201,837円	期中追加設定元本額 2,790,663,722円
期中一部解約元本額 284,995,956円	期中一部解約元本額 319,815,196円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 7,507,078,798口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 9,977,927,324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 1.0317円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.1605円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,317円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (11,605円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2020年 7月27日現在	第4期中間計算期間末 2021年 1月27日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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。	同左
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。	3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明 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）

## デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

## RAM国内株式マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2021年 1月27日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,315,477,325
株式	39,945,622,510
派生商品評価勘定	27,771,850
未収配当金	56,616,829
差入委託証拠金	30,195,000
流動資産合計	41,375,683,514
資産合計	41,375,683,514
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	24,325,000
未払金	228,078,035

2021年 1月27日現在	
未払解約金	635,821,000
未払利息	3,568
その他未払費用	16
流動負債合計	888,227,619
負債合計	888,227,619
純資産の部	
元本等	
元本	30,386,167,865
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,101,288,030
元本等合計	40,487,455,895
純資産合計	40,487,455,895
負債純資産合計	41,375,683,514

## 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27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	24,384,590,778円
期中追加設定元本額	21,465,950,736円
期中一部解約元本額	15,464,373,649円
期末元本額	30,386,167,865円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,009,314,107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	17,167,391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	28,061,738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	19,628,393円
リスクコントロール・オープン	8,119,679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	17,492,074,008円
Smart-i TOPIXインデックス	1,190,923,616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	410,852,706円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	446,047,699円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	260,397,515円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	158,443,471円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	362,811,733円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	60,887,328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）	947,550,577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	30,386,167,865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	1.3324円
(10,000口当たり純資産額)	(13,324円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
デリバティブ取引	
（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	



## 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

## （株式関連）

（2021年 1月27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	-	612,810,000	27,771,850
	合計	585,038,150	-	612,810,000	27,771,850

## （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。

## 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27日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,535,609,180
コール・ローン	1,223,552,079
株式	67,124,081,959
投資証券	1,482,798,053
派生商品評価勘定	408,728,882
未収配当金	48,124,895
差入委託証拠金	3,784,017,869

2021年 1月27日現在

流動資産合計	85,606,912,917
資産合計	85,606,912,917
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,638,995
未払解約金	714,127,000
未払利息	3,318
その他未払費用	1
流動負債合計	715,769,314
負債合計	715,769,314
純資産の部	
元本等	
元本	53,893,595,562
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	30,997,548,041
元本等合計	84,891,143,603
純資産合計	84,891,143,603
負債純資産合計	85,606,912,917

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 1月27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	46,174,135,861円
期中追加設定元本額	26,768,829,010円
期中一部解約元本額	19,049,369,309円
期末元本額	53,893,595,562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	50,984,162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	432,306,542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	26,979,205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	18,749,837円
リスクコントロール・オープン	44,708,051円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	172,054,639円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	67,948,862円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	21,548,243,542円
Smart-i 先進国株式インデックス	4,294,274,594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	2,084,353,323円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,261,518,440円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,320,244,295円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	803,247,349円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,839,822,748円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	310,503,291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)	801,703,806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	53,893,595,562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	1,5752円
(10,000口当たり純資産額)	(15,752円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2021年 1月27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	16,016,574,860	-	16,423,656,925	407,082,065
	合計	16,016,574,860	-	16,423,656,925	407,082,065

## (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27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	660,248,388	-	660,256,210	7,822
	米ドル	500,206,433	-	499,896,740	309,693
	カナダドル	13,675,334	-	13,720,560	45,226
	ユーロ	81,334,500	-	81,460,600	126,100
	英ポンド	21,422,611	-	21,506,930	84,319
	スイスフラン	20,206,002	-	20,230,620	24,618
	スウェーデンクローナ	5,321,127	-	5,308,250	12,877
	デンマーククローネ	4,739,168	-	4,746,000	6,832
	オーストラリアドル	10,157,345	-	10,204,450	47,105
	香港ドル	3,185,868	-	3,182,060	3,808
合計		660,248,388	-	660,256,210	7,822

