

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年5月14日提出
【計算期間】	第1期(自 2020年3月31日至 2021年2月15日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド2020-03
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< 商品分類の定義 >

1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

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

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

4. 独立した区分

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

< 補足として使用する商品分類 >

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1)株式

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

(2)債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
 公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
 社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
 その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
 格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記 から の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

2. 決算頻度による属性区分

- 年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
 年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
 年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
 年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
 年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
 日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

◆「保証契約」の表記について

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

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

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

◆「保証会社」の表記について

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

投資対象

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

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

ファンドの特色

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

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

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

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

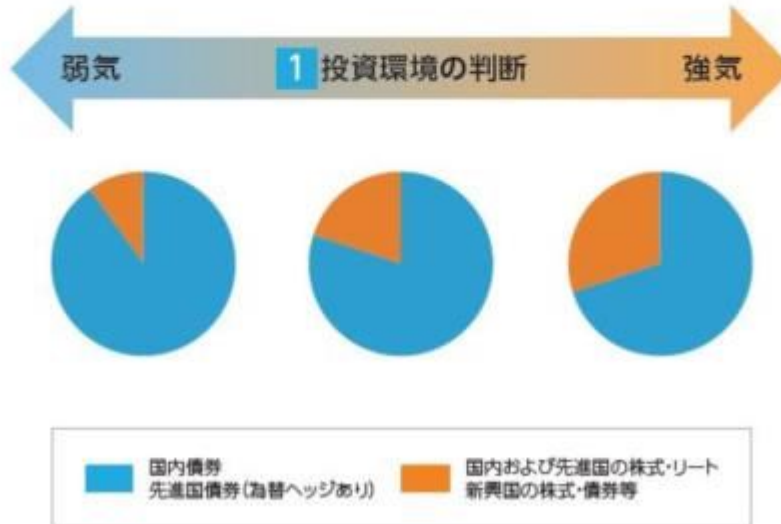
*基準価額が「確保ライン」を上回っている場合でも、上記の条件以外の理由によって委託会社が繰上償還を決定することがあります。

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

Point

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

投資環境の判断と投資割合のイメージ

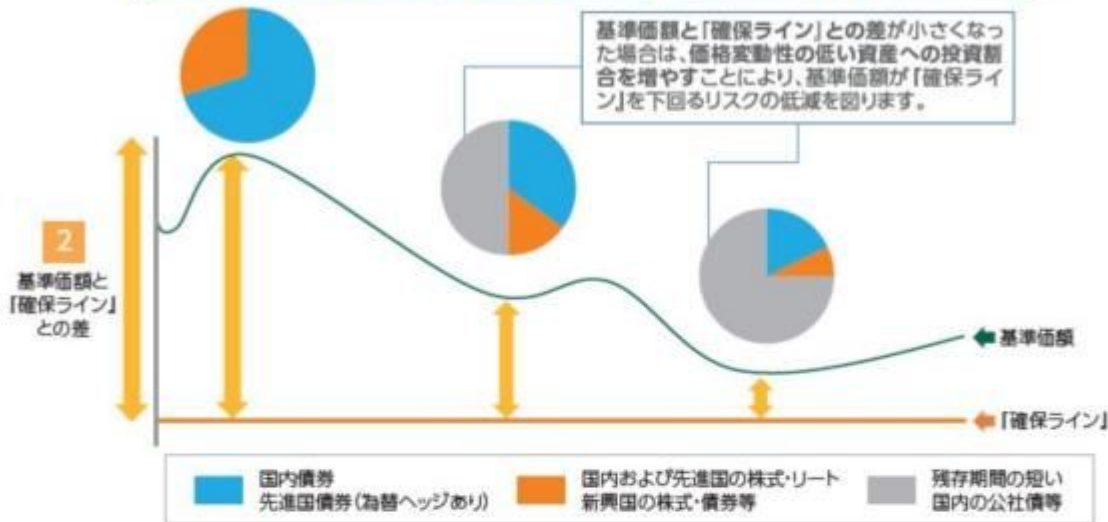


2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した「確保ライン」を上回る水準で運用を継続することを目指します。

Point

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

「基準価額と「確保ライン」との差」と投資割合のイメージ

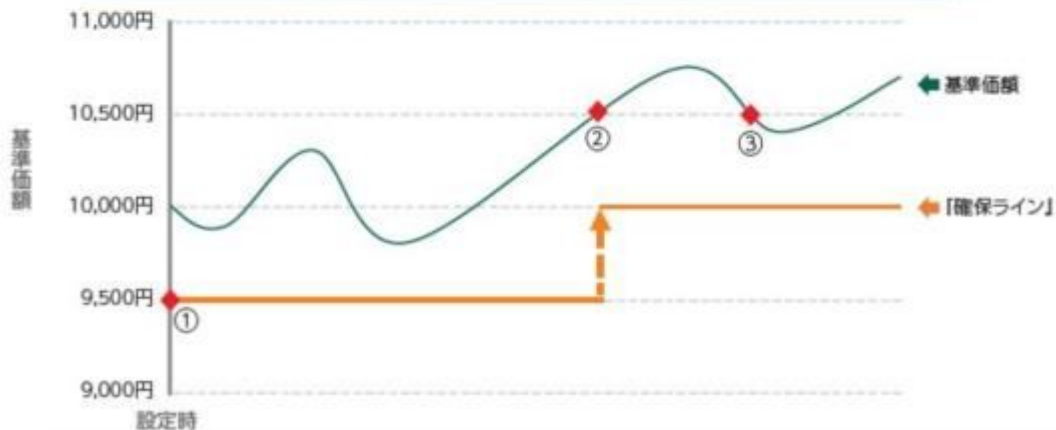


「確保ライン」は設定後に見直される場合があります。

Point

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

「確保ライン」の引き上げイメージ



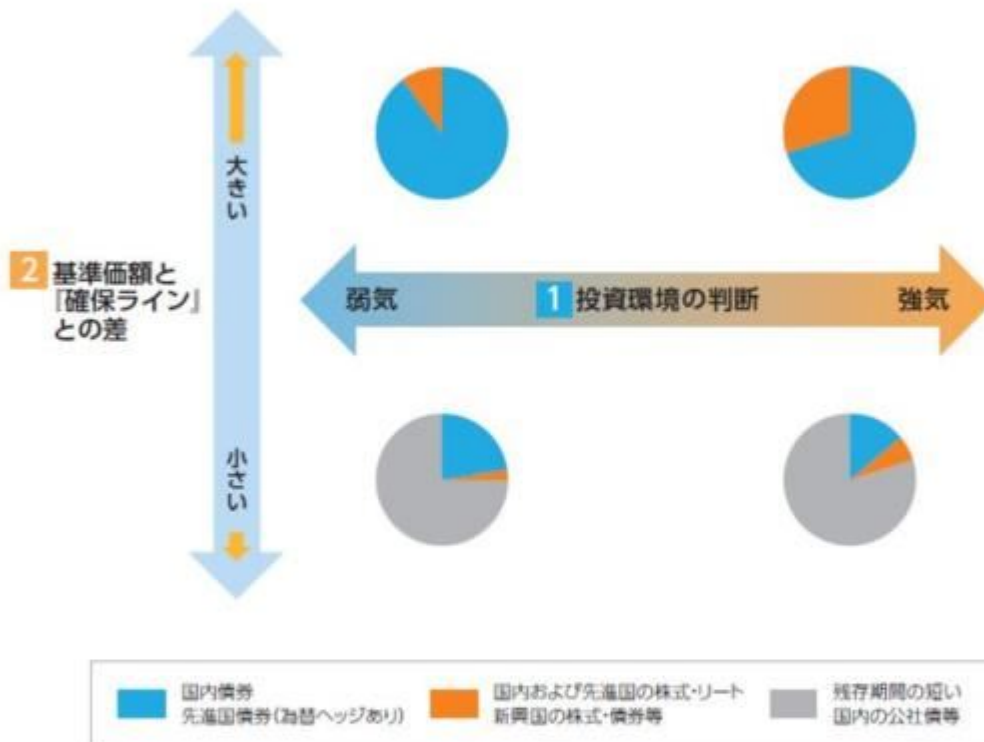
⚠️ ご注意ください

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

投資対象資産への投資割合のイメージ

1 投資環境の判断 と 2 基準価額と「確保ライン」との差

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

⚠️ **ご注意ください**

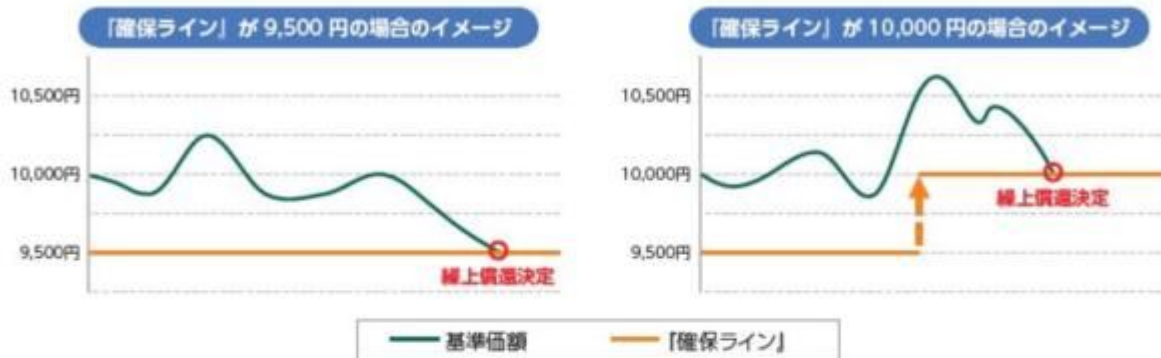
上記の図は、ファンドにおける投資割合の変化について説明することを目的に単純化したものであり、実際の運用において上記の投資割合で運用することを示唆・保証するものではありません。

3

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

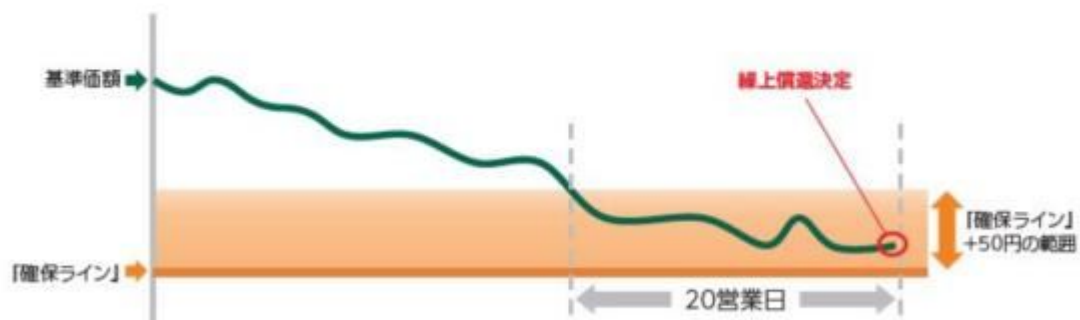
条件① 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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

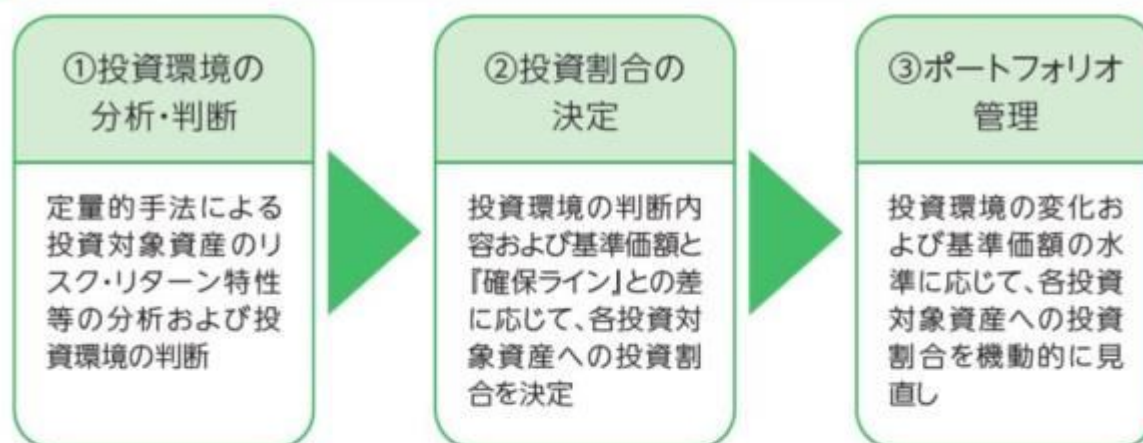


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

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

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

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

分配方針

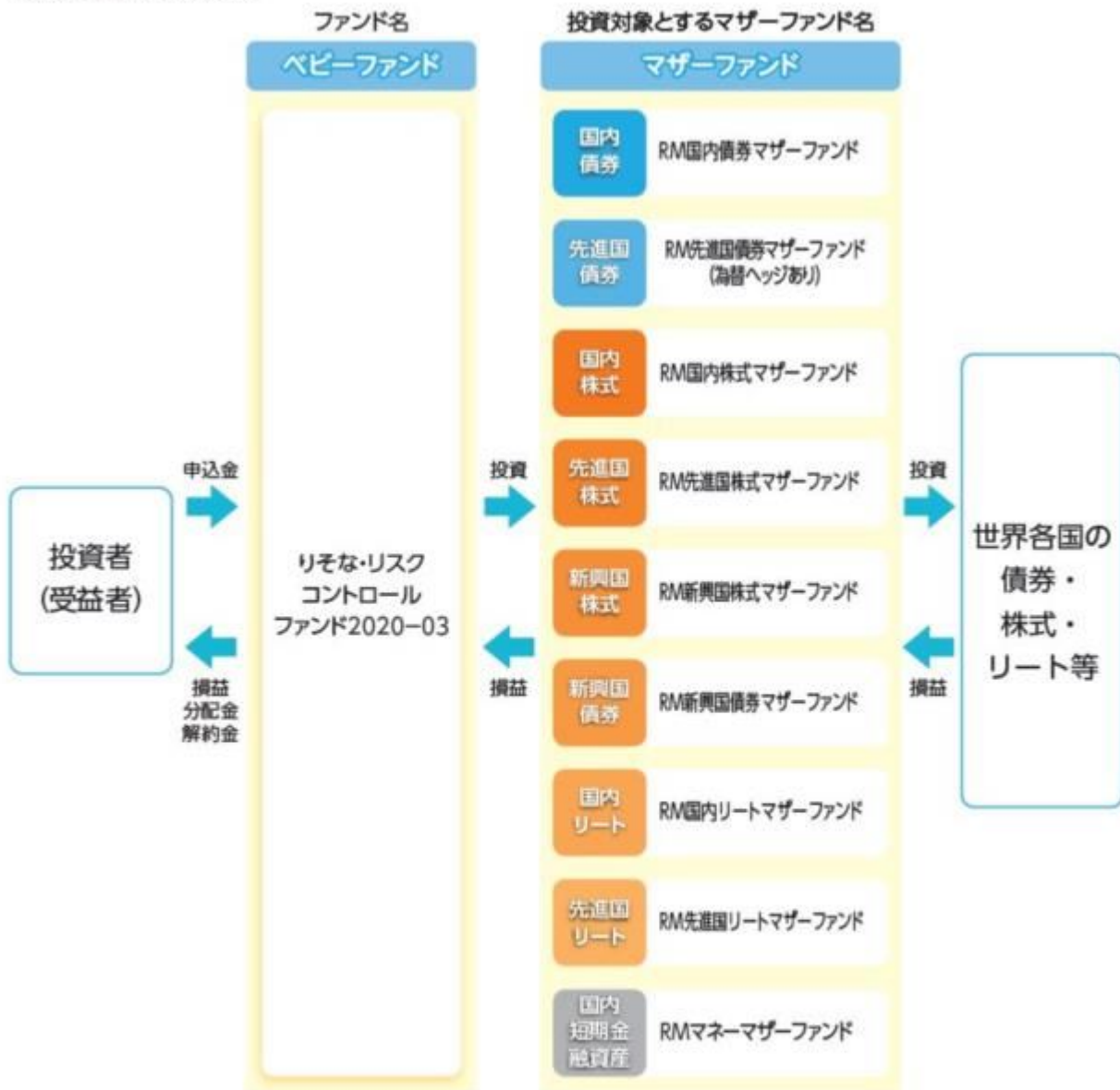
原則、毎年2月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ ファンドの仕組み

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



■ 主な投資制限

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

インデックスの著作権等について

●RM国内債券マザーファンド

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

●RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RM国内株式マザーファンド

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

●RM先進国株式マザーファンド

「MSCI-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。

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

●RM先進国リートマザーファンド

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

※RMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

信託金限度額

1,000億円を限度とします。

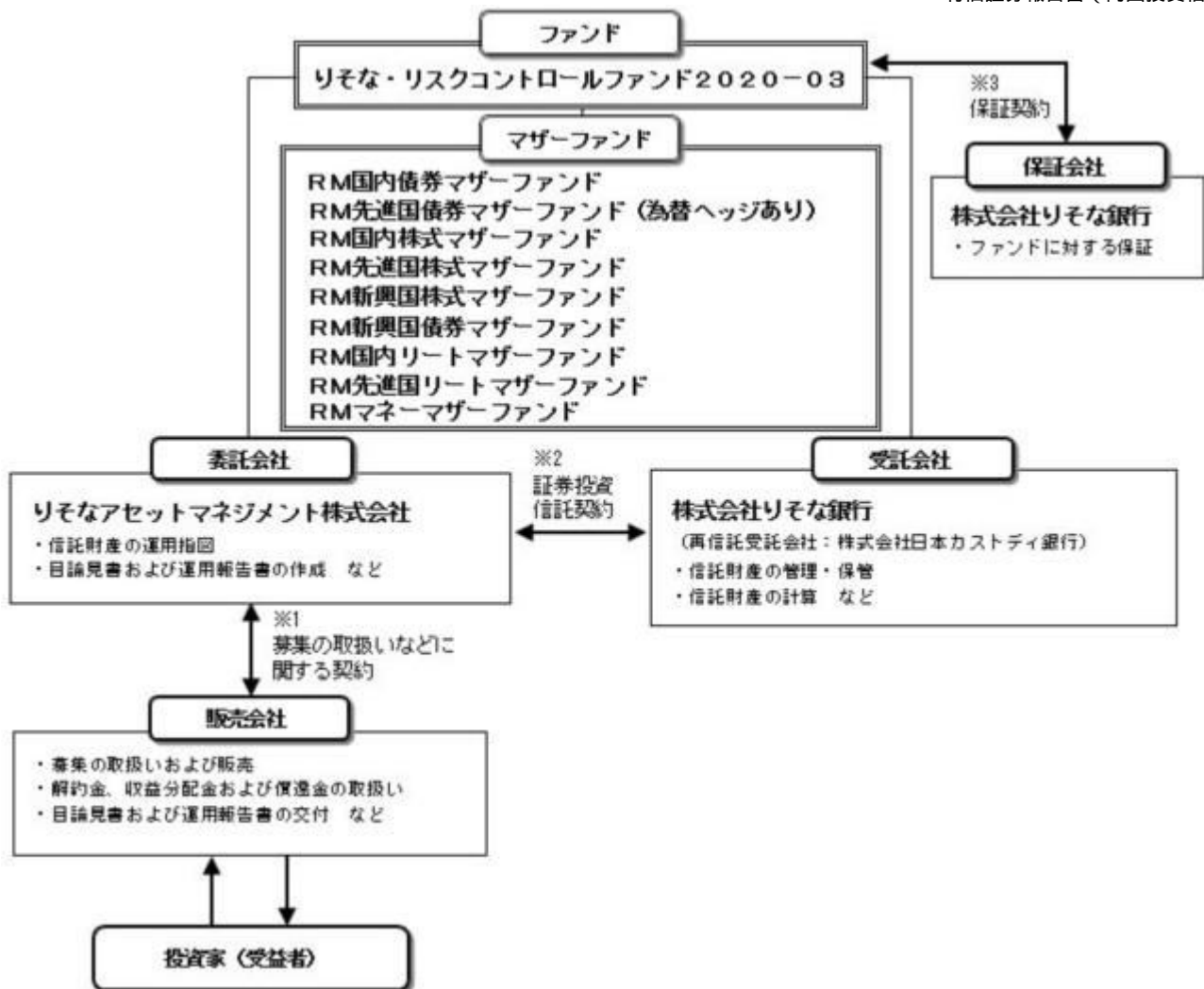
(2)【ファンドの沿革】

2020年3月31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の。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を保証会社が信託財産に支払うことを規定したものの。

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

委託会社の概況（2021年2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国内債券マザーファンド、RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、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、RM先進国リートマザーファンドおよびRMマネーマザーファンド（以下、各々を「マザーファンド」といいます。）の各受益証券を主要投資対象とします*。

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

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
RM国内債券マザーファンド	RAM国内債券マザーファンド
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)
RM国内株式マザーファンド	RAM国内株式マザーファンド
RM先進国株式マザーファンド	RAM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	RAM新興国株式マザーファンド
RM新興国債券マザーファンド	RAM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	RAM国内リートマザーファンド
RM先進国リートマザーファンド	RAM先進国リートマザーファンド
RMマネーマザーファンド	RAMマネーマザーファンド

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

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

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

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

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

設定時における『確保ライン』は9,500円とします。設定後、基準価額が最初に10,500円を上回った

日の翌営業日以降は『確保ライン』を10,000円に見直すものとし、その後の信託期間においては『確保ライン』の見直しは行わないものとします。また、『確保ライン』の引き下げは行いません。

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

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

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

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。)
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第19条、第20条、第21条および第22条に定めるものに限り、)
 - 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。)

す。)

- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- 17) 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
- 20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M国内債券マザーファンド >

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

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

< R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

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

< R M国内株式マザーファンド >

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

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

< R M先進国株式マザーファンド >

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

< R M新興国株式マザーファンド >

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

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M新興国債券マザーファンド >

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

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

< R M国内リートマザーファンド >

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

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

< R M先進国リートマザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国(除く日本)の金融商品取引所に上場(上場予定を含みます。)されているまたは店頭登録されている(登録予定を含みます。)不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。) ・先進国(除く日本)の金融商品取引所に上場(上場予定を含みます。)されているまたは店頭登録されている(登録予定を含みます。)不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)
投資方針	主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)に投資し、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、S & P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 不動産投資信託証券またはETF(上場投資信託証券)の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

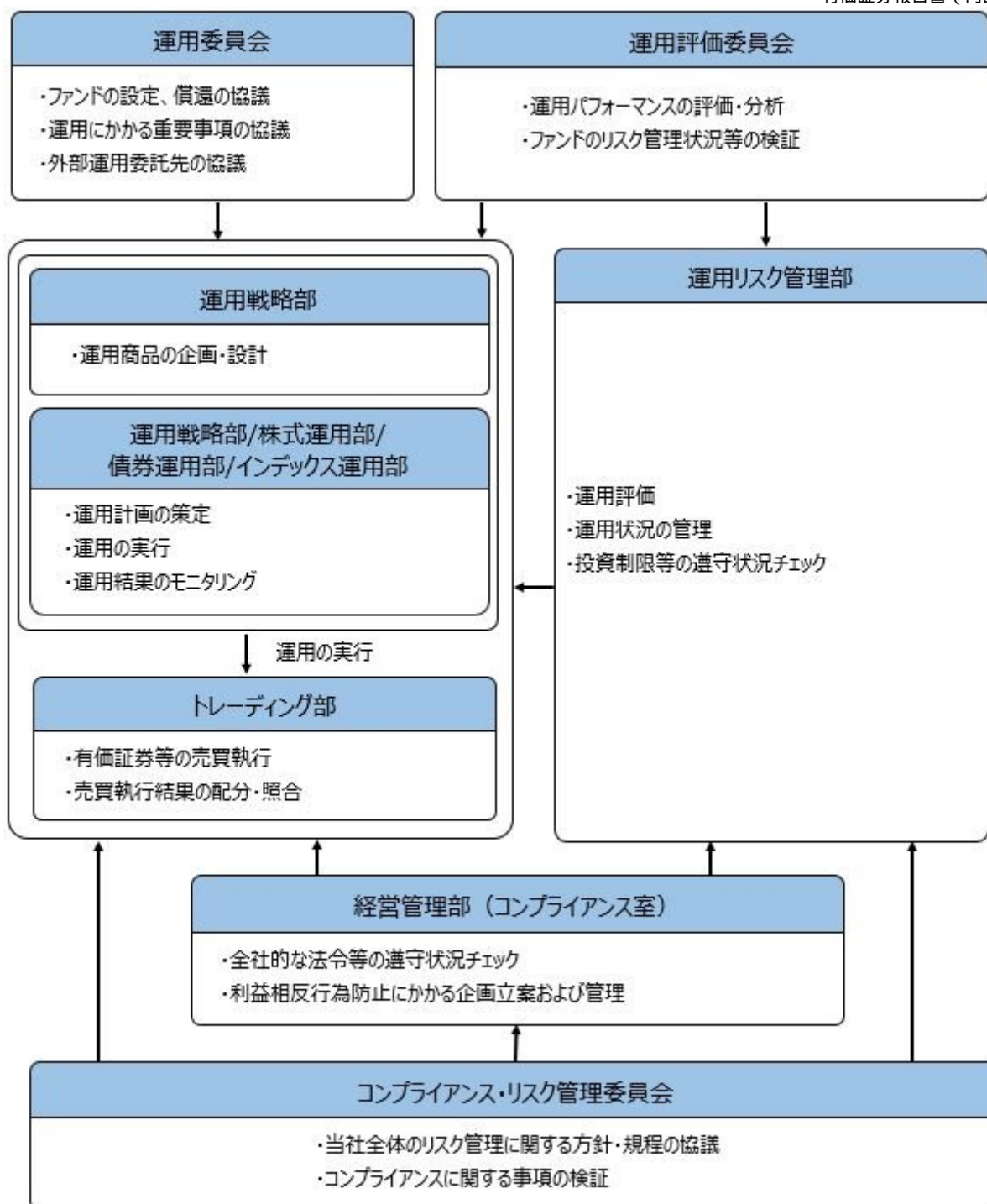
< R Mマネーマザーファンド >

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

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

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2021年2月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

(4) 【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

収益分配金の支払い

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

(5)【投資制限】

約款に定める投資制限

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

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

10) 先物取引等の運用指図および範囲

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

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

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

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

5. 前記3. および4. においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
6. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13) 直物為替先渡取引の運用指図

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

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
2. 前記1. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額を

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

17) 資金の借入れ

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

法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

資産配分リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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

（その他の留意点）

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

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

次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。

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

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

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

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

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

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

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

（２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

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

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

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

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

上記体制は2021年2月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

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

1) 当初設定日以降、2020年5月11日まで

年率1.243%（税抜1.13%）

2) 2020年5月12日以降

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

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

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

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の信託報酬の総額は0円とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

1) 当初設定日以降、2020年5月11日まで

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

2) 2020年5月12日以降

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

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

保証料

保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率0.269%を乗じて得た額とします。信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。

上記の信託報酬に保証料を加えた費用は最大で年率1.512%（税込）となります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落する、もしくは基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となることによって繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の保証料の総額は0円とします。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

とし、当該益金から支払われます。

その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができません（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

上記は2021年2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】

【りそな・リスクコントロールファンド2020-03】

以下の運用状況は2021年 2月26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	16,338,553,678	99.91
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		15,257,100	0.09
合計(純資産総額)		16,353,810,778	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	8,887,312,175	1.0584	9,406,331,207	1.0353	9,201,034,294	56.26
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式マザーファンド	1,798,281,781	1.3322	2,395,806,452	1.6140	2,902,426,794	17.75
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド	2,223,176,864	1.0557	2,347,007,816	1.0410	2,314,327,115	14.15
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	447,410,195	0.9383	419,804,986	1.1012	492,688,106	3.01
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	282,661,802	1.2752	360,467,792	1.6778	474,249,971	2.90
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式マザーファンド	352,608,533	1.1346	400,098,090	1.3363	471,190,782	2.88
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国債券マザーファンド	223,944,815	1.0270	230,002,698	1.0805	241,972,372	1.48
日本	親投資信託受益証券	RAM国内リートマザーファンド	175,731,467	1.1560	203,145,576	1.3695	240,664,244	1.47

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.91
合計	99.91

【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 (2021年 2月15日)	16,854	16,854	1.0519	1.0519
2020年 3月末日	22,473		1.0000	
4月末日	22,196		1.0022	
5月末日	21,934		1.0049	
6月末日	21,083		1.0092	
7月末日	20,290		1.0190	
8月末日	19,580		1.0231	
9月末日	18,783		1.0219	
10月末日	18,094		1.0147	
11月末日	17,817		1.0364	
12月末日	17,276		1.0424	
2021年 1月末日	16,883		1.0439	
2月末日	16,353		1.0341	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 3月31日～2021年 2月15日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2020年 3月31日～2021年 2月15日	5.19

(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	2020年 3月31日～2021年 2月15日	22,473,977,738	6,451,704,901

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

R A M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 2月26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	68,605,909,120	82.90
地方債証券	日本	4,439,057,600	5.36
特殊債券	日本	5,585,896,690	6.75
社債券	日本	3,303,702,000	3.99
	フランス	100,098,000	0.12
	オーストラリア	99,906,000	0.12
	小計	3,503,706,000	4.23
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		624,117,426	0.75
合計（純資産総額）		82,758,686,836	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	100.34	1,284,377,600	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	100.62	1,026,395,400	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	100.43	1,004,310,000	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	102.12	953,838,160	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	100.48	944,559,000	0.100	2023/6/20	1.14
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	910,000,000	100.78	917,184,000	100.64	915,878,600	0.100	2024/6/20	1.11
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	840,000,000	101.12	849,466,800	99.95	839,638,800	0.100	2029/9/20	1.01
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	830,000,000	100.44	833,710,100	100.38	833,220,400	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	100.63	825,207,000	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	99.67	787,456,200	0.100	2030/6/20	0.95
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	750,000,000	101.27	759,552,700	100.30	752,250,000	0.100	2028/9/20	0.91

日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	710,000,000	100.62	714,430,400	100.53	713,819,800	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	100.61	704,333,000	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	100.66	694,609,200	0.100	2026/12/20	0.84
日本	国債証券	第358回利付国債（10年）	680,000,000	100.90	686,139,200	99.77	678,476,800	0.100	2030/3/20	0.82
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	660,000,000	100.77	665,082,000	99.52	656,884,800	0.100	2030/9/20	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	101.90	643,045,790	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	100.73	634,617,900	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	99.86	629,174,700	0.100	2029/12/20	0.76
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	590,000,000	101.11	596,570,600	100.08	590,483,800	0.100	2029/6/20	0.71
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	570,000,000	101.22	576,965,400	100.69	573,961,500	0.100	2026/9/20	0.69
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	560,000,000	101.19	566,692,000	100.71	564,015,200	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	100.71	563,981,600	0.100	2025/3/20	0.68
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	560,000,000	101.25	567,012,600	100.55	563,113,600	0.100	2027/9/20	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	100.28	551,551,000	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	101.99	542,629,360	0.600	2023/12/20	0.66
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	540,000,000	101.19	546,437,700	100.23	541,252,800	0.100	2028/12/20	0.65
日本	国債証券	第350回利付国債（10年）	520,000,000	101.29	526,723,600	100.45	522,376,400	0.100	2028/3/20	0.63
日本	国債証券	第151回利付国債（20年）	455,000,000	113.52	516,539,700	111.63	507,934,700	1.200	2034/12/20	0.61
日本	国債証券	第150回利付国債（20年）	430,000,000	116.04	498,991,800	114.25	491,292,200	1.400	2034/9/20	0.59

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	82.90
地方債証券	5.36
特殊債券	6.75
社債券	4.23
合計	99.25

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2021年 2月26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	87,076,762,955	43.27
	カナダ	4,019,779,244	2.00
	メキシコ	1,584,593,536	0.79
	ドイツ	15,518,160,945	7.71
	イタリア	19,600,464,571	9.74
	フランス	21,794,157,296	10.83
	オランダ	3,822,545,770	1.90
	スペイン	12,463,401,319	6.19
	ベルギー	5,125,134,674	2.55
	オーストリア	3,098,511,999	1.54
	フィンランド	1,312,204,699	0.65
	アイルランド	1,783,506,750	0.89
	イギリス	13,534,115,662	6.72
	スウェーデン	703,399,249	0.35
	ノルウェー	452,703,283	0.22
	デンマーク	1,067,696,669	0.53
	ポーランド	1,342,412,547	0.67
	オーストラリア	5,600,875,709	2.78
	シンガポール	886,038,924	0.44
	マレーシア	1,004,160,054	0.50
イスラエル	875,782,641	0.44	
	小計	202,666,408,496	100.70
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,413,369,876	0.70
合計（純資産総額）		201,253,038,620	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		209,792,499,690	104.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,150,000	10,329.49	1,048,443,456	9,826.46	997,386,127	0.625	2030/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,770,000	10,484.32	1,024,318,378	10,029.00	979,833,629	0.875	2030/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	10,556.56	960,647,446	10,254.78	933,185,400	0.625	2027/11/30	0.46
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,730,000	24,430.60	911,261,492	22,892.74	853,899,262	4.500	2041/4/25	0.42
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,050,000	15,950.38	805,494,261	15,542.11	784,876,940	2.750	2027/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,558.66	813,801,560	12,070.99	782,200,512	3.125	2028/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,357.71	758,184,688	9,868.38	722,365,645	0.625	2030/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	12,292.62	748,620,965	11,852.27	721,803,266	2.875	2028/5/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,700,000	10,624.35	711,831,835	10,623.33	711,763,733	0.125	2022/6/30	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,440,000	16,561.15	735,315,283	15,955.96	708,444,886	2.500	2030/5/25	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,160,000	13,722.71	708,092,198	13,596.06	701,557,009	1.750	2023/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,910,000	12,209.18	721,563,070	11,863.47	701,131,464	2.875	2028/8/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,720,000	15,462.39	729,824,968	14,836.31	700,273,970	1.500	2031/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,450.09	699,600,934	11,335.96	692,627,232	2.375	2024/8/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	12,166.03	711,713,303	11,748.92	687,312,127	2.750	2028/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,209.78	706,216,731	10,707.38	674,565,267	1.500	2030/2/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,100,000	22,372.01	693,532,348	21,403.21	663,499,691	5.750	2032/10/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,445.53	668,419,043	11,347.99	662,723,039	2.500	2024/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,170.18	686,398,688	11,692.47	659,455,868	2.625	2029/2/15	0.33
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	19,562.73	672,958,185	18,930.03	651,193,104	5.500	2029/4/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	9,838.91	747,757,381	8,495.01	645,621,444	1.375	2050/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,620.84	637,250,928	10,621.67	637,300,781	0.125	2022/7/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	11,584.57	645,260,566	11,374.97	633,586,118	2.250	2025/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	11,755.98	652,456,962	11,394.68	632,405,288	2.250	2027/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,420.62	625,850,510	11,333.05	621,051,489	2.750	2023/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,460,000	11,438.47	624,540,821	11,308.56	617,447,864	2.250	2024/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,619.60	615,937,007	10,620.01	615,961,102	0.125	2022/9/30	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,800,000	10,607.98	615,263,014	10,437.40	605,369,305	0.375	2025/11/30	0.30
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,380,000	14,183.13	621,221,365	13,816.62	605,168,044	0.750	2028/5/25	0.30
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,470,000	11,085.27	606,364,716	10,958.69	599,440,390	1.375	2025/1/31	0.30