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R A M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年 1月27日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,152,661,884
コール・ローン	107,127,180
株式	11,432,093,779
投資証券	9,412,813
派生商品評価勘定	207,082,656
未収入金	25,876,226
未収配当金	2,214,233
差入委託証拠金	946,168,646
流動資産合計	13,882,637,417
資産合計	13,882,637,417
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	775,238
未払解約金	22,419,000
未払利息	290
その他未払費用	1
流動負債合計	23,194,529
負債合計	23,194,529
純資産の部	
元本等	
元本	8,384,141,662
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,475,301,226
元本等合計	13,859,442,888
純資産合計	13,859,442,888
負債純資産合計	13,882,637,417

### 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27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	6,916,953,326円
期中追加設定元本額	3,040,230,715円
期中一部解約元本額	1,573,042,379円
期末元本額	8,384,141,662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	147,770,061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	6,273,232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	2,141,733,310円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,133,225,116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	330,178,648円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	358,200,154円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	209,111,696円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	127,195,107円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	290,465,239円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	49,241,061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	8,384,141,662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	1.6531円
(10,000口当たり純資産額)	(16,531円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式、投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)



（2021年 1月27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	2,209,461,235	-	2,415,839,904	206,378,669
	合計	2,209,461,235	-	2,415,839,904	206,378,669

（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27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 米ドル	82,696,241 82,696,241	- -	82,624,990 82,624,990	71,251 71,251
	合計	82,696,241	-	82,624,990	71,251

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## R A M国内債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月27日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	679,710
コール・ローン	1,141,051,089
国債証券	68,713,007,180
地方債証券	4,456,317,400
特殊債券	5,621,180,642
社債券	3,517,752,000
未収利息	145,230,698
前払費用	4,511,998
流動資産合計	83,599,730,717
資産合計	83,599,730,717
負債の部	
流動負債	
未払金	711,998,800
未払解約金	18,464,000
未払利息	3,094
その他未払費用	44
流動負債合計	730,465,938
負債合計	730,465,938
純資産の部	
元本等	
元本	78,860,325,101
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,008,939,678
元本等合計	82,869,264,779
純資産合計	82,869,264,779
負債純資産合計	83,599,730,717

## 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27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	80,757,065,940円
期中追加設定元本額	19,286,709,001円

期中一部解約元本額	21,183,449,840円
期末元本額	78,860,325,101円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,810,316,056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	482,165,891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	13,798,937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	534,896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	45,235,661,017円
Smart-i 国内債券インデックス	1,012,778,319円
Smart-i 8資産バランス 安定型	581,007,425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	2,611,540,250円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,833,271,397円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,654,025,837円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,006,307,295円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,305,037,837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	78,860,325,101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	1.0508円
(10,000口当たり純資産額)	(10,508円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27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。

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

### （その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## R A M先進国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年 1月27日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	198,715,838
コール・ローン	128,545,223
国債証券	31,130,345,271
派生商品評価勘定	47,810
未収入金	78,912,018
未収利息	178,921,388
前払費用	16,739,021
流動資産合計	31,732,226,569
<b>資産合計</b>	
31,732,226,569	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	308,244
未払解約金	240,000,000
未払利息	348
その他未払費用	2
流動負債合計	240,308,594
<b>負債合計</b>	
240,308,594	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	29,691,882,016
剰余金	

2021年 1月27日現在

剰余金又は欠損金（ ）	1,800,035,959
元本等合計	31,491,917,975
純資産合計	31,491,917,975
負債純資産合計	31,732,226,569