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	100.70
合計	100.70

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	売建	846,533,000.00	89,686,615,911	89,893,339,270	44.67
	カナダドル	売建	49,530,000.00	4,195,755,642	4,162,996,500	2.07
	メキシコペソ	売建	326,219,000.00	1,683,942,478	1,644,143,760	0.82
	ユーロ	売建	675,548,000.00	87,154,102,572	87,274,046,120	43.37
	英ポンド	売建	97,660,000.00	14,634,956,492	14,495,673,800	7.20
	スウェーデンクローナ	売建	56,616,000.00	724,655,925	722,986,320	0.36
	ノルウェークローネ	売建	37,603,000.00	475,542,579	467,405,290	0.23
	デンマーククローネ	売建	63,531,000.00	1,101,633,893	1,103,533,470	0.55
	ポーランドズロチ	売建	48,130,000.00	1,377,026,252	1,373,630,200	0.68
	オーストラリアドル	売建	70,111,000.00	5,915,517,469	5,838,844,080	2.90
	シンガポールドル	売建	11,422,000.00	917,234,572	913,074,680	0.45
	マレーシアリングット	売建	36,220,000.00	933,164,000	947,877,400	0.47
	イスラエルシェケル	売建	29,620,000.00	960,721,738	954,948,800	0.47

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	40,692,232,850	99.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		382,381,921	0.93
合計(純資産総額)		41,074,614,771	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	337,590,000	0.82

(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	161,200	7,647.80	1,232,825,360	7,873.00	1,269,127,600	3.09
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	123,900	8,645.48	1,071,174,972	9,895.00	1,225,990,500	2.98
日本	株式	ソニー	電気機器	99,700	10,318.17	1,028,721,549	11,120.00	1,108,664,000	2.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	15,600	57,317.27	894,149,412	50,560.00	788,736,000	1.92
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,073,800	479.84	515,252,192	558.00	599,180,400	1.46
日本	株式	任天堂	その他製品	9,100	62,647.19	570,089,429	64,750.00	589,225,000	1.43
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	108,900	4,674.12	509,011,668	5,281.00	575,100,900	1.40
日本	株式	日本電産	電気機器	38,300	14,337.92	549,142,336	13,520.00	517,816,000	1.26
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	182,700	2,727.32	498,281,364	2,758.00	503,886,600	1.23
日本	株式	信越化学工業	化学	28,800	19,414.21	559,129,248	17,350.00	499,680,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	132,400	3,710.45	491,263,580	3,582.00	474,256,800	1.15
日本	株式	村田製作所	電気機器	46,800	10,499.26	491,365,368	9,081.00	424,990,800	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	20,300	23,247.57	471,925,671	20,720.00	420,616,000	1.02
日本	株式	KDDI	情報・通信業	125,200	3,240.13	405,664,276	3,290.00	411,908,000	1.00
日本	株式	第一三共	医薬品	136,600	3,555.80	485,722,280	3,010.00	411,166,000	1.00
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	108,600	3,313.18	359,811,348	3,742.00	406,381,200	0.99
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	9,300	43,612.76	405,598,668	43,550.00	405,015,000	0.99
日本	株式	HOYA	精密機器	31,600	13,613.57	430,188,812	12,100.00	382,360,000	0.93
日本	株式	日立製作所	電気機器	76,500	4,406.76	337,117,140	4,876.00	373,014,000	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	14,000	27,098.09	379,373,260	26,340.00	368,760,000	0.90
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	125,300	2,822.02	353,599,106	2,911.50	364,810,950	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	109,600	3,109.68	340,820,928	3,168.00	347,212,800	0.85
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	213,300	1,394.52	297,451,116	1,559.00	332,534,700	0.81
日本	株式	S M C	機械	4,700	67,359.19	316,588,193	62,900.00	295,630,000	0.72
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	16,200	16,262.49	263,452,338	17,840.00	289,008,000	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	127,300	2,024.74	257,749,402	2,263.50	288,143,550	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	95,400	2,701.69	257,741,226	3,003.00	286,486,200	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	52,000	5,374.32	279,464,640	5,253.00	273,156,000	0.67
日本	株式	花王	化学	38,100	7,672.54	292,323,774	7,144.00	272,186,400	0.66
日本	株式	資生堂	化学	31,600	7,047.89	222,713,324	7,913.00	250,050,800	0.61

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	0.18
		建設業	2.26
		食料品	3.30
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.25
		化学	7.23

医薬品	5.40
石油・石炭製品	0.44
ゴム製品	0.59
ガラス・土石製品	0.79
鉄鋼	0.69
非鉄金属	0.78
金属製品	0.62
機械	5.53
電気機器	17.49
輸送用機器	6.92
精密機器	2.53
その他製品	2.47
電気・ガス業	1.27
陸運業	3.60
海運業	0.20
空運業	0.48
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	9.50
卸売業	4.66
小売業	4.69
銀行業	5.01
証券、商品先物取引業	0.81
保険業	1.88
その他金融業	1.08
不動産業	1.98
サービス業	5.70
合 計	99.07

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	18	日本円	334,587,700	337,590,000	0.82

(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 2月26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	46,994,742,595	54.20
	カナダ	2,470,562,082	2.85
	パナマ	17,955,554	0.02
	ドイツ	2,147,009,739	2.48
	イタリア	431,211,019	0.50
	フランス	2,386,223,332	2.75
	オランダ	1,363,759,237	1.57
	スペイン	568,948,356	0.66
	ベルギー	200,143,303	0.23
	オーストリア	41,828,399	0.05
	ルクセンブルク	60,153,815	0.07
	フィンランド	291,454,482	0.34
	アイルランド	1,276,863,789	1.47
	ポルトガル	41,138,088	0.05
	イギリス	3,186,107,576	3.67
	スイス	2,344,366,195	2.70
	スウェーデン	783,336,254	0.90
	ノルウェー	147,404,393	0.17
	デンマーク	567,730,953	0.65
	ケイマン	143,168,013	0.17
	リベリア	23,959,527	0.03
	オーストラリア	1,574,367,674	1.82
	バミューダ	210,257,039	0.24
	ニュージーランド	80,410,365	0.09
	パプアニューギニア	11,836,348	0.01
	香港	613,587,685	0.71
	シンガポール	219,581,684	0.25
	イスラエル	137,670,568	0.16
	キュラソー	56,230,808	0.06
	ジャージー	273,532,529	0.32
マン島	14,808,282	0.02	
小計	68,680,349,683	79.21	
投資証券	アメリカ	1,278,428,228	1.47
	カナダ	6,486,029	0.01
	フランス	34,579,940	0.04
	イギリス	43,085,800	0.05
	オーストラリア	103,734,934	0.12
	香港	31,839,142	0.04

	シンガポール	33,044,065	0.04
	小計	1,531,198,138	1.77
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,493,535,782	19.02
合計(純資産総額)		86,705,083,603	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	12,466,121,250	14.38
	買建	ドイツ	3,289,398,840	3.79

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

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		655,573,050	0.76

(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	14,776.18	3,453,180,243	12,855.18	3,004,244,464	3.46
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	98,226	24,007.18	2,358,129,999	24,330.18	2,389,856,997	2.76
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	5,817	349,799.43	2,034,783,328	324,823.24	1,889,496,845	2.18
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	32,918	29,165.62	960,074,044	27,060.81	890,787,826	1.03
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	4,114	201,986.56	830,972,718	215,832.00	887,932,848	1.02
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,117	201,084.49	827,864,886	214,194.68	881,839,528	1.02
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	10,210	89,955.50	918,445,655	72,485.87	740,080,784	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	41,718	14,215.18	593,029,192	16,062.87	670,111,019	0.77
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	36,055	17,377.18	626,534,496	17,293.25	623,508,129	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	23,094	21,464.62	495,704,050	22,710.93	524,486,391	0.60
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	24,844	18,357.87	456,083,047	20,291.62	504,125,132	0.58
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	19,252	24,747.75	476,443,683	25,892.06	498,473,987	0.57

アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	8,445	58,278.12	492,158,765	56,556.87	477,622,809	0.55
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	12,242	34,955.18	427,921,405	37,673.06	461,193,631	0.53
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	34,093	13,812.50	470,909,563	13,449.12	458,521,019	0.53
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	13,033	36,927.18	481,272,035	34,942.43	455,404,788	0.53
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	39,531	11,853.68	468,588,093	11,288.10	446,230,197	0.51
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	15,303	26,775.00	409,737,825	26,981.12	412,892,156	0.48
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	106,922	3,352.18	358,422,592	3,817.56	408,181,418	0.47
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	14,748	30,175.00	445,020,900	27,120.31	399,970,369	0.46
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	58,306	6,020.12	351,009,408	6,417.50	374,178,755	0.43
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	5,862	59,783.53	350,451,083	61,339.79	359,573,864	0.41
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	6,074	60,049.31	364,739,524	58,086.87	352,819,679	0.41
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	62,734	5,172.24	324,475,931	5,550.50	348,205,067	0.40
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	58,218	5,039.43	293,385,972	5,924.50	344,912,541	0.40
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	56,968	6,106.18	347,857,290	6,003.12	341,986,025	0.39
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9,649	37,366.92	360,553,440	34,855.84	336,324,068	0.39
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	6,583	50,196.74	330,445,205	48,785.74	321,156,592	0.37
アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・サービス	24,356	11,989.25	292,010,173	12,917.87	314,627,764	0.36
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	12,489	23,988.06	299,586,912	24,552.24	306,633,050	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	2.80
		素材	3.73
		資本財	5.33
		商業・専門サービス	0.86
		運輸	1.63
		自動車・自動車部品	1.66
		耐久消費財・アパレル	1.56
		消費者サービス	1.32
		メディア・娯楽	5.86

	小売	4.62
	食品・生活必需品小売り	1.07
	食品・飲料・タバコ	3.16
	家庭用品・パーソナル用品	1.48
	ヘルスケア機器・サービス	4.16
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.17
	銀行	5.09
	各種金融	3.72
	保険	2.64
	不動産	0.37
	ソフトウェア・サービス	9.67
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.70
	電気通信サービス	1.46
	公益事業	2.46
	半導体・半導体製造装置	3.68
投資証券		1.77
合計		80.98

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	613	米ドル	118,594,635	12,600,679,975	117,328,200	12,466,121,250	14.38
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002103	買建	1,240	ユーロ	25,419,540	3,282,933,595	25,469,600	3,289,398,840	3.79

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	4,136,000.00	439,408,640	439,408,640	0.51
	カナダドル	売建	81,000.00	6,810,723	6,810,480	0.01
	ユーロ	売建	674,000.00	87,043,730	87,047,100	0.10
	英ポンド	売建	145,000.00	21,528,150	21,528,150	0.02
	スイスフラン	売建	128,000.00	15,017,856	15,019,520	0.02
	スウェーデンクローナ	売建	1,228,000.00	15,684,016	15,681,560	0.02
	ノルウェークローネ	売建	587,000.00	7,303,454	7,302,280	0.01
	デンマーククローネ	売建	1,025,000.00	17,801,175	17,804,250	0.02

オーストラリアドル	売建	272,000.00	22,658,144	22,657,600	0.03
ニュージーランドドル	売建	33,000.00	2,573,340	2,573,010	0.00
香港ドル	売建	1,027,000.00	14,069,900	14,069,900	0.02
シンガポールドル	売建	33,000.00	2,639,571	2,640,000	0.00
イスラエルシェケル	売建	94,000.00	3,030,560	3,030,560	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 2月26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	42,852,516	0.32
	アルゼンチン	1,402,936	0.01
	メキシコ	175,575,445	1.30
	ブラジル	498,581,182	3.68
	チリ	60,638,776	0.45
	コロンビア	18,518,050	0.14
	ペルー	3,809,848	0.03
	オランダ	34,166,115	0.25
	ルクセンブルク	21,969,784	0.16
	ギリシャ	10,823,903	0.08
	トルコ	39,669,627	0.29
	チェコ	10,807,739	0.08
	ハンガリー	24,075,137	0.18
	ポーランド	65,784,547	0.49
	ロシア	281,438,693	2.08
	ケイマン	3,096,315,079	22.86
	バミューダ	96,902,381	0.72
	香港	132,040,696	0.97
	シンガポール	3,658,585	0.03
	マレーシア	158,170,761	1.17
	タイ	206,778,857	1.53
	フィリピン	75,636,872	0.56
	インドネシア	148,005,269	1.09
韓国	1,549,253,231	11.44	
台湾	1,593,901,896	11.77	
中国	1,296,908,850	9.58	
インド	1,098,034,501	8.11	
カタール	74,496,753	0.55	

	エジプト	8,004,314	0.06
	南アフリカ	399,287,335	2.95
	ジャージー	6,575,585	0.05
	英ヴァージン諸島	4,913,940	0.04
	アラブ首長国連邦	63,222,261	0.47
	マン島	3,842,457	0.03
	クウェート	55,004,312	0.41
	サウジアラビア	287,058,792	2.12
	小計	11,648,127,025	86.01
投資証券	メキシコ	5,479,237	0.04
	南アフリカ	4,700,303	0.03
	小計	10,179,540	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,884,394,505	13.91
合計（純資産総額）		13,542,701,070	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	1,917,610,619	14.16

(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		35,786,210	0.26
	売建		89,741	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	2,479.18	803,254,320	2,425.70	785,926,800	5.80
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	75,600	9,466.70	715,682,520	9,473.55	716,200,380	5.29
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	24,830	27,478.37	682,288,052	25,519.12	633,639,874	4.68
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	8,246.00	517,683,880	8,103.50	508,737,730	3.76
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	47,500	5,208.74	247,415,150	5,074.48	241,037,800	1.78
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,730	25,126.20	143,973,126	25,111.25	143,887,485	1.06

インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	37,549	3,012.91	113,131,832	3,152.19	118,361,751	0.87
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,650	26,854.68	98,019,610	31,258.75	114,094,438	0.84
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	11,420	10,084.18	115,161,421	9,919.50	113,280,690	0.84
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,273,000	83.02	105,687,006	86.99	110,744,635	0.82
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	78,500	1,335.75	104,856,375	1,337.12	104,963,920	0.78
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	7,250	12,207.50	88,504,375	14,107.50	102,279,375	0.76
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	5,000	18,263.31	91,316,563	18,175.12	90,875,625	0.67
ブラジル	株式	VALE SA	素材	48,800	1,792.59	87,478,430	1,841.46	89,863,267	0.66
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	22,428	3,806.49	85,371,992	3,946.50	88,512,304	0.65
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	44,914	1,971.04	88,527,717	1,873.58	84,150,354	0.62
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	16,900	6,582.18	111,238,968	4,973.56	84,053,206	0.62
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	7,372.00	80,199,988	7,039.49	76,582,720	0.57
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	464.13	76,952,754	445.03	73,785,974	0.54
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	20,000	3,502.94	70,058,800	3,606.08	72,121,600	0.53
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	408.26	76,752,880	367.84	69,154,860	0.51
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	5,510	12,405.75	68,355,683	11,545.12	63,613,639	0.47
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	67,302	784.68	52,810,937	923.15	62,130,514	0.46
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,629	32,632.49	53,158,342	36,385.00	59,271,165	0.44
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	810,000	69.04	55,928,880	71.78	58,148,280	0.43
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	40,500	1,661.81	67,303,305	1,428.91	57,870,855	0.43
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	35,132	1,516.18	53,266,699	1,583.12	55,618,347	0.41
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,388	4,855.55	60,150,640	4,403.09	54,545,491	0.40
韓国	株式	LG CHEM LTD	素材	607	92,625.00	56,223,375	84,550.00	51,321,850	0.38
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	79,958	605.62	48,424,564	636.64	50,905,260	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	4.06
		素材	6.63
		資本財	2.23
		商業・専門サービス	0.23

	運輸	1.17
	自動車・自動車部品	3.03
	耐久消費財・アパレル	1.17
	消費者サービス	1.35
	メディア・娯楽	8.64
	小売	10.44
	食品・生活必需品小売り	0.99
	食品・飲料・タバコ	2.83
	家庭用品・パーソナル用品	0.85
	ヘルスケア機器・サービス	1.07
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.75
	銀行	10.82
	各種金融	1.77
	保険	2.46
	不動産	1.69
	ソフトウェア・サービス	2.00
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	8.01
	電気通信サービス	1.93
	公益事業	1.64
	半導体・半導体製造装置	8.28
投資証券		0.08
合計		86.09

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	266	米ドル	18,461,120	1,961,494,000	18,048,100	1,917,610,619	14.16

(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	336,843.10	35,787,698	35,786,210	0.26
	ブラジルレアル	売建	4,664.38	91,327	89,741	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

RAM新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 2月26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	1,549,966,341	29.58
	アイルランド	3,660,949,547	69.87
	小計	5,210,915,888	99.46
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		28,548,391	0.54
合計（純資産総額）		5,239,464,279	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	602,167	6,183.74	3,723,650,186	6,079.62	3,660,949,547	69.87
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	459,462	3,480.75	1,599,272,357	3,373.43	1,549,966,341	29.58

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.46
合計	99.46

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 2月26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	26,125,314,430	97.01
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		806,307,477	2.99
合計(純資産総額)		26,931,621,907	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	713,730,000	2.65

(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	2,834	598,932.19	1,697,373,826	651,000	1,844,934,000	6.85
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,518	609,049.75	1,533,587,270	649,000	1,634,182,000	6.07
日本	投資証券	G L P投資法人	7,868	171,361.3	1,348,270,708	172,600	1,358,016,800	5.04
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,143	155,001.07	1,262,173,713	159,500	1,298,808,500	4.82
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,981	333,659.66	1,328,299,106	326,000	1,297,806,000	4.82
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,593	273,059.02	981,101,058	279,600	1,004,602,800	3.73
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	9,452	96,124.21	908,566,032	105,300	995,295,600	3.70
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,017	171,962.53	862,736,013	181,300	909,582,100	3.38
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,385	135,351.3	728,866,750	146,200	787,287,000	2.92
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,392	306,803.95	733,875,048	323,500	773,812,000	2.87
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,559	192,245.17	684,200,560	183,000	651,297,000	2.42
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,406	75,075	556,005,450	84,600	626,547,600	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,568	362,677.49	568,678,304	385,500	604,464,000	2.24
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,262	420,527.39	530,705,566	468,000	590,616,000	2.19
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	779	658,030.33	512,605,627	704,000	548,416,000	2.04
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,112	53,755.66	436,065,913	65,700	532,958,400	1.98
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	868	561,566.63	487,439,834	594,000	515,592,000	1.91
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,645	311,974.14	513,197,460	312,000	513,240,000	1.91
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	879	526,673.25	462,945,786	519,000	456,201,000	1.69
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	10,529	35,573.7	374,555,487	43,200	454,852,800	1.69
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,806	164,102.11	460,470,520	160,700	450,924,200	1.67
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,958	146,107.02	432,184,565	147,500	436,305,000	1.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	836	421,002.8	351,958,340	468,000	391,248,000	1.45
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	536	655,877.25	351,550,206	729,000	390,744,000	1.45
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,554	138,119.65	352,757,586	148,200	378,502,800	1.41

日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,132	296,851	336,035,332	317,000	358,844,000	1.33
日本	投資証券	大和証券りビング投資法人	3,288	97,445.88	320,402,053	104,000	341,952,000	1.27
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,027	156,438.65	317,101,143	168,300	341,144,100	1.27
日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,090	96,381.35	297,818,371	108,086	333,985,740	1.24
日本	投資証券	プレミア投資法人	2,274	128,775.41	292,835,282	144,600	328,820,400	1.22

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.01
合計	97.01

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	370	日本円	675,733,850	713,730,000	2.65

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

R A M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 2月26日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	オーストラリア	16,235,452	0.06
投資証券	アメリカ	18,525,511,370	72.67
	カナダ	474,979,304	1.86
	ドイツ	71,234,386	0.28
	イタリア	5,042,056	0.02
	フランス	604,908,391	2.37
	オランダ	51,517,727	0.20
	スペイン	126,696,422	0.50
	ベルギー	352,012,912	1.38
	アイルランド	31,128,118	0.12
	イギリス	1,450,044,528	5.69
	オーストラリア	1,824,292,087	7.16

	ニュージーランド	121,050,272	0.47
	香港	437,785,623	1.72
	シンガポール	1,035,660,390	4.06
	韓国	33,180,080	0.13
	イスラエル	14,284,644	0.06
	ガーンジー	60,826,340	0.24
	マン島	6,547,255	0.03
	小計	25,226,701,905	98.96
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		249,582,846	0.98
合計(純資産総額)		25,492,520,203	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		175,694,100	0.69

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	132,799	10,815.18	1,436,246,085	10,772.68	1,430,602,127	5.61
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	16,224	76,695.50	1,244,307,792	67,826.81	1,100,422,206	4.32
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	51,043	14,958.93	763,549,046	14,276.81	728,731,340	2.86
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	59,679	10,210.62	609,359,889	12,199.62	728,061,420	2.86
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	27,657	23,770.24	657,413,804	25,857.00	715,127,049	2.81
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	75,919	6,718.18	510,038,077	7,467.25	566,906,153	2.22
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	25,434	17,587.56	447,322,065	19,159.00	487,290,006	1.91
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	62,399	6,577.93	410,456,722	7,090.06	442,412,810	1.74
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	308,409	1,477.91	455,803,644	1,395.44	430,367,026	1.69
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	64,257	6,368.62	409,228,737	6,543.93	420,493,792	1.65
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,668	17,948.81	406,863,682	17,261.37	391,280,849	1.53
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	68,142	5,213.68	355,271,093	5,736.43	390,892,324	1.53
香港	投資証券	LINK REIT	377,900	941.18	355,675,700	1,017.22	384,409,327	1.51
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,873	25,988.75	308,564,429	27,736.56	329,316,207	1.29
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	19,618	15,636.81	306,762,988	16,532.50	324,334,585	1.27
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	23,478	12,278.24	288,268,753	13,762.56	323,117,442	1.27
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	101,929	3,197.06	325,873,383	3,156.68	321,758,000	1.26
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	98,445	3,206.62	315,676,199	3,164.12	311,492,286	1.22
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,987	14,289.56	299,895,048	14,652.93	307,521,199	1.21
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	217,920	1,446.19	315,154,858	1,376.40	299,947,180	1.18
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	97,764	2,807.12	274,435,768	2,996.25	292,925,385	1.15

アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	68,096	4,284.00	291,723,264	4,252.12	289,552,704	1.14
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	25,949	9,708.06	251,914,514	10,914.00	283,207,386	1.11
アメリカ	投資証券	UDR INC	54,098	4,170.31	225,605,566	4,502.87	243,596,532	0.96
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	103,341	2,286.49	236,289,196	2,316.24	239,363,591	0.94
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	32,136	7,157.00	229,997,353	7,432.18	238,840,778	0.94
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	955,056	235.76	225,170,974	244.09	233,127,546	0.91
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	129,538	1,532.12	198,468,408	1,738.24	225,169,428	0.88
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	31,144	6,718.18	209,231,232	6,638.50	206,749,444	0.81
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	17,915	10,939.49	195,981,142	11,205.12	200,739,814	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	0.06
投資証券			98.96
合計			99.02

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	1,230,000.00	130,675,200	130,675,200	0.51
	カナダドル	売建	80,000.00	6,726,640	6,726,400	0.03
	ユーロ	売建	70,000.00	9,040,150	9,040,500	0.04
	英ポンド	売建	60,000.00	8,908,200	8,908,200	0.03
	オーストラリアドル	売建	126,000.00	10,496,052	10,495,800	0.04
	香港ドル	売建	240,000.00	3,288,000	3,288,000	0.01
	シンガポールドル	売建	82,000.00	6,558,934	6,560,000	0.03

(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。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なっておりません。

2【換金(解約)手続等】

(1)解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

(2)取扱時間

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

(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。

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

- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日(この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。
- ・また基準価額が『確保ライン』まで下落した場合は、償還日までの一定期間において解約請求の受付を中止する場合があります。

3【資産管理等の概要】

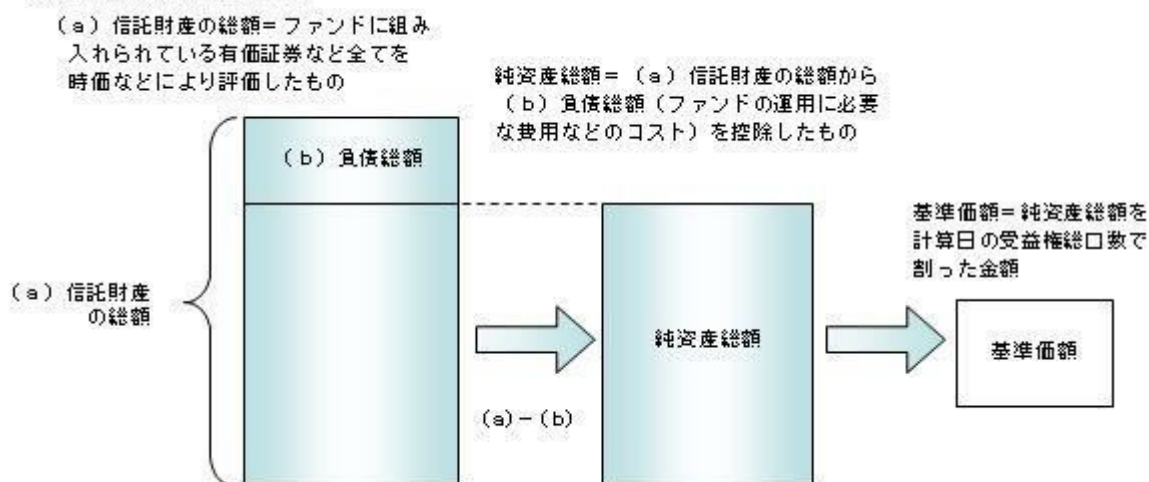
(1)【資産の評価】

基準価額の算出

- ・基準価額は委託会社の営業日において日々算出されます。
- ・基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券を除きます。)を評価して得た信託財産の総額から負債総額を控除した金額(純資産総額)を、計算日における受益権総口数で除した金額を

います。なお、ファンドは1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

< 基準価額算出の流れ >



有価証券などの評価基準

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

< 主な資産の評価方法 >

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日^{*}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/>

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2030年2月15日までとします(2020年3月31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2月16日から翌年2月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

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

償還金について

- ・ 償還金は、信託終了日後1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(保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。)すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(以下「併合」といいます。)を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。
- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なもの(保証会社を変更する場合を含みます。以下同じ。)または併合(受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。)については、書面決議を行ないます。(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。

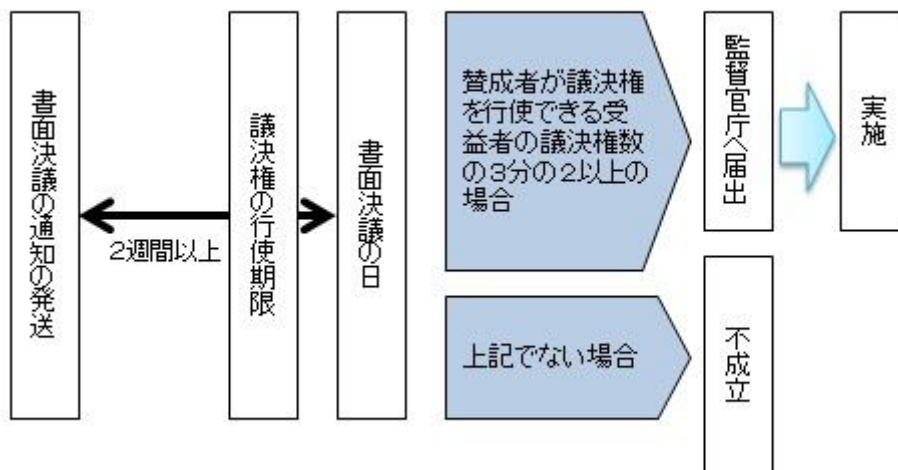
書面決議

- 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週間前までに知れ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、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使わないときは、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、議決権を行行使う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、原則として知っている受益者に対して交付されます。
- ・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有

します。

- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2020年 3月31日から2021年 2月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【りそな・リスクコントロールファンド2020 - 03】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2021年 2月15日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	108,709,515
親投資信託受益証券	16,841,247,278
未収入金	47,781,000
流動資産合計	16,997,737,793
資産合計	16,997,737,793
負債の部	
流動負債	
未払解約金	46,367,226
未払受託者報酬	2,077,994
未払委託者報酬	76,191,718
未払利息	294
その他未払費用	18,579,252
流動負債合計	143,216,484
負債合計	143,216,484
純資産の部	
元本等	
元本	16,022,272,837
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	832,248,472
元本等合計	16,854,521,309
純資産合計	16,854,521,309
負債純資産合計	16,997,737,793

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,222,067,306
営業収益合計	1,222,067,306
営業費用	
支払利息	704,833
受託者報酬	5,673,289
委託者報酬	198,155,940
その他費用	48,364,296
営業費用合計	252,898,358
営業利益又は営業損失（ ）	969,168,948
経常利益又は経常損失（ ）	969,168,948
当期純利益又は当期純損失（ ）	969,168,948
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	136,920,476
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	136,920,476
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	832,248,472

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2020年 3月31日）から2021年 2月15日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2021年 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
設定年月日	2020年 3月31日
設定元本額	22,473,977,738円
期首元本額	22,473,977,738円
元本残存率	71.2%
2. 計算期間の末日における受益権の総数	16,022,272,837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口当たり純資産額	1.0519円
(10,000口当たり純資産額)	(10,519円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日	
分配金の計算過程	
A 当ファンドの配当等収益額	704,833円
B 親ファンドの配当等収益額	246,763,002円
RAM国内株式マザーファンド	4,835,151円
RAM国内リートマザーファンド	6,460,962円
RAM先進国株式マザーファンド	22,877,411円
RAM新興国株式マザーファンド	4,395,726円
RAM先進国リートマザーファンド	10,486,123円
RAM国内債券マザーファンド	17,861,763円
RAM新興国債券マザーファンド	8,384,846円
RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	171,702,820円
RAMマネーマザーファンド	241,800円
C 配当等収益額合計(A+B)	246,058,169円
D 経費	252,193,525円
E 差引配当等収益額(C-D)	6,135,356円

F	当ファンドの当期末残存受益権口数	16,022,272,837口
G	当ファンドの期中平均残存受益権口数	19,216,383,576口
H	分配対象配当等収益額(E×F/G)	0円
I	元本超過額	832,248,472円
J	分配可能額(H<I)	832,248,472円
K	10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	519円
L	10,000口当たりの分配額	0円
M	収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日	
1.	金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.	金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3.	金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2021年 2月15日現在	
1.	貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.	時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3.	金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2020年 3月31日 至 2021年 2月15日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	879,405,870
合計	879,405,870

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

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R A M国内債券マザーファンド	2,291,612,781	2,401,381,033	
	R A M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	9,035,748,256	9,548,978,756	
	R A M国内株式マザーファンド	351,114,905	491,525,755	
	R A M先進国株式マザーファンド	1,792,962,443	2,929,521,335	
	R A M新興国株式マザーファンド	284,536,802	491,651,140	
	R A M新興国債券マザーファンド	219,361,202	241,801,852	
	R A M国内リートマザーファンド	181,651,027	248,843,741	
	R A M先進国リートマザーファンド	449,680,563	487,543,666	
合計		14,606,667,979	16,841,247,278	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

R A M国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 2月15日現在

資産の部

2021年 2月15日現在

流動資産	
金銭信託	667,065
コール・ローン	456,787,462
国債証券	69,691,417,230
地方債証券	4,449,487,100
特殊債券	5,601,909,550
社債券	3,512,985,000
未収利息	174,897,000
前払費用	6,026,203
流動資産合計	83,894,176,610
資産合計	83,894,176,610
負債の部	
流動負債	
未払解約金	172,989,000
未払利息	1,238
流動負債合計	172,990,238
負債合計	172,990,238
純資産の部	
元本等	
元本	79,895,842,435
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,825,343,937
元本等合計	83,721,186,372
純資産合計	83,721,186,372
負債純資産合計	83,894,176,610

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	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券</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>
-----------------	---

(貸借対照表に関する注記)

2021年 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	61,425,296,985円
期中追加設定元本額	52,930,798,257円
期中一部解約元本額	34,460,252,807円
期末元本額	79,895,842,435円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	5,869,443,333円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,093,689,586円
りそなラップ型ファンド(成長型)	137,679,003円
DCりそな グローバルバランス	490,800,744円
つみたてバランスファンド	2,278,525,180円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,633,869,984円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	340,852,610円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	79,403,971円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	54,008,951円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	15,889,862円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,303,061円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	631,156円
リスクコントロール・オープン	54,380,120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	45,860,796,009円
Smart-i 国内債券インデックス	1,010,847,479円
Smart-i 8資産バランス 安定型	592,797,387円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	355,513,445円
Smart-i 8資産バランス 成長型	130,512,223円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,554,421,054円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,813,257,010円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,780,484,861円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,092,362,826円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,291,612,781円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	383,896,111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)	12,416,216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	79,895,842,435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	1.0479円
(10,000口当たり純資産額)	(10,479円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	<p>国債証券、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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 2月15日現在	
該当事項はありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券	230,434,120	
地方債証券	8,088,800	
特殊債券	10,684,607	
社債券	4,656,000	
合計	253,863,527	

（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4 1 0 回利付国債（2年）	410,000,000	410,975,800	
	第4 1 2 回利付国債（2年）	330,000,000	330,933,900	
	第4 1 3 回利付国債（2年）	550,000,000	551,628,000	
	第4 1 4 回利付国債（2年）	430,000,000	431,384,600	
	第4 1 5 回利付国債（2年）	240,000,000	240,820,800	
	第4 1 6 回利付国債（2年）	120,000,000	120,434,400	
	第4 1 7 回利付国債（2年）	350,000,000	351,333,500	
	第4 1 8 回利付国債（2年）	440,000,000	441,804,000	
	第4 2 0 回利付国債（2年）	280,000,000	281,234,800	
	第1 3 1 回利付国債（5年）	360,000,000	360,882,000	
	第1 3 2 回利付国債（5年）	40,000,000	40,123,200	
	第1 3 3 回利付国債（5年）	1,280,000,000	1,284,684,800	
	第1 3 4 回利付国債（5年）	830,000,000	833,519,200	
	第1 3 5 回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,004,700,000	
	第1 3 6 回利付国債（5年）	940,000,000	944,953,800	
	第1 3 7 回利付国債（5年）	710,000,000	714,153,500	
	第1 3 8 回利付国債（5年）	700,000,000	704,690,000	
	第1 3 9 回利付国債（5年）	1,020,000,000	1,027,272,600	
	第1 4 0 回利付国債（5年）	740,000,000	745,579,600	
	第1 4 1 回利付国債（5年）	330,000,000	332,616,900	
	第1 4 2 回利付国債（5年）	480,000,000	483,979,200	
	第1 4 3 回利付国債（5年）	560,000,000	564,944,800	
	第1 4 4 回利付国債（5年）	630,000,000	635,764,500	
	第1 4 5 回利付国債（5年）	450,000,000	454,360,500	
第1 4 6 回利付国債（5年）	260,000,000	262,592,200		