## 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27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	24,423,897,140円
期中追加設定元本額	7,563,987,543円
期中一部解約元本額	2,296,002,667円
期末元本額	29,691,882,016円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	4,137,785,098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	71,727,491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	7,482,422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	201,111円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	105,052,404円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	61,160,146円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	55,534,951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)	21,043,873,346円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	600,868,641円
Smart-i 8資産バランス 安定型	323,894,588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	29,691,882,016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	1.0606円
(10,000口当たり純資産額)	(10,606円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

## デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 1月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	174,613,236	-	174,873,670	260,434
	米ドル	78,847,377	-	78,799,567	47,810
	カナダドル	5,022,443	-	5,047,206	24,763
	メキシコペソ	3,378,073	-	3,401,860	23,787
	ユーロ	67,333,880	-	67,476,110	142,230
	英ポンド	16,839,703	-	16,934,927	95,224
	オーストラリアドル	3,191,760	-	3,214,000	22,240
	合計	174,613,236	-	174,873,670	260,434

(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。

## RAM新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月27日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,260,864

2021年 1月27日現在

コール・ローン	75,399,614
投資信託受益証券	5,052,050,777
未収配当金	70,409,721
流動資産合計	5,199,120,976
資産合計	5,199,120,976
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,734
未払金	54,277,135
未払解約金	797,000
未払利息	204
流動負債合計	55,079,073
負債合計	55,079,073
純資産の部	
元本等	
元本	4,771,545,373
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	372,496,530
元本等合計	5,144,041,903
純資産合計	5,144,041,903
負債純資産合計	5,199,120,976

## 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	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27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	4,492,026,466円



期中追加設定元本額	1,850,269,817円
期中一部解約元本額	1,570,750,910円
期末元本額	4,771,545,373円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	775,554,598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	13,601,095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	7,203,694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	5,130,371円
リスクコントロール・オープン	2,487,047円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	67,362,421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	926,193,027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	253,796,401円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	275,960,585円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	161,102,139円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	98,025,241円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	223,506,212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	4,771,545,373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	1.0781円
(10,000口当たり純資産額)	(10,781円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資信託受益証券	

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

#### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

#### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

#### （その他の注記）

#### デリバティブ取引に関する注記

#### （通貨関連）

（2021年 1月27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	54,545,521	-	54,540,787	4,734
	米ドル	54,545,521	-	54,540,787	4,734
	合計	54,545,521	-	54,540,787	4,734

#### （注）時価の算定方法

##### 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R A M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 1月27日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,042,279,755
投資証券	23,554,455,880
派生商品評価勘定	37,254,230
未収配当金	115,329,952
差入委託証拠金	87,444,000
流動資産合計	24,836,763,817
資産合計	24,836,763,817
負債の部	
流動負債	
前受金	27,055,900
未払金	119,190,480
未払解約金	604,485,000
未払利息	2,827
その他未払費用	17
流動負債合計	750,734,224
負債合計	750,734,224
純資産の部	
元本等	
元本	18,804,876,330
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,281,153,263
元本等合計	24,086,029,593
純資産合計	24,086,029,593
負債純資産合計	24,836,763,817

### 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	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27日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	15,468,007,281円
期中追加設定元本額	9,948,870,074円
期中一部解約元本額	6,612,001,025円
期末元本額	18,804,876,330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	17,492,461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	7,406,039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	5,061,030円
リスクコントロール・オープン	2,151,695円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	57,398,996円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,205,846,170円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,285,932,159円
Smart-i Jリートインデックス	2,484,412,371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	216,667,033円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	235,141,986円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	137,273,419円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	83,525,518円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	191,009,060円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	32,174,758円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,183,380,134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）	917,742,573円
2. 計算日における受益権の総数	18,804,876,330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	1.2808円
(10,000口当たり純資産額)	(12,808円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## デリバティブ取引に関する注記

## （投資証券関連）

（2021年 1月27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	588,560,270	-	625,814,500	37,254,230
	合計	588,560,270	-	625,814,500	37,254,230