第1回利付国債(40年)	40,000,000	57,581,200
第2回利付国債(40年)	100,000,000	139,633,000
第3回利付国債(40年)	110,000,000	154,350,900
第4回利付国債(40年)	150,000,000	211,707,000
第5回利付国債(40年)	170,000,000	232,356,000
第6回利付国債(40年)	170,000,000	229,156,600
第7回利付国債(40年)	150,000,000	194,745,000
第8回利付国債(40年)	190,000,000	231,053,300
第9回利付国債(40年)	300,000,000	273,108,000
第10回利付国債(40年)	290,000,000	309,383,600
第11回利付国債(40年)	220,000,000	227,818,800
第12回利付国債(40年)	250,000,000	233,907,500
第13回利付国債(40年)	190,000,000	177,518,900
第321回利付国債(10年)	241,000,000	243,952,250
第322回利付国債(10年)	220,000,000	222,455,200
第323回利付国債(10年)	340,000,000	344,675,000
第324回利付国債(10年)	183,000,000	185,271,030
第325回利付国債(10年)	330,000,000	334,867,500
第326回利付国債(10年)	280,000,000	284,261,600
第327回利付国債(10年)	387,000,000	393,602,220
第328回利付国債(10年)	411,000,000	417,234,870
第329回利付国債(10年)	297,000,000	303,409,260
第330回利付国債(10年)	257,000,000	263,144,870
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,683,900
第332回利付国債(10年)	532,000,000	542,996,440
第333回利付国債(10年)	225,000,000	230,055,750
第334回利付国債(10年)	261,000,000	267,300,540
第335回利付国債(10年)	345,000,000	352,652,100
第336回利付国債(10年)	210,000,000	214,941,300
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,687,700
第338回利付国債(10年)	631,000,000	644,213,140
第339回利付国債(10年)	385,000,000	393,558,550
第340回利付国債(10年)	934,000,000	955,977,020
第341回利付国債(10年)	440,000,000	448,668,000
第342回利付国債(10年)	220,000,000	222,191,200
第343回利付国債(10年)	560,000,000	565,706,400
第344回利付国債(10年)	570,000,000	575,922,300
第345回利付国債(10年)	690,000,000	697,286,400
第346回利付国債(10年)	820,000,000	828,774,000
第347回利付国債(10年)	230,000,000	232,488,600
第348回利付国債(10年)	560,000,000	566,115,200
第349回利付国債(10年)	370,000,000	374,066,300

第350回利付国債(10年)	520,000,000	525,361,200
第351回利付国債(10年)	100,000,000	100,993,000
第352回利付国債(10年)	750,000,000	757,125,000
第353回利付国債(10年)	550,000,000	554,961,000
第354回利付国債(10年)	460,000,000	463,905,400
第355回利付国債(10年)	590,000,000	594,666,900
第356回利付国債(10年)	840,000,000	846,123,600
第357回利付国債(10年)	630,000,000	633,887,100
第358回利付国債(10年)	600,000,000	603,258,000
第359回利付国債(10年)	790,000,000	793,302,200
第360回利付国債(10年)	660,000,000	662,197,800
第361回利付国債(10年)	320,000,000	320,780,800
第1回利付国債(30年)	60,000,000	74,274,600
第7回利付国債(30年)	40,000,000	49,628,000
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,210,000
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,456,000
第13回利付国債(30年)	90,000,000	110,419,200
第14回利付国債(30年)	60,000,000	76,884,000
第15回利付国債(30年)	160,000,000	207,678,400
第16回利付国債(30年)	100,000,000	130,175,000
第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,640,500
第18回利付国債(30年)	60,000,000	76,947,600
第19回利付国債(30年)	100,000,000	128,557,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	131,675,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	116,235,000
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,212,000
第23回利付国債(30年)	160,000,000	212,398,400
第24回利付国債(30年)	100,000,000	133,066,000
第25回利付国債(30年)	100,000,000	130,343,000
第26回利付国債(30年)	145,000,000	191,584,150
第27回利付国債(30年)	215,000,000	288,843,900
第28回利付国債(30年)	110,000,000	148,490,100
第29回利付国債(30年)	70,000,000	93,702,000
第30回利付国債(30年)	190,000,000	251,738,600
第31回利付国債(30年)	130,000,000	170,492,400
第32回利付国債(30年)	215,000,000	287,186,250
第33回利付国債(30年)	290,000,000	372,606,500
第34回利付国債(30年)	255,000,000	338,456,400
第35回利付国債(30年)	316,000,000	408,689,120
第36回利付国債(30年)	295,000,000	382,697,600
第37回利付国債(30年)	320,000,000	409,699,200
第38回利付国債(30年)	160,000,000	202,176,000
第39回利付国債(30年)	190,000,000	244,188,000

第40回利付国債(30年)	175,000,000	221,628,750	
第41回利付国債(30年)	155,000,000	193,326,850	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	237,190,300	
第43回利付国債(30年)	80,000,000	99,960,000	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	225,106,200	
第45回利付国債(30年)	190,000,000	229,495,300	
第46回利付国債(30年)	240,000,000	290,035,200	
第47回利付国債(30年)	230,000,000	283,360,000	
第48回利付国債(30年)	233,000,000	276,498,770	
第49回利付国債(30年)	210,000,000	249,282,600	
第50回利付国債(30年)	250,000,000	262,045,000	
第51回利付国債(30年)	210,000,000	195,283,200	
第52回利付国債(30年)	230,000,000	224,399,500	
第53回利付国債(30年)	270,000,000	269,395,200	
第54回利付国債(30年)	230,000,000	240,375,300	
第55回利付国債(30年)	120,000,000	125,316,000	
第56回利付国債(30年)	200,000,000	208,694,000	
第57回利付国債(30年)	230,000,000	239,802,600	
第58回利付国債(30年)	350,000,000	364,609,000	
第59回利付国債(30年)	190,000,000	193,100,800	
第60回利付国債(30年)	190,000,000	202,294,900	
第61回利付国債(30年)	180,000,000	182,336,400	
第62回利付国債(30年)	160,000,000	153,750,400	
第63回利付国債(30年)	210,000,000	196,026,600	
第64回利付国債(30年)	180,000,000	167,733,000	
第65回利付国債(30年)	190,000,000	176,745,600	
第66回利付国債(30年)	200,000,000	185,948,000	
第67回利付国債(30年)	240,000,000	235,303,200	
第68回利付国債(30年)	230,000,000	225,466,700	
第69回利付国債(30年)	50,000,000	50,310,000	
第55回利付国債(20年)	100,000,000	102,320,000	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,285,100	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	112,988,700	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	103,229,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,346,800	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,844,200	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,177,000	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,726,400	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	62,702,400	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	126,301,200	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	401,880,400	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,255,200	

第68回利付国債(20年)	90,000,000	96,485,400
第69回利付国債(20年)	60,000,000	64,137,600
第70回利付国債(20年)	110,000,000	119,293,900
第71回利付国債(20年)	100,000,000	107,779,000
第72回利付国債(20年)	210,000,000	226,774,800
第73回利付国債(20年)	180,000,000	194,650,200
第75回利付国債(20年)	100,000,000	109,074,000
第76回利付国債(20年)	100,000,000	108,253,000
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,732,600
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,370,000
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,835,200
第80回利付国債(20年)	90,000,000	98,650,800
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,913,600
第82回利付国債(20年)	170,000,000	187,294,100
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,070,200
第84回利付国債(20年)	120,000,000	132,258,000
第85回利付国債(20年)	150,000,000	166,789,500
第86回利付国債(20年)	100,000,000	112,215,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	100,533,600
第88回利付国債(20年)	185,000,000	208,667,050
第89回利付国債(20年)	120,000,000	134,707,200
第90回利付国債(20年)	170,000,000	191,770,200
第91回利付国債(20年)	80,000,000	90,694,400
第92回利付国債(20年)	255,000,000	287,538,000
第93回利付国債(20年)	80,000,000	90,124,000
第94回利付国債(20年)	140,000,000	158,572,400
第95回利付国債(20年)	185,000,000	212,851,750
第96回利付国債(20年)	70,000,000	79,647,400
第97回利付国債(20年)	130,000,000	149,442,800
第98回利付国債(20年)	70,000,000	80,005,800
第99回利付国債(20年)	85,000,000	97,578,300
第100回利付国債(20年)	151,000,000	175,102,620
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,476,800
第102回利付国債(20年)	145,000,000	170,981,100
第103回利付国債(20年)	100,000,000	117,182,000
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,571,000
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,939,560
第106回利付国債(20年)	40,000,000	46,769,200
第107回利付国債(20年)	80,000,000	93,282,400
第108回利付国債(20年)	220,000,000	253,072,600
第109回利付国債(20年)	80,000,000	92,330,400
第110回利付国債(20年)	195,000,000	228,210,450
第111回利付国債(20年)	50,000,000	59,149,000

第112回利付国債(20年)	205,000,000	240,801,200	
第113回利付国債(20年)	85,000,000	100,206,500	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	189,203,200	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	119,134,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	167,381,200	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	266,967,000	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	154,746,370	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	174,402,000	
第120回利付国債(20年)	200,000,000	228,818,000	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	240,856,550	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	221,422,200	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	317,576,000	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	237,726,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	145,456,800	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	119,213,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	153,675,600	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	266,582,250	
第129回利付国債(20年)	180,000,000	211,422,600	
第130回利付国債(20年)	180,000,000	211,959,000	
第131回利付国債(20年)	70,000,000	81,695,600	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	198,850,700	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	289,202,900	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,242,650	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	46,889,600	
第136回利付国債(20年)	170,000,000	197,421,000	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	199,714,300	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	103,720,500	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	209,451,600	
第140回利付国債(20年)	340,000,000	400,271,800	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	218,233,400	
第142回利付国債(20年)	210,000,000	250,166,700	
第143回利付国債(20年)	245,000,000	286,664,700	
第144回利付国債(20年)	190,000,000	220,059,900	
第145回利付国債(20年)	375,000,000	444,075,000	
第146回利付国債(20年)	370,000,000	438,975,400	
第147回利付国債(20年)	345,000,000	405,723,450	
第148回利付国債(20年)	335,000,000	390,291,750	
第149回利付国債(20年)	380,000,000	443,319,400	
第150回利付国債(20年)	430,000,000	496,632,800	
第151回利付国債(20年)	455,000,000	513,854,250	
第152回利付国債(20年)	400,000,000	452,016,000	
第153回利付国債(20年)	270,000,000	309,031,200	

	第154回利付国債(20年)	128,000,000	144,812,800
	第155回利付国債(20年)	380,000,000	418,984,200
	第156回利付国債(20年)	370,000,000	375,339,100
	第157回利付国債(20年)	280,000,000	275,287,600
	第158回利付国債(20年)	160,000,000	164,276,800
	第159回利付国債(20年)	360,000,000	374,914,800
	第160回利付国債(20年)	320,000,000	337,827,200
	第161回利付国債(20年)	310,000,000	321,975,300
	第162回利付国債(20年)	220,000,000	228,265,400
	第163回利付国債(20年)	330,000,000	342,031,800
	第164回利付国債(20年)	430,000,000	438,277,500
	第165回利付国債(20年)	330,000,000	335,893,800
	第166回利付国債(20年)	440,000,000	462,070,400
	第167回利付国債(20年)	280,000,000	283,950,800
	第168回利付国債(20年)	260,000,000	258,689,600
	第169回利付国債(20年)	280,000,000	273,114,800
	第170回利付国債(20年)	370,000,000	360,169,100
	第171回利付国債(20年)	270,000,000	262,280,700
	第172回利付国債(20年)	280,000,000	276,808,000
	第173回利付国債(20年)	360,000,000	355,215,600
	第174回利付国債(20年)	200,000,000	197,134,000
	第175回利付国債(20年)	140,000,000	140,634,200
	国債証券合計	65,085,000,000	69,691,417,230
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	115,548,000
	第705回東京都公募公債	100,000,000	101,135,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,932,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,078,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	99,999,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	99,858,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,971,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,605,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,025,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,892,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,269,300
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	98,934,000
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,177,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,630,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,551,000
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,929,000
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,108,000
	平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	101,188,000
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	99,944,000

	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	100,831,000	
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,361,000	
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,612,000	
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	117,319,000	
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	111,946,000	
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,927,000	
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,430,000	
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,227,000	
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	100,930,000	
	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,303,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,009,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,148,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,127,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,726,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,174,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	111,668,000	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	117,570,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,918,000	
	平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	99,993,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,155,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	120,898,800	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,008,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,570,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	100,863,000	
	地方債証券合計	4,330,000,000	4,449,487,100	
特殊債券	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,749,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,935,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	112,011,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,392,000	
	第27回道路債券	100,000,000	107,363,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	174,804,000	
	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	116,408,820	
	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	129,407,920	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,721,000	
	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	102,025,000	
	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	105,459,640	
	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	134,975,050	

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	100,415,000	
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	100,676,000	
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	100,910,000	
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	100,358,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	124,742,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	109,215,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,325,370	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,713,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,077,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,733,700	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,200,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,042,990	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,688,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,346,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	113,977,000	
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,016,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	113,053,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	84,283,000	83,926,482	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	89,955,000	89,856,949	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,510,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,735,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,651,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,822,000	85,646,469	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,880,000	85,469,067	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,213,000	86,670,791	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,545,000	86,125,850	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,752,000	89,118,545	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,883,000	90,815,985	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,661,000	93,633,928	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,567,000	96,215,496	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,991,000	98,966,252	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	58,843,000	58,751,793	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	60,895,000	60,841,412	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	65,036,000	65,021,041	
第340回信金中金債	100,000,000	100,147,000	
第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,855,000	
第372回信金中金債	100,000,000	100,022,000	
第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,194,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,093,000	
第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,865,000	

	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,038,000	
	特殊債券合計	5,381,326,000	5,601,909,550	
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,239,000	
	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	99,952,000	
	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	98,392,000	
	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	99,653,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,910,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,207,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,774,000	
	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	99,895,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,508,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,142,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,254,000	
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,769,000	
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,866,000	
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	99,597,000	
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	98,745,000	
	第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	99,471,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,882,000	
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,887,000	
	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	100,348,000	
	第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,223,000	
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,882,000	
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,542,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,073,000	
	第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,427,000	
	第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,690,000	
	第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,220,000	
	第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,598,000	
	第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,931,000	
	第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,853,000	
	第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,582,000	
	第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,370,000	
	第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,997,000	

	第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,632,000	
	第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,438,000	
	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	101,036,000	
	社債券合計	3,500,000,000	3,512,985,000	
	合計		83,255,798,880	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

(単位:円)

2021年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	218,485,545
コール・ローン	1,422,950,359
国債証券	207,690,139,318
派生商品評価勘定	78,252
未収利息	1,209,536,589
前払費用	113,376,591
流動資産合計	210,654,566,654
資産合計	
210,654,566,654	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,142,758,967
未払金	151,215,055
未払解約金	235,247,000
未払利息	3,859
流動負債合計	2,529,224,881
負債合計	
2,529,224,881	
純資産の部	
元本等	
元本	196,943,946,160
剰余金	
剰余金又は欠損金()	11,181,395,613
元本等合計	208,125,341,773
純資産合計	
208,125,341,773	
負債純資産合計	
210,654,566,654	

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 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	105,384,277,083円
期中追加設定元本額	152,548,120,578円
期中一部解約元本額	60,988,451,501円
期末元本額	196,943,946,160円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	21,714,522,306円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	10,213,343,760円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,380,953,309円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,607,931,955円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	335,409,131円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	78,206,907円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	53,497,946円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	15,720,697円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,274,883円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	624,155円
リスクコントロール・オープン	215,347,075円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,476,452,787円
FWりそな円建債券アクティブファンド	292,880,523円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	105,194,930,727円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	824,327,115円
Smart-i 8資産バランス 安定型	586,989,322円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	351,725,836円
Smart-i 8資産バランス 成長型	129,229,375円

りそな・リスクコントロールファンド2019-06	10,109,068,239円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	11,146,162,782円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	7,054,065,708円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	4,327,745,198円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	9,035,748,256円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,516,396,688円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,276,489,891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)	12,298,863円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,921,237,734円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	70,364,992円
2. 計算日における受益権の総数	196,943,946,160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	1.0568円
(10,000口当たり純資産額)	(10,568円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15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）

2021年 2月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		3,545,775,595
合計		3,545,775,595

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2021年 2月15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	208,340,317,135	-	210,482,997,850	2,142,680,715
	米ドル	89,738,041,042	-	90,386,210,200	648,169,158
	カナダドル	4,096,603,605	-	4,169,655,720	73,052,115
	メキシコペソ	1,679,912,890	-	1,724,698,500	44,785,610
	ユーロ	86,659,339,640	-	87,484,738,800	825,399,160
	英ポンド	14,144,277,882	-	14,463,273,570	318,995,688
	スウェーデンク ローナ	705,446,683	-	716,758,560	11,311,877
	ノルウェークロー ネ	452,270,082	-	467,405,290	15,135,208
	デンマーククロー ネ	1,079,034,645	-	1,088,286,030	9,251,385
	ポーランドズロチ	1,335,635,296	-	1,363,522,900	27,887,604
	オーストラリアド ル	5,676,498,200	-	5,814,571,200	138,073,000
	シンガポールドル	894,741,227	-	906,221,480	11,480,253
	マレーシアリン ギット	933,164,000	-	940,633,400	7,469,400
	イスラエルシュケ ル	945,351,943	-	957,022,200	11,670,257
	合計	208,340,317,135	-	210,482,997,850	2,142,680,715

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,382,171.97	
		US TREASURY N/B	2,610,000.00	2,655,009.97	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,037,203.30	
		US TREASURY N/B	3,560,000.00	3,628,361.25	
		US TREASURY N/B	2,180,000.00	2,217,781.79	
		US TREASURY N/B	3,370,000.00	3,432,750.41	
		US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,649,713.12	
		US TREASURY N/B	4,520,000.00	4,631,498.90	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,342,810.36	
		US TREASURY N/B	1,770,000.00	1,805,400.00	
		US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,263,778.92	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,075,410.10	
		US TREASURY N/B	2,190,000.00	2,233,800.00	
		US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,502,780.10	
		US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,533,023.80	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,807,148.30	
		US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,058,909.93	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,859,663.80	
		US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,501,933.20	
		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,168,296.72	
		US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,408,103.12	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,943,195.17	
		US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,702,878.32	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,251,562.50	
		US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,487,117.00	
		US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,026,342.75	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,002,812.20			
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,812,949.15			
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,552,734.25			

US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,403,710.01	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,750,078.12	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,361,574.83	
US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,495,613.80	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,570,879.61	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,790,025.00	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,802,038.70	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,532,264.01	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,575,537.00	
US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,932,782.96	
US TREASURY N/B	5,080,000.00	5,214,837.93	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,321,319.53	
US TREASURY N/B	9,400,000.00	9,403,671.64	
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,648,803.60	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,607,367.13	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,391,844.95	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,435,777.94	
US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,999,656.74	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,804,619.52	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,563,085.75	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,364,687.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,576,494.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,527,890.45	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,202,695.15	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,468,831.04	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,509,843.75	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,704,527.22	
US TREASURY N/B	1,440,000.00	1,523,137.39	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,570,551.34	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,899,618.97	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,130,329.63	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,907,718.66	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,459,703.12	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,252,763.06	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,351,292.13	

US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,099,038.96	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,157,257.76	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,543,296.03	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,706,445.05	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,198,359.05	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,392,318.57	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,270,613.22	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,497,187.50	
US TREASURY N/B	1,960,000.00	2,022,934.22	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,046,519.43	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,951,406.06	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,932,187.50	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,870,021.46	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,011,328.00	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,552,721.75	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,419,804.11	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,392,405.98	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,034,337.34	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,889,579.96	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,460,812.04	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,618,063.19	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,251,992.40	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,532,470.12	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,905,046.74	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,581,746.56	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,670,268.12	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,452,539.04	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,131,386.94	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,273,779.43	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,322,573.73	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,521,265.85	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,669,232.40	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,575,824.08	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,206,952.80	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,564,073.20	

US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,790,201.48	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,566,460.73	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,688,327.93	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,882,043.61	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,595,260.75	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,343,124.80	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,859,049.01	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,389,679.59	
US TREASURY N/B	6,270,000.00	6,553,619.05	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,579,671.68	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,010,632.48	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,845,053.80	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,696,064.70	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,533,222.55	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,523,351.39	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,766,001.43	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,025,078.00	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,807,196.06	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,652,542.62	
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,243,472.36	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,733,016.22	
US TREASURY N/B	3,920,000.00	3,899,327.88	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,337,300.00	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,622,026.99	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,496,269.47	
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,687,918.63	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,679,281.25	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,088,376.10	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,962,695.00	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,716,426.53	
US TREASURY N/B	5,670,000.00	5,623,931.25	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,462,109.32	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,954,882.50	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	6,043,014.42	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,917,296.04	

US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,777,343.46	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,876,707.01	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,574,187.36	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,116,430.22	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,217,006.54	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,869,402.28	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,905,084.95	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,737,988.25	
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,726,568.74	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,923,435.53	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,889,000.00	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,782,710.84	
US TREASURY N/B	5,130,000.00	5,385,798.21	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	3,003,806.01	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,694,383.55	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,662,635.78	
US TREASURY N/B	4,910,000.00	5,292,634.33	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,694,433.53	
US TREASURY N/B	890,000.00	947,102.48	
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,381,283.11	
US TREASURY N/B	4,530,000.00	4,954,510.37	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,026,640.60	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,788,843.68	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,128,157.96	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	5,094,271.64	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,523,874.72	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,448,935.35	
US TREASURY N/B	4,110,000.00	4,012,708.49	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	6,078,984.37	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,717,593.60	
US TREASURY N/B	4,370,000.00	4,255,031.41	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,941,288.80	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,742,712.50	
US TREASURY N/B	9,100,000.00	8,987,671.41	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,615,984.37	

US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,951,163.75	
US TREASURY N/B	220,000.00	293,858.97	
US TREASURY N/B	6,040,000.00	6,905,418.44	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,542,238.53	
US TREASURY N/B	530,000.00	705,831.63	
US TREASURY N/B	5,640,000.00	6,360,201.49	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,556,109.53	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,243,945.00	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,858,730.30	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,522,714.45	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,137,977.33	
US TREASURY N/B	7,320,000.00	6,997,462.50	
US TREASURY N/B	10,150,000.00	9,664,703.12	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	10,984,835.08	
US TREASURY N/B	610,000.00	855,477.29	
US TREASURY N/B	540,000.00	760,155.46	
US TREASURY N/B	130,000.00	194,746.08	
US TREASURY N/B	690,000.00	977,482.01	
US TREASURY N/B	520,000.00	748,007.78	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,237,612.41	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,818,395.99	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,946,350.00	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,294,500.00	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,153,150.75	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,366,793.88	
US TREASURY N/B	4,970,000.00	4,419,805.09	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,911,210.86	
US TREASURY N/B	6,040,000.00	5,352,950.00	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,733,686.61	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,445,624.64	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,720,601.54	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,636,646.00	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,447,368.69	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,279,768.67	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,652,021.01	

US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,874,167.93
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,907,525.00
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,161,668.75
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,761,500.00
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,795,749.76
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,226,868.92
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,056,208.39
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,174,850.74
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,475,151.42
US TREASURY N/B	2,310,000.00	2,852,850.00
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,390,077.88
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,759,853.86
US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,060,453.04
US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,076,333.10
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,275,298.81
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,468,969.44
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,679,712.74
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,446,269.45
US TREASURY N/B	3,620,000.00	4,307,092.65
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,580,598.36
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,510,463.90
US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,998,495.39
US TREASURY N/B	3,050,000.00	3,556,466.52
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,944,638.52
US TREASURY N/B	3,940,000.00	4,919,305.12
US TREASURY N/B	4,190,000.00	5,122,275.00
US TREASURY N/B	4,300,000.00	5,619,394.37
US TREASURY N/B	4,480,000.00	5,485,374.72
US TREASURY N/B	4,470,000.00	5,352,825.00
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,300,814.46
US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,509,072.11
US TREASURY N/B	3,860,000.00	3,865,578.85
US TREASURY N/B	6,400,000.00	5,318,000.00
US TREASURY N/B	7,600,000.00	6,524,124.99
US TREASURY N/B	5,820,000.00	5,323,481.25

		802,810,000.00	849,464,633.56
米ドル 小計			(89,295,722,279)
カナダドル	GOV OF CANADA	470,000.00	476,420.20
	GOV OF CANADA	1,450,000.00	1,456,249.50
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,118,546.00
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,116,828.00
	GOV OF CANADA	1,500,000.00	1,502,745.00
	GOV OF CANADA	2,110,000.00	2,138,147.40
	GOV OF CANADA	2,600,000.00	2,604,654.00
	GOV OF CANADA	2,560,000.00	2,564,326.40
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,868,101.00
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,204,947.90
	GOV OF CANADA	2,280,000.00	2,383,033.20
	GOV OF CANADA	840,000.00	890,643.60
	GOV OF CANADA	470,000.00	469,755.60
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,264,995.40
	GOV OF CANADA	840,000.00	874,255.20
	GOV OF CANADA	1,090,000.00	1,126,220.70
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,183,666.00
	GOV OF CANADA	3,120,000.00	3,121,560.00
	GOV OF CANADA	950,000.00	935,664.50
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,205,545.00
	GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,360,004.80
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,089,830.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	487,231.50
	GOV OF CANADA	1,410,000.00	1,569,330.00
	GOV OF CANADA	3,600,000.00	3,696,804.00
	GOV OF CANADA	1,800,000.00	1,715,598.00
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,446,926.00
	GOV OF CANADA	760,000.00	1,166,797.60
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,371,087.50
	GOV OF CANADA	1,040,000.00	1,450,488.00
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,357,808.40
	GOV OF CANADA	2,680,000.00	2,927,498.00
GOV OF CANADA	420,000.00	568,054.20	

	カナダドル 小計	46,240,000.00	49,713,762.60 (4,118,288,093)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	26,930,000.00	27,756,672.90
	UNITED MEXICAN STATE	21,050,000.00	22,140,811.00
	UNITED MEXICAN STATE	25,280,000.00	27,808,000.00
	UNITED MEXICAN STATE	21,980,000.00	24,609,687.20
	UNITED MEXICAN STATE	24,140,000.00	28,872,888.40
	UNITED MEXICAN STATE	25,600,000.00	26,855,168.00
	UNITED MEXICAN STATE	28,010,000.00	31,951,287.10
	UNITED MEXICAN STATE	27,620,000.00	33,669,056.20
	UNITED MEXICAN STATE	15,846,000.00	18,550,674.51
	UNITED MEXICAN STATE	7,560,000.00	8,862,739.20
	UNITED MEXICAN STATE	6,300,000.00	8,746,416.00
	UNITED MEXICAN STATE	19,090,000.00	23,389,068.00
	UNITED MEXICAN STATE	18,100,000.00	20,535,898.00
	UNITED MEXICAN STATE	16,400,000.00	19,033,348.00
	メキシコペソ 小計	283,906,000.00	322,781,714.51 (1,701,059,635)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	735,651.00
	GOV OF AUSTRIA	790,000.00	798,595.99
	GOV OF AUSTRIA	870,000.00	933,085.44
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	598,656.48
	GOV OF AUSTRIA	970,000.00	985,739.69
	GOV OF AUSTRIA	1,050,000.00	1,118,450.55
	GOV OF AUSTRIA	930,000.00	950,841.30
	GOV OF AUSTRIA	900,000.00	977,673.60
	GOV OF AUSTRIA	1,020,000.00	1,108,281.00
	GOV OF AUSTRIA	840,000.00	1,077,728.40
	GOV OF AUSTRIA	1,290,000.00	1,387,554.70
	GOV OF AUSTRIA	940,000.00	1,001,492.45
	GOV OF AUSTRIA	880,000.00	1,269,696.56
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	989,056.25
	GOV OF AUSTRIA	1,040,000.00	1,115,151.73
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	934,890.32
	GOV OF AUSTRIA	830,000.00	1,106,990.92

GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	2,236,179.94
GOV OF AUSTRIA	290,000.00	280,882.40
GOV OF AUSTRIA	650,000.00	1,091,898.26
GOV OF AUSTRIA	690,000.00	902,594.52
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	390,545.66
GOV OF AUSTRIA	350,000.00	794,041.50
GOV OF AUSTRIA	270,000.00	297,040.50
GOV OF AUSTRIA	560,000.00	1,081,998.40
GOV OF AUSTRIA	220,000.00	330,002.86
GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,199,688.12
GOV OF BELGIUM	1,680,000.00	1,815,477.54
GOV OF BELGIUM	1,220,000.00	1,304,992.52
GOV OF BELGIUM	880,000.00	900,885.82
GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,576,842.82
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,282,450.64
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,880,325.87
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,174,937.82
GOV OF BELGIUM	1,610,000.00	1,745,683.05
GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,363,690.44
GOV OF BELGIUM	770,000.00	793,661.33
GOV OF BELGIUM	1,640,000.00	2,346,069.20
GOV OF BELGIUM	1,580,000.00	1,722,593.42
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,699,607.14
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,270,625.67
GOV OF BELGIUM	1,470,000.00	1,651,461.34
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,655,674.87
GOV OF BELGIUM	970,000.00	1,126,393.10
GOV OF BELGIUM	700,000.00	980,046.90
GOV OF BELGIUM	1,750,000.00	2,978,816.75
GOV OF BELGIUM	600,000.00	722,478.00
GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,002,595.93
GOV OF BELGIUM	480,000.00	487,011.07
GOV OF BELGIUM	1,520,000.00	2,676,507.20
GOV OF BELGIUM	990,000.00	1,738,063.80
GOV OF BELGIUM	1,020,000.00	1,287,304.96

GOV OF BELGIUM	730,000.00	950,425.83
GOV OF BELGIUM	550,000.00	831,895.90
GOV OF BELGIUM	650,000.00	1,001,007.15
GOV OF FINLAND	430,000.00	433,433.98
GOV OF FINLAND	530,000.00	549,661.41
GOV OF FINLAND	340,000.00	356,313.20
GOV OF FINLAND	670,000.00	682,146.69
GOV OF FINLAND	510,000.00	553,928.34
GOV OF FINLAND	280,000.00	286,788.32
GOV OF FINLAND	520,000.00	627,798.08
GOV OF FINLAND	620,000.00	663,157.58
GOV OF FINLAND	610,000.00	645,184.80
GOV OF FINLAND	550,000.00	587,145.46
GOV OF FINLAND	470,000.00	583,477.74
GOV OF FINLAND	510,000.00	546,616.47
GOV OF FINLAND	600,000.00	644,972.21
GOV OF FINLAND	360,000.00	369,709.20
GOV OF FINLAND	490,000.00	541,305.45
GOV OF FINLAND	390,000.00	451,767.42
GOV OF FINLAND	420,000.00	426,626.54
GOV OF FINLAND	320,000.00	327,031.04
GOV OF FINLAND	380,000.00	580,271.40
GOV OF FINLAND	350,000.00	454,888.00
GOV OF FRANCE	2,430,000.00	2,446,265.91
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	4,362,925.16
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	3,509,667.00
GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,695,755.36
GOV OF FRANCE	2,330,000.00	2,362,305.45
GOV OF FRANCE	3,740,000.00	3,793,983.16
GOV OF FRANCE	5,160,000.00	5,448,392.40
GOV OF FRANCE	3,830,000.00	4,344,515.68
GOV OF FRANCE	4,010,000.00	4,091,511.27
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,320,858.79
GOV OF FRANCE	3,820,000.00	4,168,036.38
GOV OF FRANCE	4,550,000.00	4,663,167.60

GOV OF FRANCE	4,220,000.00	4,421,294.00	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	2,986,007.94	
GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,304,216.44	
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	3,575,816.92	
GOV OF FRANCE	3,770,000.00	4,576,686.49	
GOV OF FRANCE	4,200,000.00	4,434,602.32	
GOV OF FRANCE	3,360,000.00	3,508,618.84	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,315,183.60	
GOV OF FRANCE	5,050,000.00	6,152,606.90	
GOV OF FRANCE	4,380,000.00	4,752,878.16	
GOV OF FRANCE	3,630,000.00	3,950,129.70	
GOV OF FRANCE	3,440,000.00	5,124,134.56	
GOV OF FRANCE	3,660,000.00	3,914,473.20	
GOV OF FRANCE	4,080,000.00	4,182,248.88	
GOV OF FRANCE	4,440,000.00	5,592,646.20	
GOV OF FRANCE	4,450,000.00	4,538,132.25	
GOV OF FRANCE	4,720,000.00	5,543,960.96	
GOV OF FRANCE	3,100,000.00	5,253,690.90	
GOV OF FRANCE	3,150,000.00	3,667,343.40	
GOV OF FRANCE	2,540,000.00	4,252,147.96	
GOV OF FRANCE	3,700,000.00	4,337,095.60	
GOV OF FRANCE	2,360,000.00	3,937,324.88	
GOV OF FRANCE	2,480,000.00	3,163,959.20	
GOV OF FRANCE	1,330,000.00	1,379,546.49	
GOV OF FRANCE	3,370,000.00	6,176,266.40	
GOV OF FRANCE	2,410,000.00	3,999,129.90	
GOV OF FRANCE	2,700,000.00	3,736,724.40	
GOV OF FRANCE	2,680,000.00	3,372,950.16	
GOV OF FRANCE	2,790,000.00	2,912,093.19	
GOV OF FRANCE	1,720,000.00	3,524,560.36	
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	3,122,952.00	
GOV OF FRANCE	1,180,000.00	1,651,185.80	
GOV OF FRANCE	700,000.00	618,857.40	
GOV OF GERMANY	1,440,000.00	1,450,392.48	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	2,086,133.58	

GOV OF GERMANY	1,440,000.00	1,453,027.10	
GOV OF GERMANY	2,290,000.00	2,367,711.15	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,089,768.78	
GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,617,608.00	
GOV OF GERMANY	1,850,000.00	1,871,312.00	
GOV OF GERMANY	600,000.00	607,798.80	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	2,006,455.09	
GOV OF GERMANY	1,860,000.00	1,889,683.74	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,427,107.76	
GOV OF GERMANY	1,840,000.00	1,967,368.48	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,580,868.18	
GOV OF GERMANY	2,620,000.00	2,818,863.24	
GOV OF GERMANY	2,510,000.00	2,569,070.34	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,168,990.35	
GOV OF GERMANY	2,210,000.00	2,346,845.41	
GOV OF GERMANY	2,390,000.00	2,454,840.70	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,782,815.88	
GOV OF GERMANY	1,760,000.00	1,813,458.06	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,675,101.60	
GOV OF GERMANY	2,420,000.00	2,500,663.44	
GOV OF GERMANY	350,000.00	362,263.79	
GOV OF GERMANY	2,600,000.00	2,759,798.60	
GOV OF GERMANY	540,000.00	559,485.90	
GOV OF GERMANY	2,990,000.00	3,105,554.53	
GOV OF GERMANY	3,060,000.00	3,232,492.20	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,483,010.27	
GOV OF GERMANY	2,780,000.00	2,991,627.50	
GOV OF GERMANY	2,430,000.00	2,533,697.82	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,876,238.00	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,938,293.60	
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,605,249.96	
GOV OF GERMANY	2,570,000.00	2,735,582.53	
GOV OF GERMANY	2,350,000.00	2,506,054.10	
GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,562,205.10	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,200,155.45	

GOV OF GERMANY	3,610,000.00	3,774,831.50	
GOV OF GERMANY	2,640,000.00	2,758,711.56	
GOV OF GERMANY	700,000.00	734,357.40	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,329,139.60	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,803,876.16	
GOV OF GERMANY	2,210,000.00	2,282,395.18	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	4,268,039.16	
GOV OF GERMANY	1,990,000.00	3,639,130.91	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	3,778,051.20	
GOV OF GERMANY	1,790,000.00	3,092,876.56	
GOV OF GERMANY	2,660,000.00	4,266,129.28	
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,679,024.25	
GOV OF GERMANY	2,440,000.00	3,246,133.05	
GOV OF GERMANY	1,600,000.00	1,565,212.80	
GOV OF IRELAND	560,000.00	568,547.84	
GOV OF IRELAND	510,000.00	515,461.08	
GOV OF IRELAND	630,000.00	690,328.27	
GOV OF IRELAND	790,000.00	888,938.81	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,308,985.65	
GOV OF IRELAND	1,040,000.00	1,123,585.61	
GOV OF IRELAND	710,000.00	738,826.00	
GOV OF IRELAND	770,000.00	841,947.26	
GOV OF IRELAND	910,000.00	1,015,733.81	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,034,565.95	
GOV OF IRELAND	740,000.00	767,191.30	
GOV OF IRELAND	640,000.00	739,556.48	
GOV OF IRELAND	490,000.00	495,220.46	
GOV OF IRELAND	420,000.00	489,050.94	
GOV OF IRELAND	390,000.00	407,573.08	
GOV OF IRELAND	490,000.00	611,174.55	
GOV OF IRELAND	840,000.00	1,150,751.28	
GOV OF IRELAND	540,000.00	680,728.32	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,785,856.80	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	1,955,476.21	
GOV OF ITALY	1,630,000.00	1,663,810.43	

GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,408,290.00	
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,936,715.41	
GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,822,307.34	
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,647,744.00	
GOV OF ITALY	1,460,000.00	1,607,341.74	
GOV OF ITALY	1,430,000.00	1,443,091.65	
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,408,020.24	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,737,974.03	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,151,072.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,575,960.54	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,255,409.60	
GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,667,635.29	
GOV OF ITALY	1,700,000.00	1,826,365.25	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,654,181.62	
GOV OF ITALY	2,170,000.00	2,190,387.15	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,270,654.10	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,497,951.00	
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,158,755.01	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,952,991.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,638,107.24	
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,549,503.11	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,810,150.68	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,422,482.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,646,509.48	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,854,793.55	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,882,182.91	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,619,951.04	
GOV OF ITALY	2,360,000.00	2,600,686.96	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,481,450.40	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,275,122.60	
GOV OF ITALY	2,340,000.00	2,545,803.00	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,695,757.60	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,498,773.55	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,792,580.68	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,938,969.00	

GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,510,850.66	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,109,104.00	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	2,677,608.80	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,458,765.32	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,500,894.99	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	3,052,831.95	
GOV OF ITALY	2,010,000.00	2,460,742.50	
GOV OF ITALY	2,750,000.00	3,914,119.00	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,183,216.00	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,534,317.70	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,195,415.42	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	2,129,508.66	
GOV OF ITALY	1,430,000.00	1,489,133.36	
GOV OF ITALY	2,460,000.00	3,807,762.66	
GOV OF ITALY	2,480,000.00	2,769,217.60	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	2,764,338.00	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	2,046,071.17	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	3,366,379.98	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,100,876.66	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,311,797.30	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,691,788.50	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,754,183.80	
GOV OF ITALY	480,000.00	482,252.64	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	2,036,613.20	
GOV OF ITALY	2,160,000.00	3,602,759.04	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	2,070,908.84	
GOV OF ITALY	1,920,000.00	3,234,197.76	
GOV OF ITALY	1,060,000.00	1,183,706.24	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,762,753.56	
GOV OF ITALY	1,620,000.00	2,305,000.80	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,878,068.16	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	2,276,287.86	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,853,151.30	
GOV OF ITALY	1,420,000.00	1,779,024.28	
GOV OF ITALY	1,280,000.00	1,367,513.60	

GOV OF ITALY	860,000.00	1,155,010.10	
GOV OF NETHERLANDS	1,430,000.00	1,489,636.72	
GOV OF NETHERLANDS	820,000.00	890,624.96	
GOV OF NETHERLANDS	1,930,000.00	2,045,854.41	
GOV OF NETHERLANDS	1,410,000.00	1,439,414.01	
GOV OF NETHERLANDS	1,480,000.00	1,618,155.92	
GOV OF NETHERLANDS	1,420,000.00	1,477,981.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,510,000.00	1,602,566.02	
GOV OF NETHERLANDS	1,170,000.00	1,209,173.94	
GOV OF NETHERLANDS	1,560,000.00	1,693,017.45	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,597,288.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,488,786.56	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,185,940.22	
GOV OF NETHERLANDS	1,690,000.00	1,749,783.75	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,722,795.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	2,484,691.22	
GOV OF NETHERLANDS	810,000.00	892,153.76	
GOV OF NETHERLANDS	1,510,000.00	2,702,856.21	
GOV OF NETHERLANDS	1,530,000.00	2,593,080.72	
GOV OF NETHERLANDS	710,000.00	678,502.88	
GOV OF SPAIN	1,550,000.00	1,645,367.62	
GOV OF SPAIN	2,570,000.00	2,600,197.50	
GOV OF SPAIN	1,750,000.00	1,780,227.75	
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,256,287.88	
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,013,239.22	
GOV OF SPAIN	1,980,000.00	2,022,314.58	
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,257,921.66	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,783,989.90	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,846,265.00	
GOV OF SPAIN	1,590,000.00	1,628,460.51	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,473,035.30	
GOV OF SPAIN	2,190,000.00	2,224,782.88	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,115,606.67	
GOV OF SPAIN	2,050,000.00	2,513,993.30	
GOV OF SPAIN	2,230,000.00	2,496,262.22	

	GOV OF SPAIN	400,000.00	406,350.40	
	GOV OF SPAIN	2,380,000.00	2,662,645.23	
	GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,666,146.28	
	GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,409,288.96	
	GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,158,969.02	
	GOV OF SPAIN	1,710,000.00	1,817,069.08	
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,292,108.93	
	GOV OF SPAIN	2,150,000.00	2,383,301.43	
	GOV OF SPAIN	2,080,000.00	2,310,160.32	
	GOV OF SPAIN	1,610,000.00	2,256,543.63	
	GOV OF SPAIN	2,790,000.00	4,131,352.76	
	GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,159,671.15	
	GOV OF SPAIN	1,880,000.00	1,971,046.14	
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	2,145,699.90	
	GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,380,489.85	
	GOV OF SPAIN	2,470,000.00	2,730,032.95	
	GOV OF SPAIN	1,280,000.00	1,265,210.88	
	GOV OF SPAIN	1,920,000.00	3,108,737.28	
	GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,397,009.82	
	GOV OF SPAIN	1,940,000.00	2,305,885.94	
	GOV OF SPAIN	1,890,000.00	2,949,197.58	
	GOV OF SPAIN	1,770,000.00	3,120,021.30	
	GOV OF SPAIN	1,250,000.00	1,345,924.00	
	GOV OF SPAIN	2,020,000.00	3,524,059.68	
	GOV OF SPAIN	1,260,000.00	2,414,664.00	
	GOV OF SPAIN	1,630,000.00	2,357,102.25	
	GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,835,845.31	
	GOV OF SPAIN	1,630,000.00	1,606,457.91	
	GOV OF SPAIN	1,390,000.00	2,362,152.10	
	ユーロ 小計	567,890,000.00	677,825,061.20 (86,382,025,799)	
英債券	UK TREASURY	1,470,000.00	1,532,895.12	
	UK TREASURY	2,270,000.00	2,287,878.96	
	UK TREASURY	2,260,000.00	2,323,299.88	
	UK TREASURY	2,750,000.00	2,756,688.00	

UK TREASURY	2,030,000.00	2,068,034.08
UK TREASURY	1,520,000.00	1,607,769.66
UK TREASURY	1,200,000.00	1,202,568.00
UK TREASURY	2,210,000.00	2,279,758.20
UK TREASURY	1,190,000.00	1,305,209.13
UK TREASURY	880,000.00	1,056,198.17
UK TREASURY	2,580,000.00	2,640,986.04
UK TREASURY	1,250,000.00	1,358,917.50
UK TREASURY	1,910,000.00	1,908,143.48
UK TREASURY	1,470,000.00	1,577,381.73
UK TREASURY	1,610,000.00	1,713,023.90
UK TREASURY	1,310,000.00	1,663,337.91
UK TREASURY	1,640,000.00	1,618,769.21
UK TREASURY	1,520,000.00	1,668,618.30
UK TREASURY	950,000.00	1,361,065.00
UK TREASURY	1,450,000.00	1,502,278.88
UK TREASURY	2,360,000.00	2,324,361.16
UK TREASURY	1,430,000.00	2,008,884.02
UK TREASURY	770,000.00	742,658.84
UK TREASURY	1,750,000.00	2,440,924.50
UK TREASURY	1,250,000.00	1,853,959.50
UK TREASURY	1,660,000.00	1,606,038.04
UK TREASURY	1,690,000.00	2,505,059.96
UK TREASURY	2,270,000.00	2,556,157.10
UK TREASURY	1,310,000.00	2,136,395.16
UK TREASURY	1,280,000.00	1,997,462.27
UK TREASURY	1,470,000.00	2,330,114.64
UK TREASURY	1,790,000.00	1,859,890.55
UK TREASURY	1,630,000.00	2,732,799.32
UK TREASURY	2,010,000.00	2,901,724.44
UK TREASURY	2,000,000.00	3,021,420.00
UK TREASURY	1,760,000.00	3,011,875.32
UK TREASURY	2,080,000.00	2,272,791.04
UK TREASURY	840,000.00	972,753.60
UK TREASURY	1,260,000.00	2,244,790.80

	UK TREASURY	1,900,000.00	1,669,910.75
	UK TREASURY	1,160,000.00	1,983,061.76
	UK TREASURY	1,210,000.00	1,392,501.88
	UK TREASURY	1,570,000.00	3,018,904.64
	UK TREASURY	1,880,000.00	2,274,506.72
	UK TREASURY	1,140,000.00	2,219,151.81
	UK TREASURY	900,000.00	742,249.08
	UK TREASURY	1,340,000.00	2,044,585.40
	UK TREASURY	1,510,000.00	2,923,658.98
	UK TREASURY	620,000.00	789,391.93
	英ポンド 小計	77,310,000.00	96,010,804.36 (14,003,175,815)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,855,000.00	11,395,948.07
	GOV OF SWEDEN	8,400,000.00	8,823,292.80
	GOV OF SWEDEN	6,380,000.00	7,133,516.28
	GOV OF SWEDEN	7,220,000.00	7,689,423.46
	GOV OF SWEDEN	5,160,000.00	5,444,058.00
	GOV OF SWEDEN	5,130,000.00	5,425,590.60
	GOV OF SWEDEN	3,200,000.00	3,173,876.47
	GOV OF SWEDEN	4,400,000.00	6,711,199.41
	スウェーデンクローナ 小計	50,745,000.00	55,796,905.09 (706,388,818)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	7,480,000.00	7,745,824.24
	GOV OF NORWAY	5,470,000.00	5,875,272.30
	GOV OF NORWAY	4,040,000.00	4,208,419.52
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,496,177.36
	GOV OF NORWAY	3,560,000.00	3,733,430.38
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,556,107.00
	GOV OF NORWAY	3,790,000.00	3,985,355.55
	GOV OF NORWAY	4,170,000.00	4,242,662.25
	ノルウェークローネ 小計	35,220,000.00	36,843,248.60 (458,330,012)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	6,350,000.00	6,443,029.40
	GOV OF DENMARK	5,820,000.00	6,158,799.66
	GOV OF DENMARK	5,900,000.00	6,551,570.63
	GOV OF DENMARK	7,000,000.00	7,449,330.00

	GOV OF DENMARK	11,070,000.00	11,890,508.40	
	GOV OF DENMARK	11,740,000.00	21,643,092.67	
	GOV OF DENMARK	2,650,000.00	2,693,036.00	
	デンマーククローネ 小計	50,530,000.00	62,829,366.76 (1,076,267,052)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	3,410,000.00	3,498,924.27	
	GOV OF POLAND	2,730,000.00	2,727,218.66	
	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,610,836.00	
	GOV OF POLAND	3,920,000.00	4,099,462.30	
	GOV OF POLAND	2,120,000.00	2,338,996.00	
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,119,285.14	
	GOV OF POLAND	3,010,000.00	3,222,758.23	
	GOV OF POLAND	1,900,000.00	1,919,035.72	
	GOV OF POLAND	3,860,000.00	4,326,744.63	
	GOV OF POLAND	4,300,000.00	4,720,116.02	
	GOV OF POLAND	2,790,000.00	3,077,363.86	
	GOV OF POLAND	3,120,000.00	3,484,850.28	
	GOV OF POLAND	740,000.00	1,016,020.00	
	GOV OF POLAND	4,790,000.00	5,353,919.03	
	GOV OF POLAND	1,790,000.00	1,766,576.76	
	ポーランドズロチ 小計	43,780,000.00	47,282,106.90 (1,339,502,088)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	2,203,800.37	
	GOV OF AUSTRALIA	2,760,000.00	2,865,487.20	
	GOV OF AUSTRALIA	2,990,000.00	3,341,008.35	
	GOV OF AUSTRALIA	3,170,000.00	3,435,512.86	
	GOV OF AUSTRALIA	2,720,000.00	2,724,958.28	
	GOV OF AUSTRALIA	2,930,000.00	3,292,179.63	
	GOV OF AUSTRALIA	2,960,000.00	2,942,073.92	
	GOV OF AUSTRALIA	3,000,000.00	3,585,466.20	
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,704,944.49	
	GOV OF AUSTRALIA	2,880,000.00	3,601,158.61	
	GOV OF AUSTRALIA	2,610,000.00	2,958,740.10	
	GOV OF AUSTRALIA	2,740,000.00	3,017,047.70	
	GOV OF AUSTRALIA	2,950,000.00	3,361,449.18	

	GOV OF AUSTRALIA	2,940,000.00	3,472,106.77
	GOV OF AUSTRALIA	3,450,000.00	3,945,976.12
	GOV OF AUSTRALIA	3,310,000.00	3,718,734.35
	GOV OF AUSTRALIA	2,890,000.00	2,842,046.80
	GOV OF AUSTRALIA	2,460,000.00	2,526,730.45
	GOV OF AUSTRALIA	2,870,000.00	2,791,692.33
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,056,596.12
	GOV OF AUSTRALIA	1,300,000.00	1,761,148.74
	GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	933,633.05
	GOV OF AUSTRALIA	1,020,000.00	1,313,726.34
	GOV OF AUSTRALIA	910,000.00	1,105,286.63
	GOV OF AUSTRALIA	1,080,000.00	1,218,540.98
	GOV OF AUSTRALIA	1,270,000.00	1,486,782.76
	GOV OF AUSTRALIA	1,420,000.00	1,270,983.63
	オーストラリアドル 小計	64,260,000.00	70,477,811.96 (5,750,989,455)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	508,225.45
	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	688,759.50
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	627,110.68
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	803,463.18
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	304,055.02
	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	719,972.35
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	583,917.71
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	299,652.00
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	528,925.01
	GOV OF SINGAPORE	760,000.00	885,545.98
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	473,085.98
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	727,653.90
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	724,897.80
	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	713,145.29
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	611,239.50
	GOV OF SINGAPORE	390,000.00	452,107.50
	GOV OF SINGAPORE	400,000.00	494,513.15
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	775,973.43
	GOV OF SINGAPORE	350,000.00	386,249.50

	シンガポールドル 小計	10,100,000.00	11,308,492.93 (897,441,998)
マレーシアリングgit	GOV OF MALAYSIA	1,200,000.00	1,226,519.88
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	829,037.67
	GOV OF MALAYSIA	1,250,000.00	1,288,859.50
	GOV OF MALAYSIA	1,610,000.00	1,661,884.82
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	633,961.28
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	867,911.16
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	794,763.61
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	887,652.21
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,348,612.51
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	779,883.09
	GOV OF MALAYSIA	2,300,000.00	2,478,991.75
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	893,323.89
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,286,658.34
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,092,590.73
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,895,822.47
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,463,871.01
	GOV OF MALAYSIA	1,310,000.00	1,413,888.37
	GOV OF MALAYSIA	2,000,000.00	2,167,809.60
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,279,988.29
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,923,540.11
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,473,295.74
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,237,639.59
	GOV OF MALAYSIA	1,540,000.00	1,607,843.77
	GOV OF MALAYSIA	600,000.00	653,385.90
	GOV OF MALAYSIA	1,480,000.00	1,710,786.76
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	1,019,829.64
	GOV OF MALAYSIA	1,270,000.00	1,286,870.68
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	851,944.90
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,045,624.74
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	1,080,433.17
GOV OF MALAYSIA	820,000.00	835,536.78	
	マレーシアリングgit 小計	36,220,000.00	39,018,761.96 (1,014,487,810)

イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,570,000.00	1,656,899.50	
	GOV OF ISRAEL	1,860,000.00	1,886,784.00	
	GOV OF ISRAEL	1,120,000.00	1,146,488.00	
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	1,811,652.50	
	GOV OF ISRAEL	910,000.00	911,228.50	
	GOV OF ISRAEL	1,820,000.00	1,894,620.00	
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,711,991.00	
	GOV OF ISRAEL	920,000.00	932,558.00	
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,975,700.00	
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	2,171,568.00	
	GOV OF ISRAEL	1,800,000.00	1,998,270.00	
	GOV OF ISRAEL	1,540,000.00	1,735,041.00	
	GOV OF ISRAEL	1,310,000.00	1,337,575.50	
	GOV OF ISRAEL	1,330,000.00	1,335,652.50	
	GOV OF ISRAEL	1,860,000.00	3,133,449.00	
	GOV OF ISRAEL	1,900,000.00	2,653,635.00	
	イスラエルシュケル 小計	25,370,000.00	29,293,112.50	(946,460,464)
	合計		207,690,139,318	(207,690,139,318)

(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 239銘柄	100.0%	43.1%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 326銘柄	100.0%	41.6%
英ポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	6.7%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.2%
デンマーククローネ	国債証券 7銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%

オーストラリアドル	国債証券	27銘柄	100.0%	2.8%
シンガポールドル	国債証券	19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券	31銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券	16銘柄	100.0%	0.5%

(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。

R A M国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	855,223,210
株式	48,026,072,740
派生商品評価勘定	61,813,000
未収配当金	61,646,897
差入委託証拠金	37,800,000
流動資産合計	49,042,555,847
資産合計	49,042,555,847
負債の部	
流動負債	
前受金	50,035,000
未払解約金	155,349,000
未払利息	2,319
流動負債合計	205,386,319
負債合計	205,386,319
純資産の部	
元本等	
元本	34,885,495,332
剰余金	
剰余金又は欠損金()	13,951,674,196
元本等合計	48,837,169,528
純資産合計	48,837,169,528
負債純資産合計	49,042,555,847

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 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	17,018,260,162円
期中追加設定元本額	35,781,279,647円
期中一部解約元本額	17,914,044,477円
期末元本額	34,885,495,332円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	2,857,844,287円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,848,871,076円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,549,686,149円
DCりそな グローバルバランス	49,916,017円
つみたてバランスファンド	2,658,694,212円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	897,517,221円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	460,199,871円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	276,323,714円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	45,709,206円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	32,003,158円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,708,970円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	22,282,963円
リスクコントロール・オープン	8,255,982円
FWりそな国内株式アクティブファンド	442,285,584円
FWりそな国内株式インデックスファンド	17,744,983,805円
Smart-i TOPIXインデックス	1,188,027,374円
Smart-i 8資産バランス 安定型	130,695,291円

Smart-i 8資産バランス 安定成長型	342,495,186円
Smart-i 8資産バランス 成長型	380,250,474円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	386,697,348円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	427,486,504円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	270,529,284円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	165,964,257円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	351,114,905円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	58,466,689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)	3,096,581円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	526,643,328円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	732,591,157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	34,885,495,332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	1.3999円
(10,000口当たり純資産額)	(13,999円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 2月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		2,334,317,775
合計		2,334,317,775

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2021年 2月15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	721,187,000	-	783,000,000	61,813,000
合計		721,187,000	-	783,000,000	61,813,000

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	800	3,070.00	2,456,000	
日本水産	22,600	510.00	11,526,000	
マルハニチロ	3,800	2,488.00	9,454,400	
雪国まいたけ	1,500	1,843.00	2,764,500	
カネコ種苗	700	1,596.00	1,117,200	
サカタのタネ	2,900	3,985.00	11,556,500	
ホクト	2,000	2,149.00	4,298,000	
ホクリヨウ	400	692.00	276,800	
住石ホールディングス	4,300	113.00	485,900	
日鉄鉱業	600	5,500.00	3,300,000	
三井松島ホールディングス	1,000	926.00	926,000	
国際石油開発帝石	89,700	769.00	68,979,300	
石油資源開発	3,200	2,369.00	7,580,800	
K&Oエナジーグループ	1,200	1,440.00	1,728,000	
ヒノキヤグループ	600	2,260.00	1,356,000	
ショーボンドホールディングス	3,500	4,820.00	16,870,000	
ミライト・ホールディングス	8,500	1,749.00	14,866,500	
タマホーム	1,500	1,945.00	2,917,500	

サンヨーホームズ	300	833.00	249,900	
日本アクア	1,000	655.00	655,000	
ファーストコーポレーション	700	719.00	503,300	
ベステラ	500	1,686.00	843,000	
T A T E R U	4,600	180.00	828,000	
キャンディル	400	534.00	213,600	
スペースバリューホールディングス	3,000	717.00	2,151,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	797.00	398,500	
第一カッター興業	600	1,333.00	799,800	
安藤・間	15,600	776.00	12,105,600	
東急建設	7,100	557.00	3,954,700	
コムシスホールディングス	8,600	3,415.00	29,369,000	
ピーアールホールディングス	2,900	752.00	2,180,800	
高松コンストラクショングループ	1,500	2,163.00	3,244,500	
東建コーポレーション	800	8,780.00	7,024,000	
ソネック	300	834.00	250,200	
ヤマウラ	1,100	948.00	1,042,800	
大成建設	17,500	3,875.00	67,812,500	
大林組	56,300	943.00	53,090,900	
清水建設	52,700	822.00	43,319,400	
飛島建設	1,600	1,129.00	1,806,400	
長谷工コーポレーション	18,400	1,383.00	25,447,200	
松井建設	2,200	725.00	1,595,000	
銭高組	200	4,575.00	915,000	
鹿島建設	41,300	1,498.00	61,867,400	
不動テトラ	1,400	1,857.00	2,599,800	
大末建設	700	893.00	625,100	
鉄建建設	1,100	1,988.00	2,186,800	
西松建設	4,000	2,670.00	10,680,000	
三井住友建設	13,600	493.00	6,704,800	
大豊建設	1,200	3,790.00	4,548,000	
前田建設工業	14,100	940.00	13,254,000	
佐田建設	1,300	431.00	560,300	
ナカノフドー建設	1,300	381.00	495,300	
奥村組	3,100	2,772.00	8,593,200	
東鉄工業	2,400	2,735.00	6,564,000	

イチケン	400	2,045.00	818,000	
富士ピー・エス	700	613.00	429,100	
浅沼組	700	4,760.00	3,332,000	
戸田建設	23,400	780.00	18,252,000	
熊谷組	2,600	2,874.00	7,472,400	
北野建設	300	2,453.00	735,900	
植木組	200	2,922.00	584,400	
矢作建設工業	2,500	861.00	2,152,500	
ピーエス三菱	1,900	704.00	1,337,600	
日本ハウスホールディングス	3,800	342.00	1,299,600	
大東建託	6,100	11,800.00	71,980,000	
新日本建設	2,400	857.00	2,056,800	
N I P P O	4,700	2,811.00	13,211,700	
東亜道路工業	300	4,030.00	1,209,000	
前田道路	3,500	2,017.00	7,059,500	
日本道路	500	7,660.00	3,830,000	
東亜建設工業	1,500	2,154.00	3,231,000	
日本国土開発	5,500	567.00	3,118,500	
若築建設	1,000	1,291.00	1,291,000	
東洋建設	6,300	568.00	3,578,400	
五洋建設	23,900	836.00	19,980,400	
世紀東急工業	2,700	913.00	2,465,100	
福田組	700	5,210.00	3,647,000	
住友林業	13,200	2,297.00	30,320,400	
日本基礎技術	1,700	519.00	882,300	
巴コーポレーション	2,500	401.00	1,002,500	
大和ハウス工業	52,000	3,337.00	173,524,000	
ライト工業	3,200	1,744.00	5,580,800	
積水ハウス	61,100	2,140.00	130,754,000	
日特建設	1,500	802.00	1,203,000	
北陸電気工事	1,000	1,240.00	1,240,000	
ユアテック	3,200	849.00	2,716,800	
日本リーテック	1,200	2,506.00	3,007,200	
四電工	300	2,841.00	852,300	
中電工	2,600	2,240.00	5,824,000	
関電工	9,200	898.00	8,261,600	

きんでん	12,200	1,845.00	22,509,000
東京エネシス	1,900	973.00	1,848,700
トーエネック	600	3,985.00	2,391,000
住友電設	1,600	2,563.00	4,100,800
日本電設工業	3,100	1,988.00	6,162,800
協和エクシオ	8,500	2,844.00	24,174,000
新日本空調	1,500	2,290.00	3,435,000
九電工	4,000	3,515.00	14,060,000
三機工業	4,000	1,301.00	5,204,000
日揮ホールディングス	18,800	1,366.00	25,680,800
中外炉工業	600	1,740.00	1,044,000
ヤマト	1,800	700.00	1,260,000
太平電業	1,200	2,651.00	3,181,200
高砂熱学工業	5,100	1,667.00	8,501,700
三晃金属工業	200	3,020.00	604,000
朝日工業社	400	2,932.00	1,172,800
明星工業	3,600	830.00	2,988,000
大気社	2,700	2,993.00	8,081,100
ダイダン	1,200	2,841.00	3,409,200
日比谷総合設備	1,800	1,885.00	3,393,000
フィル・カンパニー	300	2,031.00	609,300
OSJBホールディングス	8,200	283.00	2,320,600
東洋エンジニアリング	2,400	483.00	1,159,200
レイズネクスト	3,000	1,183.00	3,549,000
ニッポン	5,300	1,620.00	8,586,000
日清製粉グループ本社	20,400	1,756.00	35,822,400
日東富士製粉	100	6,720.00	672,000
昭和産業	1,500	3,295.00	4,942,500
鳥越製粉	1,600	876.00	1,401,600
中部飼料	2,200	1,493.00	3,284,600
フィード・ワン	2,400	928.00	2,227,200
東洋精糖	300	1,240.00	372,000
日本甜菜製糖	900	1,690.00	1,521,000
三井製糖	1,400	1,943.00	2,720,200
塩水港精糖	2,100	228.00	478,800
日新製糖	900	1,883.00	1,694,700

森永製菓	4,200	4,270.00	17,934,000	
中村屋	400	3,995.00	1,598,000	
江崎グリコ	5,000	4,590.00	22,950,000	
名糖産業	800	1,546.00	1,236,800	
井村屋グループ	1,000	2,532.00	2,532,000	
不二家	1,100	2,402.00	2,642,200	
山崎製パン	13,500	2,102.00	28,377,000	
第一屋製パン	300	983.00	294,900	
モロゾフ	300	5,690.00	1,707,000	
亀田製菓	1,000	4,855.00	4,855,000	
寿スピリッツ	1,700	6,700.00	11,390,000	
カルビー	8,200	3,045.00	24,969,000	
森永乳業	3,300	5,020.00	16,566,000	
六甲バター	1,200	1,843.00	2,211,600	
ヤクルト本社	12,400	5,260.00	65,224,000	
明治ホールディングス	11,900	7,140.00	84,966,000	
雪印メグミルク	4,300	2,264.00	9,735,200	
プリマハム	2,500	3,445.00	8,612,500	
日本ハム	6,900	4,695.00	32,395,500	
林兼産業	600	637.00	382,200	
丸大食品	1,800	1,728.00	3,110,400	
S Foods	1,600	3,535.00	5,656,000	
柿安本店	600	2,779.00	1,667,400	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,600	758.00	8,792,800	
サッポロホールディングス	6,100	2,199.00	13,413,900	
アサヒグループホールディングス	39,400	4,584.00	180,609,600	
キリンホールディングス	76,400	2,211.00	168,920,400	
宝ホールディングス	13,400	1,540.00	20,636,000	
オエノンホールディングス	5,100	405.00	2,065,500	
養命酒製造	600	1,991.00	1,194,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	13,800	1,773.00	24,467,400	
サントリー食品インターナショナル	12,100	3,845.00	46,524,500	
ダイドーグループホールディングス	1,000	5,450.00	5,450,000	
伊藤園	5,500	6,680.00	36,740,000	
キーコーヒー	1,800	2,183.00	3,929,400	

ユニカフェ	500	1,014.00	507,000	
ジャパンフーズ	300	1,252.00	375,600	
日清オイリオグループ	2,300	3,270.00	7,521,000	
不二製油グループ本社	4,400	3,325.00	14,630,000	
かどや製油	200	4,140.00	828,000	
J - オイルミルズ	800	3,855.00	3,084,000	
キッコーマン	13,000	7,360.00	95,680,000	
味の素	42,900	2,265.00	97,168,500	
キュービー	10,000	2,441.00	24,410,000	
ハウス食品グループ本社	6,700	3,855.00	25,828,500	
カゴメ	7,400	3,430.00	25,382,000	
焼津水産化学工業	900	1,001.00	900,900	
アリアケジャパン	1,600	6,960.00	11,136,000	
ピエトロ	200	1,775.00	355,000	
エバラ食品工業	400	2,760.00	1,104,000	
やまみ	200	2,229.00	445,800	
ニチレイ	8,600	2,881.00	24,776,600	
東洋水産	9,300	4,650.00	43,245,000	
イトアンドホールディングス	600	1,967.00	1,180,200	
大冷	200	1,958.00	391,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,000	926.00	926,000	
日清食品ホールディングス	7,100	8,580.00	60,918,000	
永谷園ホールディングス	900	2,394.00	2,154,600	
一正蒲鉾	700	1,205.00	843,500	
フジッコ	2,000	2,030.00	4,060,000	
ロック・フィールド	1,900	1,617.00	3,072,300	
日本たばこ産業	96,600	1,951.00	188,466,600	
ケンコーマヨネーズ	1,100	1,931.00	2,124,100	
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,753.00	2,103,600	
なとり	1,000	2,017.00	2,017,000	
イフジ産業	300	930.00	279,000	
ピククルスコーポレーション	400	3,750.00	1,500,000	
北の達人コーポレーション	6,300	639.00	4,025,700	
ユーグレナ	7,800	950.00	7,410,000	
ミヨシ油脂	600	1,212.00	727,200	
理研ビタミン	1,700	1,412.00	2,400,400	

片倉工業	2,400	1,438.00	3,451,200
ゲンゼ	1,300	3,740.00	4,862,000
東洋紡	6,900	1,376.00	9,494,400
ユニチカ	5,100	466.00	2,376,600
富士紡ホールディングス	800	4,555.00	3,644,000
倉敷紡績	1,600	1,915.00	3,064,000
シキボウ	1,000	1,027.00	1,027,000
日本毛織	5,800	986.00	5,718,800
ダイトウボウ	2,800	109.00	305,200
トーア紡コーポレーション	700	474.00	331,800
ダイドーリミテッド	2,300	188.00	432,400
帝国繊維	2,000	2,352.00	4,704,000
帝人	16,600	1,892.00	31,407,200
東レ	127,300	694.70	88,435,310
サカイオーベックス	500	2,902.00	1,451,000
住江織物	400	2,043.00	817,200
日本フェルト	1,000	451.00	451,000
イチカワ	200	1,320.00	264,000
日東製網	200	1,546.00	309,200
アツギ	1,400	532.00	744,800
ダイニック	700	792.00	554,400
セーレン	4,300	1,947.00	8,372,100
ソトー	700	835.00	584,500
東海染工	200	1,140.00	228,000
小松マテーレ	2,900	1,050.00	3,045,000
ワコールホールディングス	4,400	2,322.00	10,216,800
ホギメディカル	2,400	3,265.00	7,836,000
クラウディアホールディングス	400	283.00	113,200
T S Iホールディングス	5,300	271.00	1,436,300
マツオカコーポレーション	600	1,993.00	1,195,800
ワールド	2,300	1,408.00	3,238,400
三陽商会	900	715.00	643,500
ナイガイ	600	333.00	199,800
オンワードホールディングス	10,500	274.00	2,877,000
ルックホールディングス	600	1,037.00	622,200
キムラタン	9,800	25.00	245,000

ゴールドウイン	2,900	7,580.00	21,982,000	
デサント	3,000	1,720.00	5,160,000	
キング	900	583.00	524,700	
ヤマトインターナショナル	1,500	337.00	505,500	
特種東海製紙	1,100	4,785.00	5,263,500	
王子ホールディングス	79,200	697.00	55,202,400	
日本製紙	7,800	1,423.00	11,099,400	
三菱製紙	2,500	364.00	910,000	
北越コーポレーション	12,600	500.00	6,300,000	
中越パルプ工業	700	1,169.00	818,300	
巴川製紙所	600	804.00	482,400	
大王製紙	8,500	2,105.00	17,892,500	
阿波製紙	500	460.00	230,000	
レンゴー	18,100	881.00	15,946,100	
トーモク	1,100	1,888.00	2,076,800	
ザ・パック	1,300	2,770.00	3,601,000	
クラレ	27,700	1,234.00	34,181,800	
旭化成	116,600	1,183.50	137,996,100	
共和レザー	1,000	668.00	668,000	
昭和電工	13,400	2,695.00	36,113,000	
住友化学	138,400	516.00	71,414,400	
住友精化	900	4,060.00	3,654,000	
日産化学	9,700	6,070.00	58,879,000	
ラサ工業	600	2,266.00	1,359,600	
クレハ	1,500	7,220.00	10,830,000	
多木化学	700	6,140.00	4,298,000	
テイカ	1,300	1,503.00	1,953,900	
石原産業	3,200	801.00	2,563,200	
片倉コープアグリ	500	1,293.00	646,500	
日本曹達	2,500	3,400.00	8,500,000	
東ソー	27,200	1,929.00	52,468,800	
トクヤマ	5,200	2,677.00	13,920,400	
セントラル硝子	3,400	2,246.00	7,636,400	
東亜合成	10,700	1,230.00	13,161,000	
大阪ソーダ	1,800	2,687.00	4,836,600	
関東電化工業	4,200	894.00	3,754,800	