## （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。

## RAM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27日現在

資産の部	
流動資産	
預金	511,084,522
コール・ローン	108,923,091
株式	16,333,548
投資証券	22,346,390,003
派生商品評価勘定	736,855
未収入金	76,836,055
未収配当金	35,886,127
流動資産合計	23,096,190,201
資産合計	
23,096,190,201	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	211,859
未払解約金	543,079,000
未払利息	295
その他未払費用	1
流動負債合計	543,291,155
負債合計	
543,291,155	
純資産の部	
元本等	
元本	21,555,572,465
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	997,326,581
元本等合計	22,552,899,046
純資産合計	
22,552,899,046	
負債純資産合計	
23,096,190,201	

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

5. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益</p> <p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <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27日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	21,226,241,671円
期中追加設定元本額	7,540,926,003円
期中一部解約元本額	7,211,595,209円
期末元本額	21,555,572,465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	6,928,670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	10,115,489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	7,011,916円
リスクコントロール・オープン	10,439,534円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	70,000,145円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,207,208,391円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,325,288,883円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,415,561,001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	528,521,887円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	573,370,113円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	334,725,507円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	203,637,144円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	466,837,250円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	78,594,157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)	1,054,738,293円
2. 計算日における受益権の総数	21,555,572,465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	1.0463円
(10,000口当たり純資産額)	(10,463円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 1月27日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。
	また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 1月27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	為替予約取引				



の取引	買建	95,080,286	-	95,051,140	29,146
	米ドル	76,055,640	-	75,990,110	65,530
	ユーロ	6,043,430	-	6,052,800	9,370
	英ポンド	6,384,222	-	6,409,350	25,128
	香港ドル	2,141,760	-	2,139,200	2,560
	シンガポールドル	4,455,234	-	4,459,680	4,446
	売建	531,298,932	-	530,744,790	554,142
	米ドル	411,162,444	-	410,533,200	629,244
	カナダドル	7,349,697	-	7,350,300	603
	ユーロ	26,409,720	-	26,354,900	54,820
	英ポンド	27,425,319	-	27,488,990	63,671
	オーストラリアドル	33,677,280	-	33,747,000	69,720
	ニュージーランドドル	2,241,111	-	2,249,100	7,989
	香港ドル	8,169,547	-	8,155,700	13,847
	シンガポールドル	14,863,814	-	14,865,600	1,786
	合計	626,379,218	-	625,795,930	524,996

## (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。

## 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。

## 【つみたてバランスファンド】

## 【純資産額計算書】

資産総額	11,474,695,103円
負債総額	6,671,479円
純資産総額（ - ）	11,468,023,624円
発行済口数	9,972,499,041口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1500円

（参考）

## 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

## R A M先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	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

## R A M新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	5,200,862,697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。

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1) 資本金の額

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

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
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

## 2【関係業務の概要】



- ( 1 ) 受託会社  
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
- ( 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【その他】

- ( 1 ) 目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。
- ( 2 ) 目論見書の表紙等に委託会社または受託会社のロゴ・マーク、ファンドの総称、図案等を記載することがあります。
- ( 3 ) 目論見書の表紙に目論見書の使用開始日を記載します。
- ( 4 ) 目論見書の表紙等に以下の趣旨の事項を記載することがあります。
  - ファンドの信託財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
  - 本書は、金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書です。
  - 委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。
  - 交付目論見書にはファンドの約款の主な内容が含まれておりますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されております。
  - ファンドに関する請求目論見書は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
  - ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
- ( 5 ) 有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- ( 6 ) 目論見書は電子媒体などとして使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。

## 独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

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

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

### 監査意見

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

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

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の監査報告書

2020年9月17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」に掲げられているつみたてバランスファンドの2019年7月26日から2020年7月27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、つみたてバランスファンドの2020年7月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

# 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

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

## 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたてバランスファンドの2020年7月28日から2021年1月27日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

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、つみたてバランスファンドの2021年1月27日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年7月28日から2021年1月27日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 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、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、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。

## 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な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、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。

- ・ 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、経営者に対して、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。

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。