デンカ	6,400	4,285.00	27,424,000
信越化学工業	32,500	18,740.00	609,050,000
日本カーバイド工業	600	1,350.00	810,000
堺化学工業	1,200	2,085.00	2,502,000
第一稀元素化学工業	1,800	1,055.00	1,899,000
エア・ウォーター	17,900	1,795.00	32,130,500
日本酸素ホールディングス	14,500	2,034.00	29,493,000
日本化学工業	500	3,325.00	1,662,500
東邦アセチレン	300	1,421.00	426,300
日本パーカライズン	8,900	1,152.00	10,252,800
高压ガス工業	2,800	774.00	2,167,200
チタン工業	200	2,227.00	445,400
四国化成工業	2,300	1,238.00	2,847,400
戸田工業	400	2,175.00	870,000
ステラ ケミファ	1,000	3,335.00	3,335,000
保土谷化学工業	500	4,990.00	2,495,000
日本触媒	3,200	5,960.00	19,072,000
大日精化工業	1,500	2,437.00	3,655,500
カネカ	4,500	4,265.00	19,192,500
三菱瓦斯化学	17,600	2,567.00	45,179,200
三井化学	15,200	3,340.00	50,768,000
J S R	17,600	3,295.00	57,992,000
東京応化工業	3,000	7,350.00	22,050,000
大阪有機化学工業	1,600	3,935.00	6,296,000
三菱ケミカルホールディングス	117,600	741.80	87,235,680
K H ネオケム	2,900	2,580.00	7,482,000
ダイセル	23,600	859.00	20,272,400
住友ベークライト	2,800	4,300.00	12,040,000
積水化学工業	37,200	2,041.00	75,925,200
日本ゼオン	15,900	1,657.00	26,346,300
アイカ工業	4,900	3,905.00	19,134,500
宇部興産	8,900	2,086.00	18,565,400
積水樹脂	2,900	2,162.00	6,269,800
タキロンシーアイ	3,800	707.00	2,686,600
旭有機材	1,000	1,521.00	1,521,000
ニチバン	900	1,871.00	1,683,900

リケンテクノス	4,300	504.00	2,167,200	
大倉工業	800	2,044.00	1,635,200	
積水化成成品工業	2,400	568.00	1,363,200	
群栄化学工業	400	2,500.00	1,000,000	
タイガースポリマー	900	464.00	417,600	
ミライアル	600	1,275.00	765,000	
ダイキアクシス	600	1,009.00	605,400	
ダイキョーニシカワ	3,700	843.00	3,119,100	
竹本容器	600	897.00	538,200	
森六ホールディングス	900	2,150.00	1,935,000	
恵和	300	2,012.00	603,600	
日本化薬	10,900	1,062.00	11,575,800	
カーリットホールディングス	1,700	739.00	1,256,300	
日本精化	1,300	1,453.00	1,888,900	
扶桑化学工業	1,400	3,745.00	5,243,000	
トリケミカル研究所	1,600	4,170.00	6,672,000	
A D E K A	8,100	1,937.00	15,689,700	
日油	6,600	5,640.00	37,224,000	
新日本理化	2,900	268.00	777,200	
ハリマ化成グループ	1,300	983.00	1,277,900	
花王	43,000	7,450.00	320,350,000	
第一工業製薬	600	3,840.00	2,304,000	
石原ケミカル	400	2,175.00	870,000	
日華化学	600	907.00	544,200	
ニイタカ	400	2,826.00	1,130,400	
三洋化成工業	1,000	5,390.00	5,390,000	
有機合成薬品工業	1,300	301.00	391,300	
大日本塗料	2,000	934.00	1,868,000	
日本ペイントホールディングス	14,500	9,120.00	132,240,000	
関西ペイント	19,800	3,095.00	61,281,000	
神東塗料	1,400	205.00	287,000	
中国塗料	4,200	943.00	3,960,600	
日本特殊塗料	1,300	1,189.00	1,545,700	
藤倉化成	2,400	529.00	1,269,600	
太陽ホールディングス	1,300	6,000.00	7,800,000	
D I C	7,400	2,756.00	20,394,400	

サカイクス	3,800	1,109.00	4,214,200
東洋インキSCホールディングス	3,700	1,930.00	7,141,000
T & K TOKA	1,400	850.00	1,190,000
富士フイルムホールディングス	31,600	6,373.00	201,386,800
資生堂	35,700	8,180.00	292,026,000
ライオン	23,300	2,244.00	52,285,200
高砂香料工業	1,100	2,646.00	2,910,600
マングラム	3,800	1,789.00	6,798,200
ミルボン	2,400	7,160.00	17,184,000
ファンケル	6,500	4,060.00	26,390,000
コーセー	3,400	18,340.00	62,356,000
コタ	1,000	1,641.00	1,641,000
シーボン	200	1,999.00	399,800
ポーラ・オルビスホールディングス	7,700	2,529.00	19,473,300
ノエビアホールディングス	1,500	4,975.00	7,462,500
アジュバンコスメジャパン	400	1,086.00	434,400
新日本製薬	400	2,776.00	1,110,400
エステー	1,200	2,060.00	2,472,000
アグロ カネショウ	700	1,631.00	1,141,700
コニシ	2,900	1,649.00	4,782,100
長谷川香料	3,100	2,019.00	6,258,900
星光PMC	1,000	776.00	776,000
小林製薬	5,000	11,160.00	55,800,000
荒川化学工業	1,500	1,290.00	1,935,000
メック	1,200	2,167.00	2,600,400
日本高純度化学	500	2,789.00	1,394,500
タカラバイオ	4,700	3,300.00	15,510,000
JCU	2,000	3,580.00	7,160,000
新田ゼラチン	1,100	680.00	748,000
OATアグリオ	300	1,416.00	424,800
デクセリアルズ	5,000	1,439.00	7,195,000
アース製薬	1,400	6,240.00	8,736,000
北興化学工業	1,700	1,120.00	1,904,000
大成ラミック	600	2,955.00	1,773,000
クミアイ化学工業	7,400	895.00	6,623,000
日本農薬	3,200	516.00	1,651,200

アキレス	1,200	1,523.00	1,827,600	
有沢製作所	2,500	998.00	2,495,000	
日東電工	11,500	10,020.00	115,230,000	
レック	2,100	1,407.00	2,954,700	
三光合成	1,900	460.00	874,000	
きもと	2,700	197.00	531,900	
藤森工業	1,600	4,730.00	7,568,000	
前澤化成工業	1,100	980.00	1,078,000	
未来工業	600	1,768.00	1,060,800	
ウェーブロックホールディングス	600	756.00	453,600	
J S P	1,100	1,839.00	2,022,900	
エフピコ	3,300	4,190.00	13,827,000	
天馬	1,300	2,338.00	3,039,400	
信越ポリマー	2,800	1,066.00	2,984,800	
東リ	4,500	248.00	1,116,000	
ニフコ	6,600	4,135.00	27,291,000	
バルカー	1,500	2,166.00	3,249,000	
ユニ・チャーム	38,100	4,742.00	180,670,200	
ショーエイコーポレーション	400	1,033.00	413,200	
協和キリン	18,100	3,240.00	58,644,000	
武田薬品工業	149,400	3,715.00	555,021,000	
アステラス製薬	155,700	1,784.50	277,846,650	
大日本住友製薬	13,300	1,751.00	23,288,300	
塩野義製薬	22,600	6,070.00	137,182,000	
わかもと製薬	2,100	247.00	518,700	
あすか製薬	2,000	1,521.00	3,042,000	
日本新薬	5,100	7,790.00	39,729,000	
ピオフェルミン製薬	300	2,609.00	782,700	
中外製薬	56,200	5,148.00	289,317,600	
科研製薬	3,100	4,110.00	12,741,000	
エーザイ	19,800	7,786.00	154,162,800	
ロート製薬	8,600	3,135.00	26,961,000	
小野薬品工業	41,200	3,146.00	129,615,200	
久光製薬	5,200	7,020.00	36,504,000	
持田製薬	2,500	4,235.00	10,587,500	
参天製薬	31,200	1,603.00	50,013,600	

扶桑薬品工業	600	2,720.00	1,632,000	
日本ケミファ	200	2,275.00	455,000	
ツムラ	6,000	3,455.00	20,730,000	
日医工	5,100	1,023.00	5,217,300	
キッセイ薬品工業	3,200	2,266.00	7,251,200	
生化学工業	3,200	1,088.00	3,481,600	
栄研化学	3,200	2,245.00	7,184,000	
日水製薬	700	1,002.00	701,400	
鳥居薬品	1,100	3,050.00	3,355,000	
JCRファーマ	5,100	3,170.00	16,167,000	
東和薬品	2,600	2,237.00	5,816,200	
富士製薬工業	1,200	1,350.00	1,620,000	
沢井製薬	3,900	4,810.00	18,759,000	
ゼリア新薬工業	3,300	2,061.00	6,801,300	
第一三共	154,100	3,368.00	519,008,800	
キョーリン製薬ホールディングス	4,000	1,942.00	7,768,000	
大幸薬品	2,200	1,420.00	3,124,000	
ダイト	1,100	3,790.00	4,169,000	
大塚ホールディングス	37,300	4,530.00	168,969,000	
大正製薬ホールディングス	4,300	7,150.00	30,745,000	
ペプチドリーム	9,100	5,670.00	51,597,000	
日本コークス工業	15,100	106.00	1,600,600	
ニチレキ	2,100	1,566.00	3,288,600	
ユシロ化学工業	1,000	1,136.00	1,136,000	
ビーピー・カストロール	600	1,249.00	749,400	
富士石油	4,300	215.00	924,500	
MORESCO	600	1,175.00	705,000	
出光興産	19,900	2,741.00	54,545,900	
ENEOSホールディングス	270,100	454.10	122,652,410	
コスモエネルギーホールディングス	5,700	2,576.00	14,683,200	
横浜ゴム	10,400	1,822.00	18,948,800	
TOYO TIRE	9,400	1,792.00	16,844,800	
ブリヂストン	47,700	4,396.00	209,689,200	
住友ゴム工業	16,100	1,149.00	18,498,900	
藤倉コンポジット	1,600	434.00	694,400	
オカモト	1,100	4,160.00	4,576,000	

フコク	800	699.00	559,200
ニッタ	1,900	2,517.00	4,782,300
住友理工	3,500	653.00	2,285,500
三ツ星ベルト	2,200	1,770.00	3,894,000
バンドー化学	3,200	741.00	2,371,200
日東紡績	2,700	4,535.00	12,244,500
A G C	16,500	3,705.00	61,132,500
日本板硝子	9,100	546.00	4,968,600
石塚硝子	300	1,887.00	566,100
日本山村硝子	700	912.00	638,400
日本電気硝子	6,700	2,414.00	16,173,800
オハラ	700	2,000.00	1,400,000
住友大阪セメント	3,200	3,615.00	11,568,000
太平洋セメント	10,600	2,563.00	27,167,800
日本ヒューム	1,600	781.00	1,249,600
日本コンクリート工業	3,900	340.00	1,326,000
三谷セキサン	800	5,150.00	4,120,000
アジアパイルホールディングス	2,800	499.00	1,397,200
東海カーボン	17,600	1,539.00	27,086,400
日本カーボン	1,000	4,195.00	4,195,000
東洋炭素	1,100	2,107.00	2,317,700
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	3,660.00	3,660,000
T O T O	12,800	7,230.00	92,544,000
日本碍子	19,800	1,927.00	38,154,600
日本特殊陶業	13,700	1,924.00	26,358,800
ダントーホールディングス	1,300	376.00	488,800
M A R U W A	600	10,980.00	6,588,000
品川リフラクトリーズ	400	2,935.00	1,174,000
黒崎播磨	300	4,880.00	1,464,000
ヨータイ	1,300	960.00	1,248,000
イソライト工業	800	600.00	480,000
東京窯業	2,300	325.00	747,500
ニッカトー	800	757.00	605,600
フジミインコーポレーテッド	1,400	4,290.00	6,006,000
クニミネ工業	600	1,275.00	765,000
エーアンドエーマテリアル	300	1,086.00	325,800

ニチアス	4,500	2,538.00	11,421,000	
ニチハ	2,500	3,215.00	8,037,500	
日本製鉄	84,800	1,500.00	127,200,000	
神戸製鋼所	32,500	646.00	20,995,000	
中山製鋼所	2,500	401.00	1,002,500	
合同製鐵	1,000	2,098.00	2,098,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	51,400	1,089.00	55,974,600	
東京製鐵	6,900	747.00	5,154,300	
共英製鋼	2,000	1,436.00	2,872,000	
大和工業	3,800	2,752.00	10,457,600	
東京鐵鋼	700	2,010.00	1,407,000	
大阪製鐵	900	1,273.00	1,145,700	
淀川製鋼所	2,400	2,268.00	5,443,200	
丸一鋼管	5,800	2,505.00	14,529,000	
モリ工業	500	2,389.00	1,194,500	
大同特殊鋼	2,900	4,760.00	13,804,000	
日本高周波鋼業	600	374.00	224,400	
日本冶金工業	1,400	2,011.00	2,815,400	
山陽特殊製鋼	2,100	1,778.00	3,733,800	
愛知製鋼	1,000	3,310.00	3,310,000	
日立金属	16,700	1,717.00	28,673,900	
日本金属	400	1,213.00	485,200	
大太平洋金属	1,200	2,251.00	2,701,200	
新日本電工	11,400	285.00	3,249,000	
栗本鐵工所	800	1,741.00	1,392,800	
虹技	200	1,169.00	233,800	
日本鑄鉄管	200	1,414.00	282,800	
三菱製鋼	1,300	726.00	943,800	
日亜鋼業	2,600	298.00	774,800	
日本精線	300	3,780.00	1,134,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	787.00	629,600	
シンニッタン	2,100	223.00	468,300	
新家工業	400	1,415.00	566,000	
大紀アルミニウム工業所	2,700	780.00	2,106,000	
日本輕金属ホールディングス	4,800	2,035.00	9,768,000	
三井金属鋳業	4,800	3,765.00	18,072,000	

東邦亜鉛	1,000	2,284.00	2,284,000
三菱マテリアル	11,700	2,398.00	28,056,600
住友金属鉱山	22,700	5,031.00	114,203,700
DOWAホールディングス	4,500	3,910.00	17,595,000
古河機械金属	2,900	1,331.00	3,859,900
エス・サイエンス	7,800	43.00	335,400
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,800	810.00	1,458,000
東邦チタニウム	3,200	931.00	2,979,200
UACJ	2,700	2,238.00	6,042,600
CKサンエツ	400	3,820.00	1,528,000
古河電気工業	5,500	2,925.00	16,087,500
住友電気工業	62,000	1,601.50	99,293,000
フジクラ	21,400	495.00	10,593,000
昭和電線ホールディングス	1,700	1,814.00	3,083,800
東京特殊電線	200	2,563.00	512,600
タツタ電線	3,100	681.00	2,111,100
カナレ電気	300	1,768.00	530,400
平河ヒューテック	1,000	1,220.00	1,220,000
リョービ	2,200	1,336.00	2,939,200
アーレスティ	2,200	408.00	897,600
アサヒホールディングス	3,300	4,280.00	14,124,000
稲葉製作所	1,000	1,449.00	1,449,000
宮地エンジニアリンググループ	600	2,235.00	1,341,000
トーカロ	4,600	1,445.00	6,647,000
アルファC o	600	1,100.00	660,000
SUMCO	22,700	2,485.00	56,409,500
川田テクノロジーズ	400	4,600.00	1,840,000
RS Technologies	600	6,360.00	3,816,000
ジェイテックコーポレーション	100	3,750.00	375,000
信和	900	755.00	679,500
東洋製罐グループホールディングス	11,300	1,317.00	14,882,100
ホッカンホールディングス	900	1,468.00	1,321,200
コロナ	1,000	973.00	973,000
横河ブリッジホールディングス	3,000	2,008.00	6,024,000
駒井ハルテック	400	2,172.00	868,800
高田機工	200	2,613.00	522,600

三和ホールディングス	16,700	1,355.00	22,628,500
文化シャッター	5,200	1,042.00	5,418,400
三協立山	2,300	842.00	1,936,600
アルインコ	1,200	982.00	1,178,400
東洋シャッター	400	702.00	280,800
L I X I L	24,500	2,977.00	72,936,500
日本フィルコン	1,200	502.00	602,400
ノーリツ	3,700	1,718.00	6,356,600
長府製作所	1,800	2,139.00	3,850,200
リンナイ	3,500	11,950.00	41,825,000
ダイニチ工業	800	905.00	724,000
日東精工	2,200	497.00	1,093,400
三洋工業	200	1,886.00	377,200
岡部	3,600	800.00	2,880,000
ジーテクト	2,200	1,503.00	3,306,600
東プレ	3,300	1,631.00	5,382,300
高周波熱錬	3,400	536.00	1,822,400
東京製綱	1,300	1,446.00	1,879,800
サンコール	1,500	488.00	732,000
モリテック スチール	1,400	419.00	586,600
パイオラックス	2,600	1,702.00	4,425,200
エイチワン	1,700	820.00	1,394,000
日本発條	17,700	827.00	14,637,900
中央発條	200	2,893.00	578,600
アドバネクス	300	1,561.00	468,300
立川ブラインド工業	800	1,335.00	1,068,000
三益半導体工業	1,400	2,725.00	3,815,000
日本ドライケミカル	400	1,600.00	640,000
日本製鋼所	5,400	3,280.00	17,712,000
三浦工業	7,700	6,190.00	47,663,000
タクマ	6,000	2,121.00	12,726,000
ツガミ	3,700	1,654.00	6,119,800
オークマ	2,100	6,290.00	13,209,000
芝浦機械	1,800	2,986.00	5,374,800
アマダ	26,000	1,310.00	34,060,000
アイダエンジニアリング	4,600	982.00	4,517,200

滝澤鉄工所	500	1,080.00	540,000
F U J I	7,100	2,756.00	19,567,600
牧野フライス製作所	2,100	4,250.00	8,925,000
オーエスジー	8,800	1,998.00	17,582,400
ダイジェット工業	200	1,372.00	274,400
旭ダイヤモンド工業	4,700	509.00	2,392,300
D M G 森精機	11,200	1,617.00	18,110,400
ソディック	3,900	1,020.00	3,978,000
ディスコ	2,400	35,550.00	85,320,000
日東工器	900	1,895.00	1,705,500
日進工具	700	2,750.00	1,925,000
パンチ工業	1,500	553.00	829,500
富士ダイス	900	672.00	604,800
豊和工業	1,000	882.00	882,000
O K K	700	465.00	325,500
石川製作所	500	1,734.00	867,000
東洋機械金属	1,300	475.00	617,500
津田駒工業	300	892.00	267,600
エンシュウ	400	916.00	366,400
島精機製作所	2,600	2,298.00	5,974,800
オプトラン	2,200	2,578.00	5,671,600
N C ホールディングス	500	678.00	339,000
イワキポンプ	1,100	838.00	921,800
フリー	1,700	1,171.00	1,990,700
ヤマシンフィルタ	3,600	854.00	3,074,400
日阪製作所	2,200	855.00	1,881,000
やまびこ	3,400	1,281.00	4,355,400
平田機工	800	7,840.00	6,272,000
ペガサスミシン製造	1,800	424.00	763,200
マルマエ	700	1,295.00	906,500
タツモ	800	1,435.00	1,148,000
ナブテスコ	10,500	5,020.00	52,710,000
三井海洋開発	1,900	1,738.00	3,302,200
レオン自動機	1,700	1,166.00	1,982,200
S M C	5,300	67,480.00	357,644,000
ホソカワミクロン	600	6,880.00	4,128,000

ユニオンツール	700	3,435.00	2,404,500	
オイレス工業	2,500	1,709.00	4,272,500	
日精エー・エス・ビー機械	500	6,200.00	3,100,000	
サトーホールディングス	2,300	2,580.00	5,934,000	
技研製作所	1,600	5,180.00	8,288,000	
日本エアテック	600	1,245.00	747,000	
カワタ	500	973.00	486,500	
日精樹脂工業	1,400	922.00	1,290,800	
オカダアイヨン	600	1,179.00	707,400	
ワイエイシイホールディングス	700	1,004.00	702,800	
小松製作所	81,400	3,262.00	265,526,800	
住友重機械工業	10,300	2,934.00	30,220,200	
日立建機	8,400	3,230.00	27,132,000	
日工	2,700	731.00	1,973,700	
巴工業	700	2,095.00	1,466,500	
井関農機	1,800	1,466.00	2,638,800	
T O W A	1,700	2,132.00	3,624,400	
丸山製作所	400	1,620.00	648,000	
北川鉄工所	800	1,561.00	1,248,800	
ローツェ	800	8,150.00	6,520,000	
タカキタ	600	710.00	426,000	
クボタ	94,300	2,584.00	243,671,200	
荏原実業	400	4,890.00	1,956,000	
三菱化工機	600	3,055.00	1,833,000	
月島機械	3,300	1,393.00	4,596,900	
帝国電機製作所	1,300	1,245.00	1,618,500	
東京機械製作所	700	323.00	226,100	
新東工業	4,300	773.00	3,323,900	
澁谷工業	1,600	3,675.00	5,880,000	
アイチ コーポレーション	3,100	920.00	2,852,000	
小森コーポレーション	4,500	709.00	3,190,500	
鶴見製作所	1,400	1,797.00	2,515,800	
住友精密工業	300	2,057.00	617,100	
日本ギア工業	700	315.00	220,500	
酒井重工業	300	2,160.00	648,000	
荏原製作所	7,400	4,155.00	30,747,000	

石井鐵工所	300	2,881.00	864,300
西島製作所	1,800	855.00	1,539,000
北越工業	1,800	1,120.00	2,016,000
ダイキン工業	22,900	23,405.00	535,974,500
オルガノ	600	6,310.00	3,786,000
トーヨーカネツ	700	2,810.00	1,967,000
栗田工業	9,700	4,320.00	41,904,000
椿本チエイン	2,600	2,846.00	7,399,600
大同工業	900	775.00	697,500
木村化工機	1,500	664.00	996,000
アネスト岩田	3,000	1,120.00	3,360,000
ダイフク	9,900	11,230.00	111,177,000
サムコ	400	3,765.00	1,506,000
加藤製作所	1,000	997.00	997,000
油研工業	300	1,646.00	493,800
タダノ	8,700	1,009.00	8,778,300
フジテック	6,200	2,785.00	17,267,000
C K D	4,200	2,545.00	10,689,000
キトー	1,500	1,508.00	2,262,000
平和	5,000	1,567.00	7,835,000
理想科学工業	1,400	1,435.00	2,009,000
S A N K Y O	4,300	2,957.00	12,715,100
日本金銭機械	2,000	533.00	1,066,000
マースグループホールディングス	1,100	1,604.00	1,764,400
フクシマガリレイ	1,200	4,245.00	5,094,000
オーイズミ	800	399.00	319,200
ダイコク電機	800	952.00	761,600
竹内製作所	3,000	2,743.00	8,229,000
アマノ	4,700	2,575.00	12,102,500
J U K I	2,500	760.00	1,900,000
サンデンホールディングス	2,500	420.00	1,050,000
蛇の目マシン工業	1,600	874.00	1,398,400
マックス	2,500	1,636.00	4,090,000
グローリー	4,600	2,357.00	10,842,200
新晃工業	1,700	2,056.00	3,495,200
大和冷機工業	2,900	1,118.00	3,242,200

セガサミーホールディングス	16,300	1,862.00	30,350,600	
日本ピストンリング	700	1,052.00	736,400	
リケン	800	2,315.00	1,852,000	
T P R	2,400	1,635.00	3,924,000	
ツバキ・ナカシマ	3,400	1,305.00	4,437,000	
ホシザキ	5,700	10,670.00	60,819,000	
大豊工業	1,500	787.00	1,180,500	
日本精工	36,900	1,044.00	38,523,600	
N T N	41,500	307.00	12,740,500	
ジェイテクト	17,200	1,198.00	20,605,600	
不二越	1,700	4,580.00	7,786,000	
日本トムソン	4,900	546.00	2,675,400	
T H K	11,200	3,850.00	43,120,000	
ユーシン精機	1,200	999.00	1,198,800	
前澤給装工業	700	2,258.00	1,580,600	
イーグル工業	2,200	1,175.00	2,585,000	
前澤工業	1,100	585.00	643,500	
日本ピラー工業	1,800	1,839.00	3,310,200	
キッツ	5,500	610.00	3,355,000	
マキタ	23,400	4,820.00	112,788,000	
日立造船	14,200	660.00	9,372,000	
三菱重工業	28,200	3,043.00	85,812,600	
I H I	12,100	1,946.00	23,546,600	
スター精密	2,800	1,623.00	4,544,400	
日清紡ホールディングス	11,000	819.00	9,009,000	
イビデン	8,600	5,040.00	43,344,000	
コニカミノルタ	36,400	572.00	20,820,800	
ブラザー工業	21,900	2,358.00	51,640,200	
ミネベアミツミ	30,900	2,726.00	84,233,400	
日立製作所	86,300	4,846.00	418,209,800	
三菱電機	179,500	1,710.00	306,945,000	
富士電機	10,800	4,545.00	49,086,000	
東洋電機製造	700	1,209.00	846,300	
安川電機	19,300	5,930.00	114,449,000	
シンフォニアテクノロジー	2,300	1,393.00	3,203,900	
明電舎	3,000	2,427.00	7,281,000	

オリジン	500	1,373.00	686,500	
山洋電気	900	6,260.00	5,634,000	
デンヨー	1,500	2,068.00	3,102,000	
東芝テック	1,900	3,990.00	7,581,000	
芝浦メカトロニクス	300	5,100.00	1,530,000	
マブチモーター	5,000	5,400.00	27,000,000	
日本電産	43,200	14,990.00	647,568,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	646.00	710,600	
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,553.00	1,553,000	
東光高岳	900	1,624.00	1,461,600	
ダブル・スコープ	3,500	1,046.00	3,661,000	
宮越ホールディングス	700	839.00	587,300	
ダイヘン	2,000	4,910.00	9,820,000	
ヤーマン	2,900	1,905.00	5,524,500	
JVCケンウッド	15,500	202.00	3,131,000	
ミマキエンジニアリング	1,600	568.00	908,800	
I - P E X	800	2,217.00	1,773,600	
日新電機	4,200	1,295.00	5,439,000	
大崎電気工業	3,600	625.00	2,250,000	
オムロン	14,900	9,750.00	145,275,000	
日東工業	2,600	2,196.00	5,709,600	
I D E C	2,400	1,831.00	4,394,400	
正興電機製作所	400	2,492.00	996,800	
不二電機工業	300	1,291.00	387,300	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,500	3,435.00	22,327,500	
サクサホールディングス	400	1,456.00	582,400	
メルコホールディングス	600	3,745.00	2,247,000	
テクノメディカ	400	1,623.00	649,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	2,380.00	1,190,000	
日本電気	22,800	6,290.00	143,412,000	
富士通	16,200	16,075.00	260,415,000	
沖電気工業	7,300	1,077.00	7,862,100	
岩崎通信機	800	873.00	698,400	
電気興業	900	2,868.00	2,581,200	
サンケン電気	2,100	5,780.00	12,138,000	

ナカヨ	300	1,449.00	434,700
アイホン	1,000	1,788.00	1,788,000
ルネサスエレクトロニクス	77,200	1,290.00	99,588,000
セイコーエプソン	22,300	1,830.00	40,809,000
ワコム	13,000	848.00	11,024,000
アルバック	3,300	5,260.00	17,358,000
アクセル	800	800.00	640,000
E I Z O	1,500	3,780.00	5,670,000
ジャパンディスプレイ	61,200	48.00	2,937,600
日本信号	4,200	960.00	4,032,000
京三製作所	3,900	440.00	1,716,000
能美防災	2,400	2,339.00	5,613,600
ホーチキ	1,300	1,317.00	1,712,100
星和電機	900	655.00	589,500
エレコム	2,100	4,915.00	10,321,500
パナソニック	191,500	1,498.00	286,867,000
シャープ	20,800	2,346.00	48,796,800
アンリツ	10,800	2,491.00	26,902,800
富士通ゼネラル	5,500	3,250.00	17,875,000
ソニー	112,500	11,970.00	1,346,625,000
T D K	8,700	16,770.00	145,899,000
帝国通信工業	800	1,150.00	920,000
タムラ製作所	6,500	563.00	3,659,500
アルプスアルパイン	14,700	1,511.00	22,211,700
池上通信機	600	852.00	511,200
日本電波工業	1,700	690.00	1,173,000
鈴木	800	1,134.00	907,200
日本トリム	400	4,520.00	1,808,000
ローランド ディー . ジー .	1,100	1,914.00	2,105,400
フォスター電機	1,900	1,467.00	2,787,300
S M K	500	3,065.00	1,532,500
ヨコオ	1,300	3,100.00	4,030,000
ティアック	1,100	125.00	137,500
ホシデン	4,900	1,066.00	5,223,400
ヒロセ電機	2,800	16,460.00	46,088,000
日本航空電子工業	4,100	1,666.00	6,830,600

TOA	2,100	932.00	1,957,200	
マクセルホールディングス	3,600	1,439.00	5,180,400	
古野電気	2,300	1,157.00	2,661,100	
ユニデンホールディングス	500	2,434.00	1,217,000	
スミダコーポレーション	1,500	1,002.00	1,503,000	
アイコム	700	2,922.00	2,045,400	
リオン	800	3,205.00	2,564,000	
本多通信工業	1,400	532.00	744,800	
船井電機	2,000	454.00	908,000	
横河電機	18,000	2,206.00	39,708,000	
新電元工業	700	3,170.00	2,219,000	
アズビル	12,100	5,000.00	60,500,000	
東亜ディーケーケー	900	863.00	776,700	
日本光電工業	7,400	3,120.00	23,088,000	
チノー	600	1,440.00	864,000	
共和電業	1,900	383.00	727,700	
日本電子材料	700	1,832.00	1,282,400	
堀場製作所	3,600	7,240.00	26,064,000	
アドバンテスト	13,300	9,300.00	123,690,000	
小野測器	700	548.00	383,600	
エスベック	1,600	1,980.00	3,168,000	
キーエンス	17,600	59,080.00	1,039,808,000	
日置電機	900	3,955.00	3,559,500	
シスメックス	14,000	12,000.00	168,000,000	
日本マイクロニクス	3,100	1,691.00	5,242,100	
メガチップス	1,800	2,998.00	5,396,400	
OBARA GROUP	1,000	4,020.00	4,020,000	
澤藤電機	200	2,185.00	437,000	
原田工業	700	941.00	658,700	
コーセル	2,200	1,183.00	2,602,600	
イリソ電子工業	1,500	5,310.00	7,965,000	
オブテックスグループ	2,900	1,895.00	5,495,500	
千代田インテグレ	800	1,890.00	1,512,000	
アイ・オー・データ機器	700	1,036.00	725,200	
レーザーテック	7,900	14,570.00	115,103,000	
スタンレー電気	12,600	3,635.00	45,801,000	

岩崎電気	700	1,551.00	1,085,700
ウシオ電機	9,200	1,393.00	12,815,600
岡谷電機産業	1,300	390.00	507,000
ヘリオス テクノ ホールディング	1,600	352.00	563,200
エノモト	500	1,800.00	900,000
日本セラミック	1,800	2,961.00	5,329,800
遠藤照明	900	599.00	539,100
古河電池	1,300	1,663.00	2,161,900
双信電機	900	461.00	414,900
山一電機	1,200	1,495.00	1,794,000
図研	1,200	2,893.00	3,471,600
日本電子	3,300	4,460.00	14,718,000
カシオ計算機	14,400	1,996.00	28,742,400
ファナック	15,800	29,000.00	458,200,000
日本シイエムケイ	3,900	433.00	1,688,700
エンプラス	800	4,895.00	3,916,000
大真空	600	2,568.00	1,540,800
ローム	7,500	11,860.00	88,950,000
浜松ホトニクス	12,900	7,000.00	90,300,000
三井ハイテック	1,800	4,225.00	7,605,000
新光電気工業	6,000	2,995.00	17,970,000
京セラ	27,400	7,077.00	193,909,800
太陽誘電	8,000	5,630.00	45,040,000
村田製作所	52,700	9,938.00	523,732,600
双葉電子工業	3,100	985.00	3,053,500
北陸電気工業	700	953.00	667,100
ニチコン	5,700	1,224.00	6,976,800
日本ケミコン	1,800	1,758.00	3,164,400
K O A	2,500	1,616.00	4,040,000
市光工業	2,700	809.00	2,184,300
小糸製作所	10,800	8,020.00	86,616,000
ミツバ	3,300	670.00	2,211,000
S C R E E Nホールディングス	3,100	8,760.00	27,156,000
キヤノン電子	1,600	1,727.00	2,763,200
キヤノン	89,200	2,364.50	210,913,400
リコー	45,700	952.00	43,506,400

象印マホービン	4,900	1,896.00	9,290,400
MUTOHホールディングス	200	1,576.00	315,200
東京エレクトロン	10,500	43,560.00	457,380,000
トヨタ紡織	5,200	1,835.00	9,542,000
芦森工業	300	1,056.00	316,800
ユニプレス	2,900	1,069.00	3,100,100
豊田自動織機	14,500	9,840.00	142,680,000
モリタホールディングス	2,900	1,872.00	5,428,800
三櫻工業	2,500	983.00	2,457,500
デンソー	39,500	6,934.00	273,893,000
東海理化電機製作所	4,700	1,888.00	8,873,600
三井E & Sホールディングス	6,900	414.00	2,856,600
川崎重工業	14,000	2,314.00	32,396,000
名村造船所	5,400	178.00	961,200
サノヤスホールディングス	2,200	151.00	332,200
日本車輛製造	700	2,643.00	1,850,100
三菱ロジスネクスト	2,400	1,175.00	2,820,000
近畿車輛	300	1,241.00	372,300
日産自動車	211,800	609.90	129,176,820
いすゞ自動車	52,000	1,166.00	60,632,000
トヨタ自動車	181,900	8,456.00	1,538,146,400
日野自動車	22,400	1,030.00	23,072,000
三菱自動車工業	66,500	309.00	20,548,500
エフテック	1,300	667.00	867,100
レシップホールディングス	700	597.00	417,900
GMB	300	928.00	278,400
ファルテック	300	848.00	254,400
武蔵精密工業	4,000	1,864.00	7,456,000
日産車体	2,600	863.00	2,243,800
新明和工業	5,100	956.00	4,875,600
極東開発工業	3,100	1,614.00	5,003,400
トビー工業	1,500	1,432.00	2,148,000
ティラド	600	1,852.00	1,111,200
曙ブレーキ工業	9,800	169.00	1,656,200
タチエス	2,800	1,212.00	3,393,600
NOK	8,700	1,420.00	12,354,000

フタバ産業	4,500	565.00	2,542,500	
K Y B	2,000	3,135.00	6,270,000	
大同メタル工業	3,700	570.00	2,109,000	
プレス工業	8,900	336.00	2,990,400	
ミクニ	2,300	302.00	694,600	
太平洋工業	3,800	1,284.00	4,879,200	
河西工業	2,400	447.00	1,072,800	
アイシン精機	13,100	3,675.00	48,142,500	
マツダ	56,400	874.00	49,293,600	
今仙電機製作所	1,600	771.00	1,233,600	
本田技研工業	141,400	3,052.00	431,552,800	
スズキ	35,600	4,960.00	176,576,000	
S U B A R U	51,500	2,126.00	109,489,000	
安永	900	1,238.00	1,114,200	
ヤマハ発動機	25,400	2,450.00	62,230,000	
T B K	2,100	448.00	940,800	
エクセディ	2,400	1,638.00	3,931,200	
豊田合成	5,800	3,015.00	17,487,000	
愛三工業	2,800	587.00	1,643,600	
盟和産業	300	917.00	275,100	
日本プラスト	1,500	570.00	855,000	
ヨロズ	1,500	1,420.00	2,130,000	
エフ・シー・シー	2,900	1,695.00	4,915,500	
シマノ	6,700	26,365.00	176,645,500	
テイ・エス テック	4,200	3,240.00	13,608,000	
ジャムコ	1,000	766.00	766,000	
テルモ	55,000	4,564.00	251,020,000	
クリエートメディック	600	980.00	588,000	
日機装	5,800	1,090.00	6,322,000	
日本エム・ディ・エム	1,000	2,138.00	2,138,000	
島津製作所	23,100	4,375.00	101,062,500	
J M S	1,500	1,058.00	1,587,000	
クボテック	500	368.00	184,000	
長野計器	1,300	986.00	1,281,800	
ブイ・テクノロジー	800	6,280.00	5,024,000	
東京計器	1,100	929.00	1,021,900	

愛知時計電機	200	4,400.00	880,000	
インターアクション	900	2,620.00	2,358,000	
オーバル	1,600	301.00	481,600	
東京精密	3,000	4,920.00	14,760,000	
マニー	7,200	2,834.00	20,404,800	
ニコン	27,400	905.00	24,797,000	
トプコン	9,000	1,371.00	12,339,000	
オリンパス	99,300	2,314.00	229,780,200	
理研計器	1,600	3,110.00	4,976,000	
タムロン	1,400	2,012.00	2,816,800	
H O Y A	35,600	13,190.00	469,564,000	
シード	800	642.00	513,600	
ノーリツ鋼機	1,600	2,422.00	3,875,200	
エー・アンド・デイ	1,500	1,297.00	1,945,500	
朝日インテック	18,900	3,255.00	61,519,500	
シチズン時計	22,800	380.00	8,664,000	
リズム	600	781.00	468,600	
大研医器	1,400	575.00	805,000	
メニコン	2,800	7,610.00	21,308,000	
シンシア	200	687.00	137,400	
松風	800	1,871.00	1,496,800	
セイコーホールディングス	2,500	1,625.00	4,062,500	
ニプロ	13,400	1,301.00	17,433,400	
中本パックス	500	1,800.00	900,000	
スノーピーク	1,100	2,549.00	2,803,900	
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,735.00	8,049,500	
トランザクション	1,000	1,152.00	1,152,000	
粧美堂	500	402.00	201,000	
ニホンフラッシュ	1,500	1,237.00	1,855,500	
前田工織	2,000	2,934.00	5,868,000	
永大産業	2,300	306.00	703,800	
アートネイチャー	1,700	689.00	1,171,300	
バンダイナムコホールディングス	14,900	9,057.00	134,949,300	
アイフィスジャパン	500	720.00	360,000	
共立印刷	3,000	129.00	387,000	
S H O E I	1,600	4,320.00	6,912,000	

フランスベッドホールディングス	2,300	982.00	2,258,600	
パイロットコーポレーション	3,200	3,175.00	10,160,000	
萩原工業	1,000	1,511.00	1,511,000	
トッパン・フォームズ	3,200	1,114.00	3,564,800	
フジシールインターナショナル	3,700	2,118.00	7,836,600	
タカラトミー	8,100	990.00	8,019,000	
廣済堂	1,300	894.00	1,162,200	
エステールホールディングス	500	643.00	321,500	
タカノ	600	610.00	366,000	
プロネクサス	1,500	1,183.00	1,774,500	
ホクシン	1,100	115.00	126,500	
ウッドワン	600	1,098.00	658,800	
大建工業	1,200	2,016.00	2,419,200	
凸版印刷	27,300	1,651.00	45,072,300	
大日本印刷	21,700	1,958.00	42,488,600	
共同印刷	600	3,355.00	2,013,000	
N I S S H A	3,700	1,489.00	5,509,300	
光村印刷	200	1,780.00	356,000	
T A K A R A & C O M P A N Y	900	1,814.00	1,632,600	
アシックス	15,900	1,818.00	28,906,200	
ツツミ	400	2,036.00	814,400	
ローランド	1,000	3,770.00	3,770,000	
小松ウオール工業	500	1,855.00	927,500	
ヤマハ	10,700	6,060.00	64,842,000	
河合楽器製作所	500	3,415.00	1,707,500	
クリナップ	1,700	501.00	851,700	
ピジョン	11,500	4,390.00	50,485,000	
オリバー	400	2,615.00	1,046,000	
兼松サステック	100	1,760.00	176,000	
キングジム	1,500	902.00	1,353,000	
リンテック	3,800	2,410.00	9,158,000	
イトーキ	3,600	365.00	1,314,000	
任天堂	10,300	66,600.00	685,980,000	
三菱鉛筆	3,000	1,422.00	4,266,000	
タカラスタンダード	3,700	1,656.00	6,127,200	
コクヨ	8,600	1,519.00	13,063,400	

ナカバヤシ	1,800	627.00	1,128,600	
グロープライド	900	4,235.00	3,811,500	
オカムラ	6,900	1,045.00	7,210,500	
美津濃	1,800	2,300.00	4,140,000	
東京電力ホールディングス	152,300	391.00	59,549,300	
中部電力	54,900	1,328.50	72,934,650	
関西電力	68,000	1,075.50	73,134,000	
中国電力	25,900	1,300.00	33,670,000	
北陸電力	16,400	689.00	11,299,600	
東北電力	42,000	935.00	39,270,000	
四国電力	14,900	757.00	11,279,300	
九州電力	39,600	942.00	37,303,200	
北海道電力	16,800	472.00	7,929,600	
沖縄電力	3,500	1,428.00	4,998,000	
電源開発	14,300	1,717.00	24,553,100	
エフオン	1,100	1,077.00	1,184,700	
イーレックス	2,600	1,801.00	4,682,600	
レノバ	3,000	3,420.00	10,260,000	
東京瓦斯	34,500	2,289.00	78,970,500	
大阪瓦斯	32,500	2,005.00	65,162,500	
東邦瓦斯	8,800	6,580.00	57,904,000	
北海道瓦斯	1,000	1,612.00	1,612,000	
広島ガス	3,700	385.00	1,424,500	
西部瓦斯	2,000	2,958.00	5,916,000	
静岡ガス	5,100	959.00	4,890,900	
メタウォーター	2,000	2,265.00	4,530,000	
SBSホールディングス	1,300	2,754.00	3,580,200	
東武鉄道	18,700	3,210.00	60,027,000	
相鉄ホールディングス	6,200	2,586.00	16,033,200	
東急	45,300	1,466.00	66,409,800	
京浜急行電鉄	23,100	1,778.00	41,071,800	
小田急電鉄	28,800	3,455.00	99,504,000	
京王電鉄	10,000	8,720.00	87,200,000	
京成電鉄	13,500	3,950.00	53,325,000	
富士急行	2,400	5,860.00	14,064,000	
新京成電鉄	500	2,243.00	1,121,500	

東日本旅客鉄道	31,600	7,789.00	246,132,400	
西日本旅客鉄道	16,000	6,428.00	102,848,000	
東海旅客鉄道	14,900	17,380.00	258,962,000	
西武ホールディングス	21,600	1,249.00	26,978,400	
鴻池運輸	2,900	1,081.00	3,134,900	
西日本鉄道	5,000	3,145.00	15,725,000	
ハマキョウレックス	1,400	3,255.00	4,557,000	
サカイ引越センター	800	5,240.00	4,192,000	
近鉄グループホールディングス	17,000	4,650.00	79,050,000	
阪急阪神ホールディングス	22,700	3,695.00	83,876,500	
南海電気鉄道	8,100	2,726.00	22,080,600	
京阪ホールディングス	7,600	5,130.00	38,988,000	
神戸電鉄	400	3,815.00	1,526,000	
名古屋鉄道	14,000	2,877.00	40,278,000	
山陽電気鉄道	1,200	2,033.00	2,439,600	
日本通運	5,900	7,700.00	45,430,000	
ヤマトホールディングス	23,800	2,885.00	68,663,000	
山九	4,400	4,390.00	19,316,000	
丸運	900	257.00	231,300	
丸全昭和運輸	1,400	3,390.00	4,746,000	
センコーグループホールディングス	9,400	1,079.00	10,142,600	
トナミホールディングス	400	5,690.00	2,276,000	
ニッコンホールディングス	5,700	2,254.00	12,847,800	
日本石油輸送	200	2,669.00	533,800	
福山通運	2,200	4,505.00	9,911,000	
セイノーホールディングス	12,700	1,598.00	20,294,600	
エスライン	500	900.00	450,000	
神奈川中央交通	400	3,865.00	1,546,000	
日立物流	3,700	3,325.00	12,302,500	
丸和運輸機関	3,600	2,230.00	8,028,000	
C & F ロジホールディングス	1,700	1,952.00	3,318,400	
九州旅客鉄道	13,200	2,632.00	34,742,400	
S Gホールディングス	32,100	2,661.00	85,418,100	
日本郵船	14,200	2,803.00	39,802,600	
商船三井	10,100	2,918.00	29,471,800	
川崎汽船	5,200	1,820.00	9,464,000	

N S ユナイテッド海運	800	1,554.00	1,243,200
明治海運	1,800	392.00	705,600
飯野海運	7,900	441.00	3,483,900
共栄タンカー	300	978.00	293,400
乾汽船	900	979.00	881,100
日本航空	41,400	2,221.00	91,949,400
A N A ホールディングス	45,900	2,356.50	108,163,350
パスコ	300	1,464.00	439,200
ランコム	500	8,580.00	4,290,000
日新	1,400	1,398.00	1,957,200
三菱倉庫	5,900	3,330.00	19,647,000
三井倉庫ホールディングス	1,800	2,263.00	4,073,400
住友倉庫	6,100	1,436.00	8,759,600
澁澤倉庫	900	2,414.00	2,172,600
東陽倉庫	2,800	340.00	952,000
日本トランスシティ	3,700	559.00	2,068,300
ケイヒン	300	1,382.00	414,600
中央倉庫	1,000	1,199.00	1,199,000
川西倉庫	300	1,200.00	360,000
安田倉庫	1,400	956.00	1,338,400
ファイズホールディングス	300	1,051.00	315,300
東洋埠頭	500	1,435.00	717,500
宇徳	1,200	470.00	564,000
上組	9,500	2,060.00	19,570,000
サンリツ	400	713.00	285,200
キムラユニティー	500	1,113.00	556,500
キューソー流通システム	400	1,599.00	639,600
近鉄エクスプレス	3,200	2,782.00	8,902,400
東海運	1,000	319.00	319,000
エーアイティー	1,100	1,089.00	1,197,900
内外トランスライン	600	1,340.00	804,000
日本コンセプト	500	1,704.00	852,000
N E C ネットエスアイ	5,800	1,950.00	11,310,000
クロスキャット	500	1,140.00	570,000
システナ	6,300	1,944.00	12,247,200
デジタルアーツ	1,000	10,480.00	10,480,000

日鉄ソリューションズ	2,600	3,445.00	8,957,000	
キューブシステム	900	1,206.00	1,085,400	
エイジア	300	1,853.00	555,900	
コア	700	1,581.00	1,106,700	
ラクーンホールディングス	1,200	2,150.00	2,580,000	
ソリトンシステムズ	900	1,954.00	1,758,600	
ソフトクリエイトホールディングス	700	2,768.00	1,937,600	
T I S	17,600	2,418.00	42,556,800	
J N Sホールディングス	800	570.00	456,000	
電算システム	700	3,195.00	2,236,500	
グリー	10,800	601.00	6,490,800	
G M Oペパボ	100	6,220.00	622,000	
コーエーテクモホールディングス	3,600	6,540.00	23,544,000	
三菱総合研究所	800	4,220.00	3,376,000	
ボルテージ	500	559.00	279,500	
電算	200	2,585.00	517,000	
A G S	900	855.00	769,500	
ファインデックス	1,500	1,221.00	1,831,500	
ブレインパッド	500	4,595.00	2,297,500	
K L a b	3,200	874.00	2,796,800	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,300	1,257.00	2,891,100	
イーブックイニシアティブジャパン	300	2,450.00	735,000	
ネクソン	44,500	3,455.00	153,747,500	
アイスタイル	5,400	461.00	2,489,400	
エムアップホールディングス	500	2,723.00	1,361,500	
エイチーム	1,200	1,225.00	1,470,000	
エニグモ	1,700	1,315.00	2,235,500	
テクノスジャパン	1,400	727.00	1,017,800	
e n i s h	900	503.00	452,700	
コロブラ	5,800	959.00	5,562,200	
オルトプラス	1,100	446.00	490,600	
ブロードリーフ	8,700	558.00	4,854,600	
クロス・マーケティンググループ	800	380.00	304,000	
デジタルハーツホールディングス	800	1,508.00	1,206,400	
システム情報	1,300	1,107.00	1,439,100	

メディアドゥ	700	6,440.00	4,508,000	
じげん	4,400	412.00	1,812,800	
ブイキューブ	1,000	3,085.00	3,085,000	
エンカレッジ・テクノロジー	300	670.00	201,000	
サイバーリンクス	600	1,927.00	1,156,200	
ディー・エル・イー	1,400	318.00	445,200	
フィックスターズ	1,900	983.00	1,867,700	
CARTA HOLDINGS	700	1,668.00	1,167,600	
オブティム	1,200	3,565.00	4,278,000	
セレス	600	3,285.00	1,971,000	
S H I F T	800	13,740.00	10,992,000	
ティーガイア	1,900	1,905.00	3,619,500	
セック	300	2,841.00	852,300	
日本アジアグループ	1,500	1,218.00	1,827,000	
テクマトリックス	2,700	1,971.00	5,321,700	
プロシップ	500	1,408.00	704,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,200	2,681.00	11,260,200	
GMOペイメントゲートウェイ	3,700	16,250.00	60,125,000	
ザッパラス	700	474.00	331,800	
システムリサーチ	500	1,828.00	914,000	
インターネットイニシアティブ	4,700	2,429.00	11,416,300	
さくらインターネット	1,900	695.00	1,320,500	
ヴィンクス	500	1,200.00	600,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	9,120.00	3,648,000	
SRAホールディングス	900	2,630.00	2,367,000	
システムインテグレータ	500	631.00	315,500	
朝日ネット	1,400	852.00	1,192,800	
e B A S E	2,100	976.00	2,049,600	
アバント	1,900	1,476.00	2,804,400	
アドソル日進	600	2,872.00	1,723,200	
ODKソリューションズ	300	765.00	229,500	
フリービット	1,000	1,008.00	1,008,000	
コムチュア	1,600	3,020.00	4,832,000	
サイバーコム	300	1,649.00	494,700	
アステリア	1,300	979.00	1,272,700	
アイル	1,000	1,578.00	1,578,000	

マークラインズ	700	2,613.00	1,829,100	
メディカル・データ・ビジョン	2,000	2,398.00	4,796,000	
g u m i	2,400	959.00	2,301,600	
ショーケース	400	993.00	397,200	
モバイルファクトリー	400	1,030.00	412,000	
テラスカイ	600	3,940.00	2,364,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	800	1,612.00	1,289,600	
P C Iホールディングス	700	1,352.00	946,400	
パイプドHD	400	1,570.00	628,000	
アイビーシー	300	1,035.00	310,500	
ネオジャパン	300	1,816.00	544,800	
P R T I M E S	400	3,750.00	1,500,000	
ランドコンピュータ	300	1,146.00	343,800	
ダブルスタンダード	200	4,210.00	842,000	
オープンドア	1,000	2,260.00	2,260,000	
マイネット	600	800.00	480,000	
アカツキ	700	4,305.00	3,013,500	
ベネフィットジャパン	100	1,839.00	183,900	
U b i c o mホールディングス	500	3,155.00	1,577,500	
カナミックネットワーク	1,600	807.00	1,291,200	
ノムラシステムコーポレーション	800	337.00	269,600	
チェンジ	2,500	3,770.00	9,425,000	
シンクロ・フード	1,000	363.00	363,000	
オークネット	900	1,335.00	1,201,500	
キャピタル・アセット・プランニング	200	975.00	195,000	
セグエグループ	500	1,290.00	645,000	
エイトレッド	300	2,508.00	752,400	
A O I T Y O H o l d i n g s	1,800	463.00	833,400	
マクロミル	3,600	855.00	3,078,000	
ビーグリー	300	1,588.00	476,400	
オロ	600	3,840.00	2,304,000	
ユーザーローカル	300	4,575.00	1,372,500	
テモナ	400	930.00	372,000	
ニーズウェル	300	674.00	202,200	
サインポスト	400	999.00	399,600	

ソルクシーズ	700	951.00	665,700	
フェイス	500	830.00	415,000	
プロトコーポレーション	1,600	1,214.00	1,942,400	
ハイマックス	400	1,601.00	640,400	
野村総合研究所	32,100	3,625.00	116,362,500	
サイバネットシステム	1,300	930.00	1,209,000	
C Eホールディングス	900	581.00	522,900	
日本システム技術	300	1,530.00	459,000	
インテージホールディングス	2,200	1,245.00	2,739,000	
東邦システムサイエンス	500	945.00	472,500	
ソースネクスト	8,300	322.00	2,672,600	
インフォコム	1,600	3,085.00	4,936,000	
HEROZ	500	3,420.00	1,710,000	
ラクスル	1,400	3,995.00	5,593,000	
I P S	300	2,987.00	896,100	
F I G	1,900	271.00	514,900	
システムサポート	500	1,531.00	765,500	
イーソル	1,000	1,313.00	1,313,000	
アルテリア・ネットワークス	2,000	1,630.00	3,260,000	
E d u L a b	200	7,520.00	1,504,000	
東海ソフト	200	1,168.00	233,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	300	2,121.00	636,300	
東名	100	1,114.00	111,400	
ヴィッツ	100	2,242.00	224,200	
トピラシステムズ	200	1,607.00	321,400	
L i n k - U	100	1,435.00	143,500	
ギフトィ	800	4,075.00	3,260,000	
ベース	100	5,750.00	575,000	
フォーカスシステムズ	1,200	961.00	1,153,200	
クレスコ	1,200	1,424.00	1,708,800	
フジ・メディア・ホールディングス	18,300	1,302.00	23,826,600	
オービック	5,600	19,750.00	110,600,000	
ジャストシステム	2,500	7,650.00	19,125,000	
T D C ソフト	1,500	979.00	1,468,500	
Zホールディングス	242,000	666.70	161,341,400	

トレンドマイクロ	9,400	6,090.00	57,246,000	
I Dホールディングス	700	1,238.00	866,600	
日本オラクル	3,600	12,690.00	45,684,000	
アルファシステムズ	500	3,915.00	1,957,500	
フューチャー	2,100	1,962.00	4,120,200	
C A C H o l d i n g s	1,100	1,554.00	1,709,400	
S Bテクノロジー	600	3,160.00	1,896,000	
トーセ	500	802.00	401,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,800	6,620.00	11,916,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	8,000	3,575.00	28,600,000	
アイティフォー	2,300	884.00	2,033,200	
東計電算	300	4,335.00	1,300,500	
エクスネット	300	1,010.00	303,000	
大塚商会	9,500	5,420.00	51,490,000	
サイボウズ	2,100	2,713.00	5,697,300	
電通国際情報サービス	2,200	3,825.00	8,415,000	
A C C E S S	1,700	806.00	1,370,200	
デジタルガレージ	2,900	4,140.00	12,006,000	
E Mシステムズ	2,900	895.00	2,595,500	
ウェザーニューズ	500	5,200.00	2,600,000	
C I J	1,200	921.00	1,105,200	
ビジネスエンジニアリング	200	3,360.00	672,000	
日本エンタープライズ	1,800	245.00	441,000	
WOWOW	800	2,870.00	2,296,000	
スカラ	1,600	815.00	1,304,000	
インテリジェント ウェイブ	1,000	697.00	697,000	
I M A G I C A G R O U P	1,500	459.00	688,500	
ネットワンシステムズ	7,200	3,570.00	25,704,000	
システムソフト	3,800	117.00	444,600	
アルゴグラフィックス	1,400	3,140.00	4,396,000	
マーベラス	2,800	949.00	2,657,200	
エイベックス	3,000	1,482.00	4,446,000	
日本ユニシス	6,100	3,500.00	21,350,000	
兼松エレクトロニクス	1,000	3,765.00	3,765,000	
都築電気	600	1,603.00	961,800	
T B S ホールディングス	11,700	2,115.00	24,745,500	

日本テレビホールディングス	14,700	1,393.00	20,477,100	
朝日放送グループホールディングス	1,700	718.00	1,220,600	
テレビ朝日ホールディングス	5,400	2,258.00	12,193,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	11,600	459.00	5,324,400	
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,513.00	3,266,900	
日本BS放送	600	1,170.00	702,000	
ビジョン	2,200	998.00	2,195,600	
スマートバリュー	500	965.00	482,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	700	1,905.00	1,333,500	
ワイヤレスゲート	700	548.00	383,600	
コネクシオ	1,000	1,429.00	1,429,000	
日本通信	15,500	223.00	3,456,500	
クロップス	300	798.00	239,400	
日本電信電話	206,100	2,850.00	587,385,000	
KDDI	141,300	3,365.00	475,474,500	
ソフトバンク	160,100	1,435.00	229,743,500	
光通信	2,100	22,340.00	46,914,000	
エムティーアイ	1,700	888.00	1,509,600	
GMOインターネット	6,300	3,605.00	22,711,500	
ファイバーゲート	600	2,337.00	1,402,200	
アйдママーケティングコミュニケーション	500	457.00	228,500	
KADOKAWA	4,700	3,910.00	18,377,000	
学研ホールディングス	2,400	1,801.00	4,322,400	
ゼンリン	3,200	1,380.00	4,416,000	
昭文社ホールディングス	700	481.00	336,700	
インプレスホールディングス	1,500	194.00	291,000	
アイネット	900	1,543.00	1,388,700	
松竹	1,200	15,380.00	18,456,000	
東宝	10,400	4,375.00	45,500,000	
東映	600	21,780.00	13,068,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	46,900	1,677.00	78,651,300	
ピー・シー・エー	300	4,340.00	1,302,000	
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,803.00	1,081,800	
D T S	3,700	2,481.00	9,179,700	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,500	7,150.00	53,625,000	
シーイーシー	1,900	1,499.00	2,848,100	

カブコン	7,600	6,850.00	52,060,000
アイ・エス・ビー	800	1,403.00	1,122,400
ジャステック	1,100	1,259.00	1,384,900
S C S K	4,100	6,720.00	27,552,000
日本システムウエア	600	2,092.00	1,255,200
アイネス	1,700	1,403.00	2,385,100
T K C	1,500	6,890.00	10,335,000
富士ソフト	1,900	5,910.00	11,229,000
N S D	5,700	2,015.00	11,485,500
コナミホールディングス	6,400	7,310.00	46,784,000
福井コンピュータホールディングス	800	4,030.00	3,224,000
J B C Cホールディングス	1,200	1,506.00	1,807,200
ミロク情報サービス	1,700	2,294.00	3,899,800
ソフトバンクグループ	139,800	10,005.00	1,398,699,000
ハウスイ	100	1,010.00	101,000
高千穂交易	700	1,223.00	856,100
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,624.00	487,200
伊藤忠食品	400	5,320.00	2,128,000
エレマテック	1,400	1,031.00	1,443,400
J A L U X	500	1,577.00	788,500
あらた	1,400	4,945.00	6,923,000
トーメンデバイス	200	3,985.00	797,000
東京エレクトロン デバイス	600	4,025.00	2,415,000
フィールズ	1,500	506.00	759,000
双日	97,700	264.00	25,792,800
アルフレッサ ホールディングス	18,300	2,232.00	40,845,600
横浜冷凍	4,600	904.00	4,158,400
神栄	200	1,489.00	297,800
ラサ商事	900	919.00	827,100
アルコニックス	1,900	1,673.00	3,178,700
神戸物産	12,200	2,943.00	35,904,600
ハイパー	300	540.00	162,000
あい ホールディングス	2,500	2,103.00	5,257,500
ディーブイエックス	600	1,089.00	653,400
ダイワボウホールディングス	1,600	8,390.00	13,424,000
マクニカ・富士エレホールディングス	4,200	2,205.00	9,261,000

ラクト・ジャパン	800	2,711.00	2,168,800	
グリムス	400	1,707.00	682,800	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,100	832.00	2,579,200	
八洲電機	1,400	973.00	1,362,200	
メディアスホールディングス	1,000	878.00	878,000	
レスターホールディングス	1,800	2,133.00	3,839,400	
ジューテックホールディングス	400	1,087.00	434,800	
大光	700	670.00	469,000	
OCHIホールディングス	500	1,379.00	689,500	
TOKAIホールディングス	8,600	981.00	8,436,600	
黒谷	500	698.00	349,000	
Cominix	300	772.00	231,600	
三洋貿易	1,800	1,098.00	1,976,400	
ビューティガレージ	300	2,534.00	760,200	
ウイン・パートナーズ	1,300	1,202.00	1,562,600	
ミタチ産業	500	600.00	300,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,100	6,290.00	19,499,000	
明治電機工業	600	1,446.00	867,600	
デリカフーズホールディングス	700	631.00	441,700	
スターティアホールディングス	300	974.00	292,200	
コメダホールディングス	3,900	1,971.00	7,686,900	
ピーバンドットコム	200	906.00	181,200	
アセンテック	500	1,902.00	951,000	
富士興産	500	1,258.00	629,000	
協栄産業	200	1,400.00	280,000	
小野建	1,600	1,356.00	2,169,600	
南陽	400	1,674.00	669,600	
佐鳥電機	1,100	781.00	859,100	
エコートレーディング	400	688.00	275,200	
伯東	1,100	1,326.00	1,458,600	
コンドーテック	1,400	1,100.00	1,540,000	
中山福	1,000	519.00	519,000	
ナガイレーベン	2,300	3,055.00	7,026,500	
三菱食品	1,900	2,946.00	5,597,400	
松田産業	1,300	1,967.00	2,557,100	
第一興商	2,600	3,980.00	10,348,000	

メディバルホールディングス	17,700	2,229.00	39,453,300	
S P K	800	1,290.00	1,032,000	
萩原電気ホールディングス	700	2,645.00	1,851,500	
アズワン	1,300	15,400.00	20,020,000	
スズデン	600	1,248.00	748,800	
尾家産業	500	1,382.00	691,000	
シモジマ	1,100	1,403.00	1,543,300	
ドウシシャ	1,700	1,888.00	3,209,600	
小津産業	400	1,924.00	769,600	
高速	900	1,592.00	1,432,800	
たけびし	600	1,560.00	936,000	
リックス	400	1,650.00	660,000	
丸文	1,600	533.00	852,800	
ハピネット	1,500	1,557.00	2,335,500	
橋本総業ホールディングス	400	2,546.00	1,018,400	
日本ライフライン	5,700	1,400.00	7,980,000	
タカショー	1,100	792.00	871,200	
マルカ	600	2,020.00	1,212,000	
I D O M	6,000	643.00	3,858,000	
進和	1,000	2,208.00	2,208,000	
エスケイジャパン	400	464.00	185,600	
ダイトロン	700	1,591.00	1,113,700	
シークス	2,200	1,739.00	3,825,800	
田中商事	500	699.00	349,500	
オーハシテクニカ	900	1,530.00	1,377,000	
白銅	600	1,457.00	874,200	
ダイコー通産	200	1,597.00	319,400	
伊藤忠商事	123,700	3,140.00	388,418,000	
丸紅	174,400	741.10	129,247,840	
高島	300	1,735.00	520,500	
長瀬産業	9,900	1,768.00	17,503,200	
蝶理	1,100	1,575.00	1,732,500	
豊田通商	17,800	4,715.00	83,927,000	
三共生興	2,700	501.00	1,352,700	
兼松	7,100	1,443.00	10,245,300	
ツカモトコーポレーション	300	1,554.00	466,200	

三井物産	143,600	2,057.50	295,457,000
日本紙パルプ商事	900	3,710.00	3,339,000
カメイ	2,300	1,252.00	2,879,600
東都水産	200	3,760.00	752,000
OUGホールディングス	300	2,807.00	842,100
スターゼン	700	4,415.00	3,090,500
山善	6,900	1,025.00	7,072,500
椿本興業	300	3,770.00	1,131,000
住友商事	111,600	1,501.00	167,511,600
内田洋行	700	4,560.00	3,192,000
三菱商事	107,700	2,888.00	311,037,600
第一実業	800	4,125.00	3,300,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,400	2,494.00	10,973,600
西華産業	900	1,416.00	1,274,400
佐藤商事	1,500	1,015.00	1,522,500
菱洋エレクトロ	1,300	2,919.00	3,794,700
東京産業	1,600	688.00	1,100,800
ユアサ商事	1,800	3,180.00	5,724,000
神鋼商事	400	1,983.00	793,200
トルク	1,100	265.00	291,500
阪和興業	3,500	2,900.00	10,150,000
正栄食品工業	1,100	3,920.00	4,312,000
カナデン	1,400	1,303.00	1,824,200
菱電商事	1,300	1,607.00	2,089,100
フルサト工業	900	1,330.00	1,197,000
岩谷産業	4,200	6,290.00	26,418,000
ナイス	700	1,614.00	1,129,800
昭光通商	600	756.00	453,600
ニチモウ	300	1,938.00	581,400
極東貿易	500	1,407.00	703,500
イワキ	2,300	628.00	1,444,400
三愛石油	4,400	1,132.00	4,980,800
稲畑産業	4,200	1,545.00	6,489,000
G S Iクレオス	400	2,669.00	1,067,600
明和産業	1,600	478.00	764,800
クワザワホールディングス	600	697.00	418,200

ヤマエ久野	1,300	1,110.00	1,443,000
ワキタ	3,500	1,040.00	3,640,000
東邦ホールディングス	5,700	2,053.00	11,702,100
サンゲツ	4,800	1,636.00	7,852,800
ミツウロコグループホールディングス	2,600	1,273.00	3,309,800
シナネンホールディングス	700	3,275.00	2,292,500
伊藤忠エネクス	3,900	1,035.00	4,036,500
サンリオ	5,000	1,735.00	8,675,000
サンワテクノス	1,200	1,096.00	1,315,200
リョーサン	2,000	2,335.00	4,670,000
新光商事	2,400	786.00	1,886,400
トーホー	800	1,827.00	1,461,600
三信電気	900	2,130.00	1,917,000
東陽テクニカ	1,900	1,173.00	2,228,700
モスフードサービス	2,500	3,155.00	7,887,500
加賀電子	1,600	2,540.00	4,064,000
ソーダニッカ	1,700	541.00	919,700
立花エレテック	1,300	1,643.00	2,135,900
フォーバル	600	865.00	519,000
PALTAC	2,800	5,600.00	15,680,000
三谷産業	2,300	435.00	1,000,500
太平洋興発	700	661.00	462,700
西本Wismettacホールディングス	400	2,994.00	1,197,600
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,586.00	317,200
コア商事ホールディングス	500	1,358.00	679,000
国際紙バルブ商事	3,800	248.00	942,400
ヤマタネ	800	1,448.00	1,158,400
丸紅建材リース	200	1,875.00	375,000
日鉄物産	1,300	3,880.00	5,044,000
泉州電業	500	3,485.00	1,742,500
トラスコ中山	4,000	2,811.00	11,244,000
オートバックスセブン	6,600	1,418.00	9,358,800
モリト	1,300	614.00	798,200
加藤産業	2,600	3,740.00	9,724,000
北恵	400	953.00	381,200
イノテック	1,000	1,292.00	1,292,000

イエローハット	3,300	1,720.00	5,676,000
J Kホールディングス	1,600	849.00	1,358,400
日伝	1,500	2,275.00	3,412,500
北沢産業	1,200	268.00	321,600
杉本商事	900	2,438.00	2,194,200
因幡電機産業	4,700	2,550.00	11,985,000
東テク	600	2,862.00	1,717,200
ミスミグループ本社	22,200	3,555.00	78,921,000
アルテック	1,300	288.00	374,400
タキヒヨー	600	1,982.00	1,189,200
蔵王産業	300	1,398.00	419,400
スズケン	7,500	4,355.00	32,662,500
ジェコス	1,200	972.00	1,166,400
グローセル	1,900	509.00	967,100
ローソン	4,500	5,300.00	23,850,000
サンエー	1,300	4,325.00	5,622,500
カワチ薬品	1,200	3,040.00	3,648,000
エーピーシー・マート	2,800	6,210.00	17,388,000
ハードオフコーポレーション	800	798.00	638,400
アスクル	1,500	3,845.00	5,767,500
ゲオホールディングス	2,400	1,214.00	2,913,600
アダストリア	2,400	2,093.00	5,023,200
ジーフット	1,100	426.00	468,600
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	418.00	125,400
くら寿司	1,000	7,120.00	7,120,000
キャンドウ	800	1,906.00	1,524,800
アイケイ	400	913.00	365,200
バルグループホールディングス	1,500	1,619.00	2,428,500
エディオン	7,500	1,091.00	8,182,500
サーラコーポレーション	3,600	589.00	2,120,400
ワッツ	800	881.00	704,800
ハローズ	700	3,100.00	2,170,000
フジオフードグループ本社	1,500	1,339.00	2,008,500
あみやき亭	400	2,985.00	1,194,000
ひらまつ	2,800	175.00	490,000
大黒天物産	400	6,140.00	2,456,000

ハニーズホールディングス	1,400	998.00	1,397,200
ファーマライズホールディングス	400	785.00	314,000
アルペン	1,400	2,230.00	3,122,000
ハブ	600	712.00	427,200
クオールホールディングス	2,400	1,458.00	3,499,200
ジーンズホールディングス	900	7,520.00	6,768,000
ビックカメラ	10,500	1,202.00	12,621,000
D C Mホールディングス	10,900	1,128.00	12,295,200
ペッパーフードサービス	2,000	284.00	568,000
MonotaRO	12,600	6,410.00	80,766,000
東京一番フーズ	400	594.00	237,600
D Dホールディングス	800	694.00	555,200
きちりホールディングス	500	610.00	305,000
アークランドサービスホールディングス	1,500	2,192.00	3,288,000
J . フロント リテイリング	21,100	1,006.00	21,226,600
ドトール・日レスホールディングス	2,800	1,684.00	4,715,200
マツモトキヨシホールディングス	7,300	4,615.00	33,689,500
ブロンコピラー	900	2,320.00	2,088,000
Z O Z O	10,400	3,480.00	36,192,000
トレジャー・ファクトリー	500	835.00	417,500
物語コーポレーション	500	11,810.00	5,905,000
ココカラファイン	1,600	7,820.00	12,512,000
三越伊勢丹ホールディングス	30,900	731.00	22,587,900
H a m e e	500	1,819.00	909,500
ウエルシアホールディングス	9,300	3,635.00	33,805,500
クリエイトSDホールディングス	2,600	3,435.00	8,931,000
丸善C H I ホールディングス	2,100	378.00	793,800
ミサワ	400	682.00	272,800
ティーライフ	300	1,227.00	368,100
エー・ピーホールディングス	300	503.00	150,900
チムニー	500	1,369.00	684,500
シュッピン	1,200	982.00	1,178,400
オイシックス・ラ・大地	1,700	2,997.00	5,094,900
ネクステージ	3,000	1,656.00	4,968,000
ジョイフル本田	5,200	1,473.00	7,659,600
鳥貴族ホールディングス	500	1,694.00	847,000

ホットランド	1,300	1,228.00	1,596,400	
すかいらーくホールディングス	19,800	1,618.00	32,036,400	
SFPホールディングス	900	1,463.00	1,316,700	
綿半ホールディングス	1,300	1,310.00	1,703,000	
ヨシックス	300	2,235.00	670,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,100	1,161.00	5,921,100	
ゴルフダイジェスト・オンライン	900	1,050.00	945,000	
B E E N O S	800	2,710.00	2,168,000	
あさひ	1,300	1,633.00	2,122,900	
日本調剤	1,100	1,671.00	1,838,100	
コスモス薬品	1,800	16,170.00	29,106,000	
トーエル	900	840.00	756,000	
オンリー	300	474.00	142,200	
セブン&アイ・ホールディングス	69,200	4,225.00	292,370,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	9,500	865.00	8,217,500	
ツルハホールディングス	3,900	14,700.00	57,330,000	
サンマルクホールディングス	1,400	1,579.00	2,210,600	
フェリシモ	400	1,307.00	522,800	
トリドールホールディングス	4,400	1,577.00	6,938,800	
T O K Y O B A S E	1,600	706.00	1,129,600	
ウイルプラスホールディングス	300	1,047.00	314,100	
J Mホールディングス	1,300	2,056.00	2,672,800	
サツドラホールディングス	300	2,064.00	619,200	
アレンザホールディングス	1,000	1,482.00	1,482,000	
串カツ田中ホールディングス	500	1,828.00	914,000	
パロックジャパンリミテッド	1,200	812.00	974,400	
クスリのアオキホールディングス	1,800	8,800.00	15,840,000	
力の源ホールディングス	800	611.00	488,800	
スシローグローバルホールディングス	9,700	4,420.00	42,874,000	
メディカルシステムネットワーク	1,500	745.00	1,117,500	
はるやまホールディングス	800	713.00	570,400	
ノジマ	3,100	2,799.00	8,676,900	
カッパ・クリエイト	2,500	1,510.00	3,775,000	
ライトオン	1,300	660.00	858,000	
ジーンズメイト	500	299.00	149,500	

良品計画	23,500	2,553.00	59,995,500
三城ホールディングス	2,200	315.00	693,000
アドヴァン	1,800	1,132.00	2,037,600
アルビス	600	2,488.00	1,492,800
コナカ	2,100	333.00	699,300
ハウス オブ ローゼ	200	1,707.00	341,400
G - 7ホールディングス	1,000	2,405.00	2,405,000
イオン北海道	2,300	1,057.00	2,431,100
コジマ	3,000	672.00	2,016,000
ヒマラヤ	600	972.00	583,200
コーナン商事	2,500	3,030.00	7,575,000
エコス	600	2,009.00	1,205,400
ワタミ	2,300	958.00	2,203,400
マルシェ	500	511.00	255,500
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	35,300	2,685.00	94,780,500
西松屋チェーン	3,900	1,505.00	5,869,500
ゼンショーホールディングス	9,500	2,914.00	27,683,000
幸楽苑ホールディングス	1,100	1,762.00	1,938,200
ハークスレイ	400	939.00	375,600
サイゼリヤ	2,600	2,133.00	5,545,800
V Tホールディングス	6,700	422.00	2,827,400
魚力	600	1,882.00	1,129,200
ポブラ	500	335.00	167,500
フジ・コーポレーション	500	2,284.00	1,142,000
ユナイテッドアローズ	2,000	1,971.00	3,942,000
ハイデイ日高	2,600	1,877.00	4,880,200
京都きもの友禅	1,100	241.00	265,100
コロワイド	5,900	1,964.00	11,587,600
ピーシーデポコーポレーション	2,100	579.00	1,215,900
壱番屋	1,200	5,170.00	6,204,000
トップカルチャー	600	353.00	211,800
P L A N T	500	768.00	384,000
スギホールディングス	3,500	7,350.00	25,725,000
薬王堂ホールディングス	800	2,759.00	2,207,200
ヴィア・ホールディングス	2,200	280.00	616,000

スクロール	2,500	1,356.00	3,390,000
ヨンドシーホールディングス	1,600	2,055.00	3,288,000
木曽路	2,300	2,392.00	5,501,600
S R S ホールディングス	2,200	869.00	1,911,800
千趣会	3,200	370.00	1,184,000
タカキュー	1,300	148.00	192,400
リテールパートナーズ	2,100	1,430.00	3,003,000
ケーヨー	3,300	758.00	2,501,400
上新電機	2,100	3,280.00	6,888,000
日本瓦斯	2,900	5,200.00	15,080,000
ロイヤルホールディングス	3,100	1,927.00	5,973,700
東天紅	100	950.00	95,000
いなげや	2,000	1,742.00	3,484,000
島忠	1,000	5,490.00	5,490,000
チヨダ	1,900	980.00	1,862,000
ライフコーポレーション	1,300	3,360.00	4,368,000
リンガーハット	2,200	2,509.00	5,519,800
MrMaxHD	2,400	787.00	1,888,800
テンアライド	1,600	359.00	574,400
AOKIホールディングス	3,500	599.00	2,096,500
オークワ	2,800	1,283.00	3,592,400
コメリ	2,700	2,917.00	7,875,900
青山商事	3,900	735.00	2,866,500
しまむら	2,100	11,670.00	24,507,000
はせがわ	900	291.00	261,900
高島屋	12,900	1,048.00	13,519,200
松屋	3,900	949.00	3,701,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,400	819.00	6,879,600
近鉄百貨店	700	3,465.00	2,425,500
丸井グループ	15,000	1,931.00	28,965,000
アクシアル リテイリング	1,500	5,040.00	7,560,000
井筒屋	800	272.00	217,600
イオン	68,000	3,580.00	243,440,000
イズミ	3,600	4,045.00	14,562,000
平和堂	3,300	2,225.00	7,342,500
フジ	2,100	2,072.00	4,351,200

ヤオコー	2,000	6,860.00	13,720,000	
ゼビオホールディングス	2,100	936.00	1,965,600	
ケースホールディングス	15,800	1,517.00	23,968,600	
Olympicグループ	900	927.00	834,300	
日産東京販売ホールディングス	2,600	267.00	694,200	
シルバーライフ	200	2,203.00	440,600	
一家ダイニングプロジェクト	300	618.00	185,400	
Genky DrugStores	800	3,885.00	3,108,000	
ナルミヤ・インターナショナル	300	955.00	286,500	
ブックオフグループホールディングス	1,000	878.00	878,000	
ギフト	200	2,089.00	417,800	
アインホールディングス	2,600	7,400.00	19,240,000	
元気寿司	500	2,517.00	1,258,500	
ヤマダホールディングス	59,300	545.00	32,318,500	
アークランドサカモト	2,800	1,658.00	4,642,400	
ニトリホールディングス	7,000	20,900.00	146,300,000	
グルメ杵屋	1,300	1,003.00	1,303,900	
愛眼	1,400	237.00	331,800	
ケーユーホールディングス	900	863.00	776,700	
吉野家ホールディングス	5,800	2,219.00	12,870,200	
松屋フーズホールディングス	900	3,700.00	3,330,000	
サガミホールディングス	2,400	1,208.00	2,899,200	
関西スーパーマーケット	1,300	1,170.00	1,521,000	
王将フードサービス	1,200	5,960.00	7,152,000	
プレナス	2,000	1,958.00	3,916,000	
ミニストップ	1,300	1,466.00	1,905,800	
アークス	3,400	2,399.00	8,156,600	
パローホールディングス	3,600	2,420.00	8,712,000	
藤久	400	824.00	329,600	
ベルク	900	5,900.00	5,310,000	
大庄	900	1,043.00	938,700	
ファーストリテイリング	2,400	99,460.00	238,704,000	
サンドラッグ	6,700	4,145.00	27,771,500	
サクスパー ホールディングス	1,500	577.00	865,500	
ヤマザワ	400	1,741.00	696,400	
やまや	400	2,257.00	902,800	

ペルーナ	3,300	1,044.00	3,445,200	
島根銀行	600	671.00	402,600	
じもとホールディングス	1,200	811.00	973,200	
めぶきフィナンシャルグループ	92,000	225.00	20,700,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,200	1,195.00	2,629,000	
九州フィナンシャルグループ	36,200	445.00	16,109,000	
ゆうちょ銀行	50,200	1,037.00	52,057,400	
富山第一銀行	4,200	300.00	1,260,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	107,900	404.00	43,591,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	11,800	706.00	8,330,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,300	601.00	4,387,300	
三十三フィナンシャルグループ	1,500	1,341.00	2,011,500	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,342.00	6,791,800	
ひろぎんホールディングス	26,100	647.00	16,886,700	
新生銀行	14,400	1,408.00	20,275,200	
あおぞら銀行	10,600	2,265.00	24,009,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,211,400	541.50	655,973,100	
りそなホールディングス	192,200	431.40	82,915,080	
三井住友トラスト・ホールディングス	33,500	3,536.00	118,456,000	
三井住友フィナンシャルグループ	122,600	3,688.00	452,148,800	
千葉銀行	59,100	649.00	38,355,900	
群馬銀行	36,400	339.00	12,339,600	
武蔵野銀行	2,600	1,608.00	4,180,800	
千葉興業銀行	4,500	252.00	1,134,000	
筑波銀行	7,300	187.00	1,365,100	
七十七銀行	5,600	1,418.00	7,940,800	
青森銀行	1,400	2,473.00	3,462,200	
秋田銀行	1,100	1,433.00	1,576,300	
山形銀行	2,000	1,072.00	2,144,000	
岩手銀行	1,200	2,082.00	2,498,400	
東邦銀行	15,800	212.00	3,349,600	
東北銀行	800	1,091.00	872,800	
みちのく銀行	1,100	1,065.00	1,171,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	16,000	2,043.00	32,688,000	
静岡銀行	43,100	806.00	34,738,600	
十六銀行	2,200	2,015.00	4,433,000	

スルガ銀行	15,500	357.00	5,533,500
八十二銀行	39,900	369.00	14,723,100
山梨中央銀行	2,100	877.00	1,841,700
大垣共立銀行	3,500	2,076.00	7,266,000
福井銀行	1,500	1,924.00	2,886,000
北國銀行	1,600	2,667.00	4,267,200
清水銀行	700	1,700.00	1,190,000
富山銀行	300	2,863.00	858,900
滋賀銀行	3,600	2,014.00	7,250,400
南都銀行	2,600	1,830.00	4,758,000
百五銀行	15,900	318.00	5,056,200
京都銀行	6,300	6,350.00	40,005,000
紀陽銀行	6,300	1,445.00	9,103,500
ほくほくフィナンシャルグループ	11,800	988.00	11,658,400
山陰合同銀行	11,200	504.00	5,644,800
中国銀行	15,200	874.00	13,284,800
鳥取銀行	600	1,121.00	672,600
伊予銀行	23,500	647.00	15,204,500
百十四銀行	1,900	1,584.00	3,009,600
四国銀行	2,500	726.00	1,815,000
阿波銀行	2,700	2,280.00	6,156,000
大分銀行	1,000	2,144.00	2,144,000
宮崎銀行	1,100	2,262.00	2,488,200
佐賀銀行	1,000	1,382.00	1,382,000
沖縄銀行	1,600	2,832.00	4,531,200
琉球銀行	3,800	780.00	2,964,000
セブン銀行	59,200	246.00	14,563,200
みずほフィナンシャルグループ	240,600	1,552.50	373,531,500
高知銀行	600	761.00	456,600
山口フィナンシャルグループ	22,100	650.00	14,365,000
長野銀行	600	1,320.00	792,000
名古屋銀行	1,400	2,780.00	3,892,000
北洋銀行	26,700	236.00	6,301,200
愛知銀行	600	2,978.00	1,786,800
中京銀行	600	1,835.00	1,101,000
大光銀行	600	1,315.00	789,000

愛媛銀行	2,500	982.00	2,455,000	
トマト銀行	700	1,060.00	742,000	
京葉銀行	7,600	430.00	3,268,000	
栃木銀行	8,500	183.00	1,555,500	
北日本銀行	600	1,961.00	1,176,600	
東和銀行	3,100	684.00	2,120,400	
福島銀行	2,000	232.00	464,000	
大東銀行	800	659.00	527,200	
トモニホールディングス	13,700	313.00	4,288,100	
フィデアホールディングス	17,200	120.00	2,064,000	
池田泉州ホールディングス	20,300	163.00	3,308,900	
F P G	5,500	600.00	3,300,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	900	1,263.00	1,136,700	
マーキュリアインベストメント	700	716.00	501,200	
S B Iホールディングス	21,700	3,215.00	69,765,500	
日本アジア投資	1,500	252.00	378,000	
ジャフコ グループ	2,700	6,790.00	18,333,000	
大和証券グループ本社	132,600	539.00	71,471,400	
野村ホールディングス	270,400	647.90	175,192,160	
岡三証券グループ	15,100	407.00	6,145,700	
丸三証券	5,300	617.00	3,270,100	
東洋証券	5,800	159.00	922,200	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,900	362.00	6,841,800	
光世証券	400	670.00	268,000	
水戸証券	4,700	289.00	1,358,300	
いちよし証券	3,500	590.00	2,065,000	
松井証券	8,700	916.00	7,969,200	
マネックスグループ	15,900	948.00	15,073,200	
極東証券	2,400	809.00	1,941,600	
岩井コスモホールディングス	1,800	1,552.00	2,793,600	
藍澤証券	3,200	892.00	2,854,400	
マネーパートナーズグループ	1,900	229.00	435,100	
スパークス・グループ	8,200	332.00	2,722,400	
小林洋行	500	280.00	140,000	
かんぽ生命保険	22,000	2,174.00	47,828,000	
S O M P Oホールディングス	31,200	4,285.00	133,692,000	

アニコム ホールディングス	5,000	1,162.00	5,810,000	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	43,000	3,199.00	137,557,000	
第一生命ホールディングス	93,600	1,875.50	175,546,800	
東京海上ホールディングス	58,700	5,560.00	326,372,000	
T & D ホールディングス	52,900	1,443.00	76,334,700	
アドバンスクリエイト	400	1,879.00	751,600	
全国保証	4,600	5,060.00	23,276,000	
ジェイリース	600	738.00	442,800	
イントラスト	500	748.00	374,000	
日本モーゲージサービス	900	1,163.00	1,046,700	
C a s a	500	1,010.00	505,000	
アルヒ	2,600	1,642.00	4,269,200	
プレミアグループ	800	2,347.00	1,877,600	
クレディセゾン	10,300	1,328.00	13,678,400	
芙蓉総合リース	1,900	7,440.00	14,136,000	
みずほリース	2,700	3,450.00	9,315,000	
東京センチュリー	4,100	7,930.00	32,513,000	
日本証券金融	7,500	616.00	4,620,000	
アイフル	29,700	278.00	8,256,600	
リコーリース	1,400	3,270.00	4,578,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,800	1,398.00	15,098,400	
アコム	35,600	471.00	16,767,600	
ジャックス	2,000	2,107.00	4,214,000	
オリエントコーポレーション	47,800	140.00	6,692,000	
日立キャピタル	4,200	2,963.00	12,444,600	
オリックス	109,900	1,746.50	191,940,350	
三菱U F J リース	40,000	588.00	23,520,000	
九州リースサービス	900	650.00	585,000	
日本取引所グループ	47,800	2,418.00	115,580,400	
イー・ギャランティ	2,000	2,391.00	4,782,000	
アサックス	900	747.00	672,300	
N E C キャピタルソリューション	700	2,039.00	1,427,300	
いちご	19,700	332.00	6,540,400	
日本駐車場開発	17,400	145.00	2,523,000	
スター・マイカ・ホールディングス	900	1,170.00	1,053,000	

S R Eホールディングス	200	5,060.00	1,012,000	
A Dワークスグループ	3,400	156.00	530,400	
ヒューリック	37,600	1,210.00	45,496,000	
三栄建築設計	700	1,827.00	1,278,900	
野村不動産ホールディングス	10,800	2,499.00	26,989,200	
三重交通グループホールディングス	3,600	508.00	1,828,800	
サムティ	2,500	1,791.00	4,477,500	
ディア・ライフ	2,500	428.00	1,070,000	
コーセーアールイー	500	605.00	302,500	
日本商業開発	1,100	1,692.00	1,861,200	
プレサンスコーポレーション	2,900	1,552.00	4,500,800	
T H Eグローバル社	1,100	280.00	308,000	
ハウスコム	300	1,320.00	396,000	
日本管理センター	1,000	1,227.00	1,227,000	
サンセイランディック	500	765.00	382,500	
エストラスト	200	716.00	143,200	
フージャースホールディングス	2,900	690.00	2,001,000	
オープンハウス	5,600	4,250.00	23,800,000	
東急不動産ホールディングス	48,200	692.00	33,354,400	
飯田グループホールディングス	14,800	2,419.00	35,801,200	
イーランド	300	865.00	259,500	
ムゲンエステート	1,100	496.00	545,600	
ビーロッド	800	660.00	528,000	
ファーストブラザーズ	300	997.00	299,100	
ハウズドゥ	900	1,163.00	1,046,700	
シーアールイー	500	1,241.00	620,500	
プロパティエージェント	300	1,484.00	445,200	
ケイアイスター不動産	600	3,785.00	2,271,000	
アグレ都市デザイン	300	782.00	234,600	
グッドコムアセット	800	1,333.00	1,066,400	
ジェイ・エス・ビー	300	3,490.00	1,047,000	
テンポイノベーション	500	911.00	455,500	
グローバル・リンク・マネジメント	300	821.00	246,300	
パーク24	9,500	2,337.00	22,201,500	
パラカ	500	1,662.00	831,000	
三井不動産	80,700	2,434.50	196,464,150	

三菱地所	116,300	1,885.50	219,283,650
平和不動産	3,000	3,780.00	11,340,000
東京建物	17,500	1,630.00	28,525,000
ダイビル	4,600	1,320.00	6,072,000
京阪神ビルディング	3,100	1,562.00	4,842,200
住友不動産	39,800	3,636.00	144,712,800
テオーシー	3,500	790.00	2,765,000
東京楽天地	300	4,370.00	1,311,000
レオパレス21	14,700	137.00	2,013,900
スターツコーポレーション	2,100	2,902.00	6,094,200
フジ住宅	2,100	672.00	1,411,200
空港施設	1,800	525.00	945,000
明和地所	800	643.00	514,400
ゴールドクレスト	1,600	1,768.00	2,828,800
エスリード	700	1,588.00	1,111,600
日神グループホールディングス	2,600	441.00	1,146,600
日本エスコン	3,200	785.00	2,512,000
タカラレーベン	7,400	343.00	2,538,200
A V A N T I A	1,000	891.00	891,000
イオンモール	8,900	1,919.00	17,079,100
毎日コムネット	500	693.00	346,500
ファースト住建	800	1,116.00	892,800
ランド	96,200	9.00	865,800
カチタス	4,400	3,195.00	14,058,000
トーセイ	2,400	1,063.00	2,551,200
穴吹興産	400	1,722.00	688,800
サンフロンティア不動産	2,200	930.00	2,046,000
エフ・ジェー・ネクスト	1,700	1,161.00	1,973,700
インテリックス	400	560.00	224,000
ランドビジネス	600	343.00	205,800
サンネクスタグループ	600	992.00	595,200
グランディハウス	1,200	466.00	559,200
日本空港ビルディング	5,700	5,270.00	30,039,000
明豊ファシリティワークス	800	638.00	510,400
日本工営	1,100	2,931.00	3,224,100
L I F U L L	6,000	423.00	2,538,000

ミクシィ	3,300	2,620.00	8,646,000
ジェイエイシーリクルートメント	1,200	1,850.00	2,220,000
日本M&Aセンター	14,100	6,210.00	87,561,000
メンバーズ	500	2,631.00	1,315,500
中広	200	341.00	68,200
UTグループ	2,500	3,385.00	8,462,500
アイティメディア	600	2,053.00	1,231,800
タケエイ	1,900	1,322.00	2,511,800
E・Jホールディングス	700	1,026.00	718,200
ビーネックスグループ	2,200	1,266.00	2,785,200
コシダカホールディングス	4,100	512.00	2,099,200
アルトナー	400	902.00	360,800
パソナグループ	1,900	1,978.00	3,758,200
CDS	400	1,427.00	570,800
リンクアンドモチベーション	3,200	566.00	1,811,200
GCA	2,200	770.00	1,694,000
エス・エム・エス	5,800	3,855.00	22,359,000
サニーサイドアップグループ	600	712.00	427,200
パーソルホールディングス	17,200	2,278.00	39,181,600
リニカル	1,000	774.00	774,000
クックパッド	5,400	317.00	1,711,800
エスクリ	500	371.00	185,500
アイ・ケイ・ケイ	800	627.00	501,600
学情	600	1,403.00	841,800
スタジオアリス	900	2,088.00	1,879,200
シミックホールディングス	800	1,706.00	1,364,800
エプコ	400	966.00	386,400
NJS	400	1,952.00	780,800
総合警備保障	6,800	5,170.00	35,156,000
カカコム	12,700	3,600.00	45,720,000
アイロムグループ	600	2,009.00	1,205,400
セントケア・ホールディング	1,300	978.00	1,271,400
サイネックス	300	715.00	214,500
ルネサンス	1,100	1,135.00	1,248,500
ディップ	2,700	3,100.00	8,370,000
デジタルホールディングス	1,200	2,003.00	2,403,600

新日本科学	2,100	680.00	1,428,000	
ツクイホールディングス	4,000	924.00	3,696,000	
キャリアデザインセンター	400	915.00	366,000	
ベネフィット・ワン	6,200	3,035.00	18,817,000	
エムスリー	30,300	9,003.00	272,790,900	
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	342.00	478,800	
プラス	200	481.00	96,200	
アウトソーシング	9,800	1,570.00	15,386,000	
ウェルネット	1,700	492.00	836,400	
ワールドホールディングス	600	2,270.00	1,362,000	
ディー・エヌ・エー	7,300	2,134.00	15,578,200	
博報堂D Yホールディングス	23,900	1,788.00	42,733,200	
ぐるなび	3,000	607.00	1,821,000	
タカミヤ	2,100	535.00	1,123,500	
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	940.00	1,316,000	
ファンコミュニケーションズ	4,700	413.00	1,941,100	
ライク	500	1,941.00	970,500	
ビジネス・ブレークスルー	700	448.00	313,600	
エスプール	4,400	1,016.00	4,470,400	
W D Bホールディングス	800	2,781.00	2,224,800	
手間いらず	200	5,170.00	1,034,000	
ティア	1,000	454.00	454,000	
C D G	200	1,558.00	311,600	
アドウェイズ	2,100	643.00	1,350,300	
バリューコマース	1,200	3,340.00	4,008,000	
インフォマート	17,400	1,011.00	17,591,400	
J Pホールディングス	4,900	295.00	1,445,500	
エコナックホールディングス	3,100	95.00	294,500	
E P Sホールディングス	2,300	1,220.00	2,806,000	
レッグス	400	1,705.00	682,000	
プレステージ・インターナショナル	6,400	791.00	5,062,400	
アミューズ	900	2,640.00	2,376,000	
ドリームインキュベータ	500	1,186.00	593,000	
クイック	1,100	1,232.00	1,355,200	
T A C	900	269.00	242,100	
ケネディクス	4,300	748.00	3,216,400	

電通グループ	19,300	3,800.00	73,340,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	655.00	524,000	
ぴあ	500	3,175.00	1,587,500	
イオンファンタジー	700	2,410.00	1,687,000	
シーティーエス	1,900	927.00	1,761,300	
ネクシィーズグループ	500	989.00	494,500	
H.U.グループホールディングス	4,800	3,330.00	15,984,000	
アルプス技研	1,500	2,097.00	3,145,500	
サニックス	2,700	315.00	850,500	
ダイオーズ	300	995.00	298,500	
日本空調サービス	1,800	743.00	1,337,400	
オリエンタルランド	18,200	17,765.00	323,323,000	
ダスキン	4,000	2,881.00	11,524,000	
明光ネットワークジャパン	2,200	588.00	1,293,600	
ファルコホールディングス	800	1,635.00	1,308,000	
秀英予備校	400	435.00	174,000	
田谷	300	572.00	171,600	
ラウンドワン	5,900	1,079.00	6,366,100	
リゾートトラスト	7,900	1,724.00	13,619,600	
ピー・エム・エル	2,200	3,845.00	8,459,000	
ワタベウェディング	200	304.00	60,800	
りらいあコミュニケーションズ	2,600	1,401.00	3,642,600	
リソー教育	8,700	347.00	3,018,900	
早稲田アカデミー	700	1,002.00	701,400	
ユー・エス・エス	19,200	2,069.00	39,724,800	
東京個別指導学院	1,500	685.00	1,027,500	
サイバーエージェント	10,600	7,080.00	75,048,000	
楽天	80,000	1,110.00	88,800,000	
クリーク・アンド・リバー社	900	1,240.00	1,116,000	
モーニングスター	1,900	497.00	944,300	
テー・オー・ダブリュー	3,000	304.00	912,000	
山田コンサルティンググループ	1,000	1,056.00	1,056,000	
セントラルスポーツ	600	2,404.00	1,442,400	
フルキャストホールディングス	1,500	1,917.00	2,875,500	
エン・ジャパン	3,000	3,440.00	10,320,000	
リソルホールディングス	200	4,125.00	825,000	

テクノプロ・ホールディングス	3,400	8,320.00	28,288,000	
アトラ	400	343.00	137,200	
インターワークス	500	382.00	191,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	15,020.00	10,514,000	
K e e P e r 技研	1,100	1,893.00	2,082,300	
ファーストロジック	300	808.00	242,400	
三機サービス	300	999.00	299,700	
G u n o s y	1,100	800.00	880,000	
デザインワン・ジャパン	500	217.00	108,500	
イー・ガーディアン	800	3,415.00	2,732,000	
リブセンス	900	237.00	213,300	
ジャパンマテリアル	5,300	1,519.00	8,050,700	
ベクトル	2,100	1,311.00	2,753,100	
ウチヤマホールディングス	800	367.00	293,600	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,403.00	1,823,900	
キャリアリンク	600	3,120.00	1,872,000	
I B J	1,400	1,063.00	1,488,200	
アサンテ	600	1,738.00	1,042,800	
N・フィールド	1,200	1,198.00	1,437,600	
バリューHR	700	1,778.00	1,244,600	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,400	4,995.00	6,993,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,871.00	1,309,700	
E R Iホールディングス	500	640.00	320,000	
アビスト	300	2,989.00	896,700	
シグマクシス	900	1,900.00	1,710,000	
ウィルグループ	1,300	1,020.00	1,326,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,500	292.00	730,000	
メドピア	800	7,310.00	5,848,000	
レアジョブ	200	2,186.00	437,200	
リクルートホールディングス	122,900	5,142.00	631,951,800	
エラン	2,400	1,537.00	3,688,800	
土木管理総合試験所	800	351.00	280,800	
ネットマーケティング	800	590.00	472,000	
日本郵政	129,800	905.30	117,507,940	
ベルシステム24ホールディングス	2,900	1,870.00	5,423,000	
鎌倉新書	1,700	929.00	1,579,300	

S MN	400	772.00	308,800	
一蔵	200	385.00	77,000	
L I T A L I C O	700	3,850.00	2,695,000	
グローバルキッズCOMPANY	300	890.00	267,000	
エアトリ	900	1,841.00	1,656,900	
アトラエ	500	3,495.00	1,747,500	
ストライク	600	4,715.00	2,829,000	
ソラスト	4,200	1,616.00	6,787,200	
セラク	500	1,800.00	900,000	
インソース	1,400	2,247.00	3,145,800	
ベイカレント・コンサルティング	1,100	20,210.00	22,231,000	
Orchestra Holdings	400	2,784.00	1,113,600	
アイモバイル	600	1,288.00	772,800	
キャリアインデックス	700	596.00	417,200	
MS - Japan	700	1,144.00	800,800	
船場	300	877.00	263,100	
グレイステクノロジー	900	6,090.00	5,481,000	
ジャパンエレベーターサービส์ホールディングス	4,900	2,316.00	11,348,400	
フルテック	200	1,412.00	282,400	
グリーンズ	600	505.00	303,000	
ツナググループ・ホールディングス	300	380.00	114,000	
GameWith	500	580.00	290,000	
ソウルドアウト	400	1,686.00	674,400	
MS&Consulting	300	594.00	178,200	
エル・ティー・エス	100	3,930.00	393,000	
ミダック	400	3,605.00	1,442,000	
日総工産	1,300	842.00	1,094,600	
キュービーネットホールディングス	800	1,672.00	1,337,600	
RPAホールディングス	2,000	659.00	1,318,000	
スプリックス	500	843.00	421,500	
マネジメントソリューションズ	800	1,884.00	1,507,200	
プロレド・パートナーズ	200	3,635.00	727,000	
and factory	200	750.00	150,000	
テノ・ホールディングス	100	1,103.00	110,300	
フロンティア・マネジメント	300	2,178.00	653,400	

ピアラ	100	1,905.00	190,500
コプロ・ホールディングス	100	3,025.00	302,500
ギークス	200	1,546.00	309,200
カーブスホールディングス	4,700	981.00	4,610,700
フォーラムエンジニアリング	900	1,017.00	915,300
ダイレクトマーケティングミックス	700	2,888.00	2,021,600
ポピンズホールディングス	300	2,902.00	870,600
アドバンテッジリスクマネジメント	900	766.00	689,400
リログループ	9,400	2,529.00	23,772,600
東祥	1,100	1,728.00	1,900,800
エイチ・アイ・エス	2,500	2,084.00	5,210,000
ラックランド	500	2,409.00	1,204,500
共立メンテナンス	2,800	3,745.00	10,486,000
イチネンホールディングス	1,800	1,365.00	2,457,000
建設技術研究所	1,100	2,418.00	2,659,800
スペース	1,100	882.00	970,200
長大	700	1,531.00	1,071,700
燦ホールディングス	700	1,158.00	810,600
スバル興業	100	8,330.00	833,000
東京テアトル	700	1,314.00	919,800
タナベ経営	300	1,442.00	432,600
ナガワ	500	11,990.00	5,995,000
よみうりランド	100	6,030.00	603,000
東京都競馬	1,100	4,815.00	5,296,500
常磐興産	700	1,398.00	978,600
カナモト	3,000	2,412.00	7,236,000
東京ドーム	6,000	1,298.00	7,788,000
西尾レントオール	1,600	2,604.00	4,166,400
アゴーラ・ホスピタリティ・グループ	9,400	28.00	263,200
トランス・コスモス	1,600	2,878.00	4,604,800
乃村工藝社	7,400	829.00	6,134,600
藤田観光	700	1,699.00	1,189,300
KNT-CTホールディングス	900	993.00	893,700
日本管財	1,800	2,140.00	3,852,000
トーカイ	1,700	2,292.00	3,896,400
白洋舎	200	2,398.00	479,600

セコム	16,900	10,080.00	170,352,000	
セントラル警備保障	800	3,525.00	2,820,000	
丹青社	3,200	809.00	2,588,800	
メイテック	2,100	5,570.00	11,697,000	
応用地質	2,000	1,318.00	2,636,000	
船井総研ホールディングス	3,500	2,464.00	8,624,000	
進学会ホールディングス	700	469.00	328,300	
オオバ	1,200	755.00	906,000	
いであ	400	1,796.00	718,400	
学究社	500	1,333.00	666,500	
ベネッセホールディングス	6,300	2,190.00	13,797,000	
イオンディライト	2,100	3,125.00	6,562,500	
ナック	800	994.00	795,200	
ダイセキ	2,900	3,485.00	10,106,500	
ステップ	600	1,540.00	924,000	
合 計	18,842,600		48,026,072,740	

(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)

2021年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	8,125,712,095
コール・ローン	62,594,461
株式	69,644,174,443
投資証券	1,522,929,241
派生商品評価勘定	465,599,861
未収入金	20,087
未収配当金	50,939,200
差入委託証拠金	3,942,294,621
流動資産合計	83,814,264,009
資産合計	
83,814,264,009	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	583,161
未払解約金	192,798,000
未払利息	169
流動負債合計	193,381,330
負債合計	
193,381,330	
純資産の部	
元本等	
元本	51,179,155,054
剰余金	
剰余金又は欠損金()	32,441,727,625
元本等合計	83,620,882,679
純資産合計	
83,620,882,679	
負債純資産合計	
83,814,264,009	

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>

5.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。 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 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	29,751,592,894円
期中追加設定元本額	50,921,330,862円
期中一部解約元本額	29,493,768,702円
期末元本額	51,179,155,054円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,251,067,348円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,327,806,653円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,225,264,663円
DCりそな グローバルバランス	22,412,904円
つみたてバランスファンド	1,510,575,221円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	850,887,783円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	433,739,207円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	261,713,779円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	44,213,842円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	30,508,641円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	15,130,886円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	21,576,963円
リスクコントロール・オープン	45,637,752円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	253,963,940円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	98,961,916円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	21,984,748,661円
Smart-i 先進国株式インデックス	4,408,872,974円
Smart-i 8資産バランス 安定型	137,307,364円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	323,189,851円
Smart-i 8資産バランス 成長型	342,982,437円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,985,929,421円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,187,985,170円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,384,367,811円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	849,238,776円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,792,962,443円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	299,521,219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)	5,351,072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)	223,644,665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	51,179,155,054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	1.6339円
(10,000口当たり純資産額)	(16,339円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<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

2021年 2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<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>
2. 時価の算定方法	<p>株式、投資証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>デリバティブ取引</p> <p>(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</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>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 2月15日現在

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		1,510,324,256
投資証券		42,215,161
合計		1,552,539,417

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2021年 2月15日現在)

(単位 : 円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	11,900,029,986	-	12,365,629,847	465,599,861
合計		11,900,029,986	-	12,365,629,847	465,599,861

(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 2月15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	132,187,779	-	132,770,940	583,161
	米ドル	87,751,320	-	88,082,180	330,860
	カナダドル	2,307,760	-	2,319,240	11,480
	ユーロ	15,983,912	-	16,057,440	73,528
	英ポンド	10,840,525	-	10,938,000	97,475
	スイスフラン	7,864,735	-	7,895,950	31,215
	スウェーデンクローナ	2,627,339	-	2,645,940	18,601
	デンマーククローネ	2,783,388	-	2,792,190	8,802
	オーストラリアドル	2,028,800	-	2,040,000	11,200
合計		132,187,779	-	132,770,940	583,161

(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	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	22.70	163,099.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	5,423	18.23	98,861.29	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	67.62	169,996.68	
	CHEVRON CORP	26,491	92.55	2,451,742.05	
	CONOCOPHILLIPS	18,076	47.16	852,464.16	
	DEVON ENERGY CORP	8,400	19.98	167,832.00	
	EOG RESOURCES INC	7,783	61.02	474,918.66	
	EXXON MOBIL CORP	58,218	50.52	2,941,173.36	
	HALLIBURTON CO	11,937	20.17	240,769.29	
	HESS CORP	4,079	60.00	244,740.00	
	KINDER MORGAN INC	27,151	14.84	402,920.84	
	MARATHON PETROLEUM CORP	8,739	50.46	440,969.94	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	13,724	25.39	348,452.36	
	ONEOK INC	6,554	45.11	295,650.94	
	PHILLIPS 66	5,838	77.23	450,868.74	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,424	132.29	320,670.96	
	SCHLUMBERGER LTD	18,563	26.77	496,931.51	
	VALERO ENERGY CORP	5,488	64.74	355,293.12	
	WILLIAMS COS INC	16,239	22.84	370,898.76	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,096	260.55	806,662.80	
	ALBEMARLE CORP	1,582	164.64	260,460.48	
	AMCOR PLC	23,330	11.50	268,295.00	
	AVERY DENNISON CORP	928	177.23	164,469.44	
	AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	27.24	45,926.64	
	BALL CORP	4,409	89.68	395,399.12	
CELANESE CORP	1,759	132.73	233,472.07		
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	44.36	131,172.52		
CORTEVA INC	10,203	44.37	452,707.11		

CROWN HOLDINGS INC	1,510	98.96	149,429.60
DOW INC	9,910	58.15	576,266.50
DUPONT DE NEMOURS INC	7,359	71.47	525,947.73
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	109.23	205,243.17
ECOLAB INC	3,609	219.88	793,546.92
FMC CORP	1,927	107.68	207,499.36
FREEMPORT-MCMORAN INC	19,809	31.23	618,635.07
INTERNATIONAL PAPER CO	5,534	49.18	272,162.12
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,032	134.06	406,469.92
LINDE PLC	7,260	252.68	1,834,456.80
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,676	96.14	353,410.64
MARTIN MARIETTA MATERIALS	926	330.83	306,348.58
MOSAIC CO/THE	3,288	29.27	96,239.76
NEWMONT CORP	10,613	58.94	625,530.22
NUCOR CORP	4,490	56.34	252,966.60
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	133.18	174,732.16
PPG INDUSTRIES INC	3,178	138.55	440,311.90
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	86.80	125,512.80
SEALED AIR CORP	1,397	44.09	61,593.73
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1,149	721.05	828,486.45
STEEL DYNAMICS INC	2,352	39.33	92,504.16
VULCAN MATERIALS CO	1,832	164.50	301,364.00
WESTROCK CO	3,862	44.24	170,854.88
3M CO	7,994	178.70	1,428,527.80
ALLEGION PLC	1,026	118.26	121,334.76
AMETEK INC	3,087	121.75	375,842.25
BOEING CO/THE	7,426	210.98	1,566,737.48
CARRIER GLOBAL CORP	11,040	37.28	411,571.20
CATERPILLAR INC	7,524	197.99	1,489,676.76
CUMMINS INC	1,966	243.97	479,645.02
DEERE & CO	4,154	313.00	1,300,202.00
DOVER CORP	2,147	122.73	263,501.31
EATON CORP PLC	5,290	123.98	655,854.20
EMERSON ELECTRIC CO	7,898	85.33	673,936.34
FASTENAL CO	7,657	47.39	362,865.23

FORTIVE CORP	4,092	71.52	292,659.84
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	89.84	169,078.88
GENERAC HOLDINGS INC	936	326.84	305,922.24
GENERAL DYNAMICS CORP	3,232	164.83	532,730.56
GENERAL ELECTRIC CO	121,691	11.73	1,427,435.43
HEICO CORP	647	128.54	83,165.38
HEICO CORP-CLASS A	819	116.13	95,110.47
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,692	203.57	1,973,000.44
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	28.28	165,551.12
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	176.13	106,382.52
IDEX CORP	1,126	199.87	225,053.62
ILLINOIS TOOL WORKS	4,425	200.98	889,336.50
INGERSOLL-RAND INC	5,287	43.92	232,205.04
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	114.90	203,947.50
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	54.20	151,760.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,300	25.29	58,167.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,914	53.58	531,192.12
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,858	185.92	531,359.36
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	292.86	137,644.20
LOCKHEED MARTIN CORP	3,495	337.73	1,180,366.35
MASCO CORP	3,079	54.95	169,191.05
NORDSON CORP	746	188.27	140,449.42
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,082	297.36	619,103.52
OTIS WORLDWIDE CORP	5,512	63.93	352,382.16
OWENS CORNING	1,611	85.75	138,143.25
PACCAR INC	4,610	98.00	451,780.00
PARKER HANNIFIN CORP	1,716	276.24	474,027.84
PENTAIR PLC	2,474	53.63	132,680.62
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	21,167	72.61	1,536,935.87
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,550	249.18	386,229.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,378	396.02	545,715.56
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	58.40	98,228.80
SMITH (A.O.) CORP	1,507	60.37	90,977.59
SNAP-ON INC	772	189.95	146,641.40
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,069	175.57	363,254.33

SUNRUN INC	1,550	83.68	129,704.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	550	387.91	213,350.50
TEXTRON INC	3,103	50.89	157,911.67
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,195	150.93	482,221.35
TRANSDIGM GROUP INC	689	576.49	397,201.61
UNITED RENTALS INC	983	286.22	281,354.26
WABTEC CORP	2,696	80.53	217,108.88
WW GRAINGER INC	677	372.08	251,898.16
XYLEM INC	2,684	99.12	266,038.08
CINTAS CORP	1,181	342.44	404,421.64
COPART INC	2,853	119.42	340,719.52
COSTAR GROUP INC	524	939.76	492,434.24
EQUIFAX INC	1,644	177.19	291,300.36
IHS MARKIT LTD	5,054	93.59	473,003.86
REPUBLIC SERVICES INC	3,015	91.26	275,148.90
ROBERT HALF INTL INC	1,565	73.78	115,465.70
ROLLINS INC	3,021	37.59	113,559.39
TRANSUNION	2,592	95.06	246,395.52
VERISK ANALYTICS INC	2,060	189.50	390,370.00
WASTE CONNECTIONS INC	3,522	99.36	349,945.92
WASTE MANAGEMENT INC	5,564	113.25	630,123.00
AMERCO	106	500.24	53,025.44
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	91.30	135,671.80
CSX CORP	10,702	90.14	964,678.28
DELTA AIR LINES INC	1,316	43.29	56,969.64
EXPEDITORS INTL WASH INC	2,507	96.58	242,126.06
FEDEX CORP	3,480	263.00	915,240.00
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	148.32	172,941.12
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	209.31	274,824.03
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	43.34	45,246.96
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,384	254.84	862,378.56
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,297	212.21	275,236.37
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	51.34	113,204.70
UBER TECHNOLOGIES INC	12,797	60.63	775,882.11
UNION PACIFIC CORP	9,382	213.16	1,999,867.12

UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,792	163.39	1,599,914.88
XPO LOGISTICS INC	977	121.31	118,519.87
APTIV PLC	3,602	156.29	562,956.58
AUTOLIV INC	743	94.27	70,042.61
BORGWARNER INC	3,548	41.99	148,980.52
FORD MOTOR CO	52,187	11.45	597,541.15
GENERAL MOTORS CO	17,042	53.60	913,451.20
LEAR CORP	775	159.67	123,744.25
TESLA INC	10,210	816.12	8,332,585.20
DR HORTON INC	4,656	82.18	382,630.08
GARMIN LTD	1,968	130.70	257,217.60
HASBRO INC	1,788	91.48	163,566.24
LENNAR CORP-A	3,733	92.58	345,601.14
LULULEMON ATHLETICA INC	1,638	342.86	561,604.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	169.28	95,473.92
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	24.19	133,867.46
NIKE INC -CL B	17,217	142.12	2,446,880.04
NVR INC	54	4,700.02	253,801.08
PELOTON INTERACTIVE INC-A	2,689	154.67	415,907.63
PULTEGROUP INC	3,683	48.48	178,551.84
VF CORP	4,481	79.51	356,284.31
WHIRLPOOL CORP	714	199.93	142,750.02
ARAMARK	2,216	36.00	79,776.00
CARNIVAL CORP	6,635	20.60	136,681.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	355	1,527.70	542,333.50
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	128.45	230,696.20
DOMINO'S PIZZA INC	590	385.17	227,250.30
DRAFTKINGS INC - CL A	2,552	61.07	155,850.64
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,758	112.14	421,422.12
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	56.02	287,102.50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,715	129.48	481,018.20
MCDONALD'S CORP	10,270	213.90	2,196,753.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	17.80	64,080.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	35.93	252,480.11
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,461	67.63	166,437.43

STARBUCKS CORP	16,209	105.30	1,706,807.70
VAIL RESORTS INC	557	287.37	160,065.09
WYNN RESORTS LTD	1,017	117.85	119,853.45
YUM! BRANDS INC	4,053	105.47	427,469.91
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,874	103.81	1,128,829.94
ALPHABET INC-CL A	4,117	2,095.03	8,625,238.51
ALPHABET INC-CL C	4,114	2,104.11	8,656,308.54
ALTICE USA INC- A	4,447	34.60	153,866.20
CABLE ONE INC	68	2,056.79	139,861.72
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,998	613.45	1,225,673.10
COMCAST CORP-CLASS A	62,734	53.23	3,339,330.82
DISCOVERY INC - A	1,722	47.80	82,311.60
DISCOVERY INC-C	3,336	40.75	135,942.00
DISH NETWORK CORP-A	3,674	31.36	115,216.64
ELECTRONIC ARTS INC	3,889	147.74	574,560.86
FACEBOOK INC-A	32,918	270.50	8,904,319.00
FOX CORP - CLASS A	3,877	32.59	126,351.43
FOX CORP- CLASS B	1,836	31.45	57,742.20
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	262.35	295,406.10
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	24.63	144,676.62
LIBERTY BROADBAND-A	223	146.67	32,707.41
LIBERTY BROADBAND-C	2,173	149.61	325,102.53
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	45.47	97,896.91
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	42.96	75,480.72
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	43.57	41,217.22
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	84.17	206,637.35
MATCH GROUP INC	3,380	169.53	573,011.40
NETFLIX INC	6,074	556.52	3,380,302.48
NEWS CORP - CLASS A	5,861	23.72	139,022.92
OMNICOM GROUP	3,237	66.25	214,451.25
PINTEREST INC- CLASS A	6,698	84.04	562,899.92
ROKU INC	1,447	468.67	678,165.49
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.09	63,256.83
SNAP INC - A	12,546	61.97	777,475.62
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,602	199.86	320,175.72

TWITTER INC	10,694	71.90	768,898.60
VIACOMCBS INC - CLASS B	8,010	58.31	467,063.10
WALT DISNEY CO/THE	24,844	187.67	4,662,473.48
ZILLOW GROUP INC - A	904	202.94	183,457.76
ZILLOW GROUP INC - C	1,987	197.81	393,048.47
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	152.81	143,182.97
AMAZON.COM INC	5,817	3,277.71	19,066,439.07
AUTOZONE INC	311	1,146.65	356,608.15
BEST BUY CO INC	3,104	120.51	374,063.04
BOOKING HOLDINGS INC	566	2,150.58	1,217,228.28
BURLINGTON STORES INC	893	262.66	234,555.38
CARMAX INC	2,353	125.10	294,360.30
CARVANA CO	902	296.05	267,037.10
CHEWY INC - CLASS A	1,090	118.69	129,372.10
DOLLAR GENERAL CORP	3,308	198.60	656,968.80
DOLLAR TREE INC	3,180	108.37	344,632.50
EBAY INC	9,836	63.01	619,766.36
ETSY INC	1,722	233.86	402,706.92
EXPEDIA GROUP INC	1,958	146.51	286,866.58
GENUINE PARTS CO	1,957	99.32	194,369.24
HOME DEPOT INC	14,748	277.51	4,092,717.48
LKQ CORP	2,845	36.92	105,037.40
LOWE'S COS INC	10,409	177.16	1,844,058.44
MERCADOLIBRE INC	587	1,943.00	1,140,541.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	983	433.05	425,688.15
POOL CORP	578	337.84	195,271.52
ROSS STORES INC	4,714	119.09	561,390.26
TARGET CORP	6,913	191.43	1,323,355.59
TJX COMPANIES INC	16,596	68.00	1,128,528.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,677	159.93	268,202.61
ULTA BEAUTY INC	726	319.88	232,232.88
WAYFAIR INC- CLASS A	864	292.97	253,126.08
COSTCO WHOLESALE CORP	6,083	352.75	2,145,778.25
KROGER CO	10,508	33.95	356,746.60
SYSCO CORP	6,442	76.24	491,138.08

WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,956	50.38	501,583.28
WALMART INC	19,472	144.47	2,813,119.84
ALTRIA GROUP INC	25,841	43.40	1,121,499.40
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,379	55.72	411,157.88
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,118	76.85	316,468.30
BUNGE LTD	1,423	78.00	110,994.00
CAMPBELL SOUP CO	1,995	46.75	93,266.25
COCA-COLA CO/THE	56,069	50.69	2,842,137.61
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,797	51.42	143,821.74
CONAGRA BRANDS INC	6,526	34.55	225,473.30
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,218	241.27	535,136.86
GENERAL MILLS INC	7,972	57.12	455,360.64
HERSHEY CO/THE	1,965	151.38	297,461.70
HORMEL FOODS CORP	4,355	48.24	210,085.20
JM SMUCKER CO/THE	1,257	115.10	144,680.70
KELLOGG CO	3,449	57.38	197,903.62
KEURIG DR PEPPER INC	8,271	31.77	262,769.67
KRAFT HEINZ CO/THE	8,943	35.39	316,492.77
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	77.16	164,736.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,284	89.65	294,410.60
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	44.01	123,007.95
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	19,830	55.19	1,094,417.70
MONSTER BEVERAGE CORP	5,211	91.73	478,005.03
PEPSICO INC	19,035	133.87	2,548,215.45
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21,507	86.12	1,852,182.84
TYSON FOODS INC-CL A	3,944	65.56	258,568.64
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	82.94	267,315.62
CLOROX COMPANY	1,647	185.97	306,292.59
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,289	78.43	885,396.27
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,127	290.25	907,611.75
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	132.13	585,203.77
PROCTER & GAMBLE CO/THE	34,093	127.62	4,350,948.66
ABBOTT LABORATORIES	24,356	128.23	3,123,169.88
ABIOMED INC	494	328.36	162,209.84
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,007	609.58	613,847.06

AMERISOURCEBERGEN CORP	2,255	105.18	237,180.90
ANTHEM INC	3,497	290.68	1,016,507.96
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,716	78.73	528,750.68
BECTON DICKINSON AND CO	4,044	256.32	1,036,558.08
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,762	38.39	720,273.18
CARDINAL HEALTH INC	4,308	51.86	223,412.88
CENTENE CORP	7,685	59.20	454,952.00
CERNER CORP	4,098	74.95	307,145.10
CIGNA CORP	5,108	206.93	1,056,998.44
COOPER COS INC/THE	727	385.40	280,185.80
CVS HEALTH CORP	18,157	74.21	1,347,430.97
DANAHER CORP	8,807	245.90	2,165,641.30
DAVITA INC	1,175	104.99	123,363.25
DENTSPLY SIRONA INC	3,218	55.35	178,116.30
DEXCOM INC	1,222	412.56	504,148.32
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,153	87.65	714,610.45
HCA HEALTHCARE INC	3,581	173.51	621,339.31
HENRY SCHEIN INC	2,103	69.46	146,074.38
HOLOGIC INC	3,815	82.98	316,568.70
HUMANA INC	1,738	380.64	661,552.32
IDEXX LABORATORIES INC	1,129	544.08	614,266.32
INSULET CORP	967	289.77	280,207.59
INTUITIVE SURGICAL INC	1,625	807.81	1,312,691.25
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,325	238.26	315,694.50
MASIMO CORP	701	275.72	193,279.72
MCKESSON CORP	2,170	182.24	395,460.80
MEDTRONIC PLC	18,512	119.74	2,216,626.88
MOLINA HEALTHCARE INC	807	216.28	174,537.96
NOVOCURE LTD	1,266	189.65	240,096.90
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,978	126.02	249,267.56
RESMED INC	1,937	200.55	388,465.35
STERIS PLC	1,157	183.00	211,731.00
STRYKER CORP	4,699	248.15	1,166,056.85
TELADOC HEALTH INC	1,474	293.66	432,854.84
TELEFLEX INC	632	406.19	256,712.08

UNITEDHEALTH GROUP INC	13,033	328.24	4,277,951.92
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	129.28	136,778.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,342	176.12	236,353.04
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,787	318.03	568,319.61
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	995	294.01	292,539.95
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,759	161.38	445,247.42
10X GENOMICS INC-CLASS A	892	196.86	175,599.12
ABBVIE INC	24,246	104.44	2,532,252.24
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,121	127.98	527,405.58
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,965	158.39	469,626.35
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,684	157.92	265,937.28
AMGEN INC	8,068	237.21	1,913,810.28
AVANTOR INC	6,265	30.67	192,147.55
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	662.35	162,938.10
BIOGEN INC	2,151	278.03	598,042.53
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	87.04	229,263.36
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	31,024	59.99	1,861,129.76
CATALENT INC	2,108	125.27	264,069.16
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	29.75	161,483.00
ELI LILLY & CO	11,862	207.29	2,458,873.98
EXACT SCIENCES CORP	2,304	155.01	357,143.04
GILEAD SCIENCES INC	17,383	66.89	1,162,748.87
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,200	90.53	289,696.00
ILLUMINA INC	1,933	504.76	975,701.08
INCYTE CORP	2,513	84.32	211,908.72
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,802	57.06	102,822.12
IQVIA HOLDINGS INC	2,542	192.66	489,741.72
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	167.52	126,142.56
JOHNSON & JOHNSON	36,055	166.58	6,006,041.90
MERCK & CO. INC.	34,728	75.00	2,604,600.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	321	1,220.66	391,831.86
MODERNA INC	3,691	183.74	678,184.34
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	114.10	109,992.40
PERKINELMER INC	1,624	150.57	244,525.68
PERRIGO CO PLC	1,855	44.98	83,437.90

PFIZER INC	76,299	34.72	2,649,101.28
PPD INC	1,772	38.00	67,336.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,458	485.62	708,033.96
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	47.98	79,262.96
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	91.07	74,039.91
SEAGEN INC	1,643	165.84	272,475.12
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	11.12	142,547.28
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,436	507.83	2,760,563.88
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,629	213.98	776,533.42
VIATRIS INC	17,737	18.24	323,522.88
WATERS CORP	843	283.95	239,369.85
ZOETIS INC	6,586	166.71	1,097,952.06
BANK OF AMERICA CORP	106,922	33.37	3,567,987.14
CITIGROUP INC	28,659	63.63	1,823,572.17
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	40.52	229,951.00
FIFTH THIRD BANCORP	10,229	32.51	332,544.79
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,273	155.39	353,201.47
HUNTINGTON BANCSHARES INC	14,642	14.45	211,576.90
JPMORGAN CHASE & CO	41,718	141.25	5,892,667.50
KEYCORP	12,976	19.07	247,452.32
M & T BANK CORP	1,846	142.23	262,556.58
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,541	162.27	899,138.07
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	19.56	249,722.52
SVB FINANCIAL GROUP	685	506.50	346,952.50
TRUIST FINANCIAL CORP	18,676	54.01	1,008,690.76
US BANCORP	18,811	47.64	896,156.04
WELLS FARGO & CO	53,908	33.53	1,807,535.24
ALLY FINANCIAL INC	5,678	42.01	238,532.78
AMERICAN EXPRESS CO	9,575	129.62	1,241,111.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	218.08	365,502.08
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	51.46	80,020.30
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	10,702	41.93	448,734.86
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	19,252	242.46	4,667,839.92
BLACKROCK INC	2,122	722.98	1,534,163.56
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	8,940	70.21	627,677.40

CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,102	117.75	718,510.50
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	37.16	46,450.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	89.39	110,754.21
CME GROUP INC	5,056	184.37	932,174.72
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,228	93.72	396,248.16
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	27.35	153,105.30
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	316.00	165,268.00
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	27.62	75,623.56
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,581	306.32	1,403,251.92
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,216	111.07	801,481.12
INVESCO LTD	5,927	22.67	134,365.09
KKR & CO INC	6,932	48.21	334,191.72
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	552.55	287,326.00
MOODY'S CORP	2,233	278.67	622,270.11
MORGAN STANLEY	18,743	74.61	1,398,415.23
MSCI INC	1,140	434.77	495,637.80
NASDAQ INC	1,746	141.99	247,914.54
NORTHERN TRUST CORP	2,987	98.14	293,144.18
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	114.13	194,363.39
S&P GLOBAL INC	3,373	339.45	1,144,964.85
SCHWAB (CHARLES) CORP	21,435	58.19	1,247,302.65
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	57.44	99,715.84
STATE STREET CORP	4,767	73.50	350,374.50
SYNCHRONY FINANCIAL	7,979	37.15	296,419.85
T ROWE PRICE GROUP INC	3,050	163.19	497,729.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	68.29	50,124.86
VOYA FINANCIAL INC	1,741	54.98	95,720.18
AFLAC INC	9,192	46.92	431,288.64
ALLEGHANY CORP	197	609.08	119,988.76
ALLSTATE CORP	4,209	104.43	439,545.87
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	108.04	83,839.04
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	11,606	41.40	480,488.40
AON PLC	3,057	228.04	697,118.28
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	35.15	214,450.15
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,584	116.68	301,501.12

ASSURANT INC	896	128.13	114,804.48
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	45.17	57,365.90
BROWN & BROWN INC	2,686	44.80	120,332.80
CHUBB LTD	6,327	164.16	1,038,640.32
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	92.42	160,256.28
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	260.27	99,423.14
EVEREST RE GROUP LTD	550	243.54	133,947.00
FNF GROUP	3,124	39.63	123,804.12
GLOBE LIFE INC	1,521	94.02	143,004.42
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5,383	49.61	267,050.63
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	52.35	107,841.00
LOEWS CORP	2,906	48.62	141,289.72
MARKEL CORP	207	1,106.96	229,140.72
MARSH & MCLENNAN COS	6,717	112.80	757,677.60
METLIFE INC	10,331	55.67	575,126.77
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	54.13	203,745.32
PROGRESSIVE CORP	8,272	86.27	713,625.44
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,308	80.86	429,204.88
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,021	113.00	115,373.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	159.22	89,481.64
TRAVELERS COS INC/THE	3,388	145.96	494,512.48
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,732	227.42	393,891.44
WR BERKLEY CORP	2,140	67.88	145,263.20
CBRE GROUP INC - A	4,736	71.33	337,818.88
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.59	92,259.00
ACCENTURE PLC-CL A	8,750	257.47	2,252,862.50
ADOBE INC	6,583	498.84	3,283,863.72
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	101.59	220,551.89
ANSYS INC	1,132	403.60	456,875.20
AUTODESK INC	3,052	305.14	931,287.28
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,962	167.03	995,832.86
AVALARA INC	1,064	173.78	184,901.92
BLACK KNIGHT INC	2,282	87.40	199,446.80
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	82.59	127,271.19
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,673	148.07	247,721.11

CADENCE DESIGN SYS INC	3,685	145.68	536,830.80
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	97.71	188,482.59
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	120.72	200,878.08
CITRIX SYSTEMS INC	1,705	137.68	234,744.40
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,240	85.95	192,528.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,112	76.96	547,339.52
COUPA SOFTWARE INC	887	366.51	325,094.37
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	1,914	242.10	463,379.40
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	162.78	115,899.36
DATADOG INC - CLASS A	1,771	112.86	199,875.06
DOCUSIGN INC	2,288	263.30	602,430.40
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	24.51	66,054.45
DYNATRACE INC	2,449	53.53	131,094.97
EPAM SYSTEMS INC	745	400.27	298,201.15
FAIR ISAAC CORP	389	473.78	184,300.42
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,567	135.60	1,161,685.20
FISERV INC	7,910	109.99	870,020.90
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	264.30	295,223.10
FORTINET INC	1,600	164.73	263,568.00
GARTNER INC	1,196	182.93	218,784.28
GLOBAL PAYMENTS INC	4,167	197.18	821,649.06
GODADDY INC - CLASS A	2,217	85.75	190,107.75
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	128.69	116,850.52
HUBSPOT INC	629	502.40	316,009.60
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,287	120.80	1,484,269.60
INTUIT INC	3,606	413.99	1,492,847.94
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	145.64	122,774.52
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	107.80	211,611.40
MASTERCARD INC-CLASS A	12,242	341.00	4,174,522.00
MICROSOFT CORP	98,226	244.99	24,064,387.74
MONGODB INC	644	422.85	272,315.40
NORTONLIFELOCK INC	6,268	21.47	134,573.96
OKTA INC	1,540	291.78	449,341.20
ORACLE CORP	27,510	63.08	1,735,330.80
PALO ALTO NETWORKS INC	1,280	395.12	505,753.60

PAYCHEX INC	4,283	89.40	382,900.20
PAYCOM SOFTWARE INC	719	412.98	296,932.62
PAYPAL HOLDINGS INC	15,303	298.37	4,565,956.11
PTC INC	1,603	142.72	228,780.16
RINGCENTRAL INC-CLASS A	975	443.29	432,207.75
SALESFORCE.COM INC	12,489	240.37	3,001,980.93
SERVICENOW INC	2,649	591.29	1,566,327.21
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,137	43.69	224,435.53
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	299.47	113,798.60
SPLUNK INC	2,092	173.33	362,606.36
SQUARE INC - A	5,144	272.75	1,403,026.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	66.02	204,529.96
SYNOPSYS INC	1,988	292.09	580,674.92
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	546	864.00	471,744.00
TWILIO INC - A	1,834	435.29	798,321.86
TYLER TECHNOLOGIES INC	585	474.79	277,752.15
VERISIGN INC	1,385	202.39	280,310.15
VISA INC-CLASS A SHARES	23,094	209.96	4,848,816.24
VMWARE INC-CLASS A	1,126	145.13	163,416.38
WESTERN UNION CO	5,513	23.99	132,256.87
WIX.COM LTD	747	292.81	218,729.07
WORKDAY INC-CLASS A	2,288	281.36	643,751.68
ZENDESK INC	1,677	157.20	263,624.40
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,398	433.11	1,038,597.78
ZSCALER INC	963	226.48	218,100.24
AMPHENOL CORP-CL A	3,944	135.90	535,989.60
APPLE INC	233,699	135.37	31,635,833.63
ARISTA NETWORKS INC	777	323.31	251,211.87
ARROW ELECTRONICS INC	902	105.08	94,782.16
CDW CORP/DE	2,130	155.40	331,002.00
CISCO SYSTEMS INC	58,210	47.29	2,752,750.90
COGNEX CORP	1,928	93.99	181,212.72
CORNING INC	10,238	36.88	377,577.44
DELL TECHNOLOGIES -C	3,296	80.05	263,844.80
F5 NETWORKS INC	916	210.62	192,927.92

HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19,254	14.38	276,872.52
HP INC	19,172	27.49	527,038.28
IPG PHOTONICS CORP	558	252.89	141,112.62
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	25.25	114,458.25
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,546	153.48	390,760.08
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,283	181.07	413,382.81
NETAPP INC	2,471	69.86	172,624.06
SEAGATE TECHNOLOGY	3,159	72.21	228,111.39
TE CONNECTIVITY LTD	4,399	129.77	570,858.23
TRIMBLE INC	3,417	73.97	252,755.49
WESTERN DIGITAL CORP	4,100	65.57	268,837.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	793	477.74	378,847.82
AT&T INC	98,260	28.80	2,829,888.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	25.08	32,754.48
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	24.78	86,804.34
LUMEN TECHNOLOGIES INC	12,971	11.78	152,798.38
T-MOBILE US INC	7,827	123.68	968,043.36
VERIZON COMMUNICATIONS INC	56,968	54.20	3,087,665.60
AES CORP	9,870	28.53	281,591.10
ALLIANT ENERGY CORP	3,704	48.29	178,866.16
AMEREN CORPORATION	3,331	73.28	244,095.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,546	78.61	514,581.06
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,418	161.69	390,966.42
ATMOS ENERGY CORP	1,353	91.05	123,190.65
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	21.38	145,811.60
CMS ENERGY CORP	3,883	56.38	218,923.54
CONSOLIDATED EDISON INC	4,473	71.06	317,851.38
DOMINION ENERGY INC	11,742	71.87	843,897.54
DTE ENERGY COMPANY	2,584	120.94	312,508.96
DUKE ENERGY CORP	10,265	89.82	922,002.30
EDISON INTERNATIONAL	5,098	57.91	295,225.18
ENERGY CORP	2,701	94.89	256,297.89
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	46.66	115,016.90
EVERGY INC	2,522	54.43	137,272.46
EVERSOURCE ENERGY	4,479	85.17	381,476.43

EXELON CORP	12,893	42.21	544,213.53
FIRSTENERGY CORP	8,044	31.24	251,294.56
NEXTERA ENERGY INC	27,024	83.13	2,246,505.12
NISOURCE INC	4,230	22.53	95,301.90
NRG ENERGY INC	3,312	43.04	142,548.48
OGE ENERGY CORP	2,970	31.54	93,673.80
P G & E CORP	21,589	11.80	254,750.20
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	76.19	116,265.94
PPL CORP	10,335	28.01	289,483.35
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,746	58.27	393,089.42
SEMPRA ENERGY	3,870	124.50	481,815.00
SOUTHERN CO/THE	14,774	60.10	887,917.40
UGI CORP	3,091	38.88	120,178.08
VISTRA CORP	4,854	21.33	103,535.82
WEC ENERGY GROUP INC	4,196	83.05	348,477.80
XCEL ENERGY INC	6,948	61.54	427,579.92
ADVANCED MICRO DEVICES	16,160	93.77	1,515,323.20
ANALOG DEVICES INC	4,806	160.78	772,708.68
APPLIED MATERIALS INC	12,609	116.70	1,471,470.30
BROADCOM INC	5,520	486.32	2,684,486.40
ENPHASE ENERGY INC	1,709	206.51	352,925.59
INTEL CORP	58,306	61.81	3,603,893.86
KLA CORP	2,030	331.81	673,574.30
LAM RESEARCH CORP	2,014	586.16	1,180,526.24
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	8,745	53.82	470,655.90
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,781	96.22	363,807.82
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,220	159.55	513,751.00
MICRON TECHNOLOGY INC	15,347	88.01	1,350,689.47
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	609	385.92	235,025.28
NVIDIA CORP	8,445	598.45	5,053,910.25
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,648	194.39	709,134.72
ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	41.27	223,889.75
QORVO INC	1,631	176.00	287,056.00
QUALCOMM INC	15,483	147.98	2,291,174.34
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,194	189.50	415,763.00

	SOLAREDDGE TECHNOLOGIES INC	716	330.89	236,917.24	
	TERADYNE INC	2,370	142.41	337,511.70	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	12,577	179.64	2,259,332.28	
	XILINX INC	3,193	145.75	465,379.75	
	米ドル 小計	4,247,028		476,561,886.91 (50,096,185,551)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	20.02	49,329.28	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,284	34.15	556,098.60	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	8.57	88,588.09	
	ENBRIDGE INC	28,581	44.01	1,257,849.81	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	25.74	74,053.98	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	17.43	60,499.53	
	KEYERA CORP	2,259	26.06	58,869.54	
	PARKLAND CORP	1,790	37.66	67,411.40	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	35.22	304,159.92	
	SUNCOR ENERGY INC	20,962	22.89	479,820.18	
	TC ENERGY CORP	12,551	56.59	710,261.09	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	84.70	289,758.70	
	B2GOLD CORP	10,119	6.39	64,660.41	
	BARRICK GOLD CORP	23,822	28.12	669,874.64	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	66.22	110,786.06	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	25.20	232,167.60	
	FRANCO-NEVADA CORP	2,617	153.77	402,416.09	
	KINROSS GOLD CORP	19,092	9.35	178,510.20	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	48.59	152,621.19	
	LUNDIN MINING CORP	7,300	13.30	97,090.00	
	NUTRIEN LTD	7,998	71.10	568,657.80	
	PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	42.36	86,838.00	
	SSR MINING INC	2,800	21.00	58,800.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	25.03	185,322.12	
	WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,300	94.24	122,512.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,261	51.03	319,498.83	
	YAMANA GOLD INC	9,288	6.09	56,563.92	
	CAE INC	3,196	32.10	102,591.60	
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	92.95	131,617.20	

WSP GLOBAL INC	1,340	115.40	154,636.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	36.66	114,929.10
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	73.73	133,377.57
THOMSON REUTERS CORP	2,714	105.17	285,431.38
AIR CANADA	840	22.33	18,757.20
CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,995	140.49	1,404,197.55
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,833	463.69	849,943.77
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,285	98.88	423,700.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	35.72	64,296.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	75.03	309,573.78
QUEBECOR INC -CL B	1,274	32.51	41,417.74
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	22.60	129,520.60
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	174.14	162,472.62
DOLLARAMA INC	3,451	48.74	168,201.74
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,716	39.82	466,531.12
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	37.98	99,811.44
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	62.58	132,294.12
METRO INC	4,107	54.76	224,899.32
WESTON (GEORGE) LTD	817	96.90	79,167.30
SAPUTO INC	3,667	37.75	138,429.25
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	39.68	130,031.36
CANOPY GROWTH CORP	3,659	51.14	187,121.26
BANK OF MONTREAL	8,502	97.60	829,795.20
BANK OF NOVA SCOTIA	16,021	71.01	1,137,651.21
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,942	113.43	674,001.06
NATIONAL BANK OF CANADA	4,616	72.67	335,444.72
ROYAL BANK OF CANADA	19,705	106.20	2,092,671.00
TORONTO-DOMINION BANK	25,036	75.42	1,888,215.12
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,959	54.49	978,585.91
CI FINANCIAL CORP	775	19.16	14,849.00
IGM FINANCIAL INC	81	34.85	2,822.85
ONEX CORPORATION	908	72.47	65,802.76
TMX GROUP LTD	540	128.68	69,487.20
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	512.88	167,198.88
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	31.10	134,600.80

	IA FINANCIAL CORP INC	1,254	64.68	81,108.72
	INTACT FINANCIAL CORP	2,057	149.24	306,986.68
	MANULIFE FINANCIAL CORP	26,548	24.88	660,514.24
	POWER CORP OF CANADA	8,338	30.75	256,393.50
	SUN LIFE FINANCIAL INC	8,077	62.00	500,774.00
	FIRSTSERVICE CORP	671	189.56	127,194.76
	BLACKBERRY LTD	1,407	16.46	23,159.22
	CGI INC	3,488	100.57	350,788.16
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	275	1,613.99	443,847.25
	OPEN TEXT CORP	4,289	60.93	261,328.77
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,503	1,847.20	2,776,341.60
	BCE INC	2,440	55.49	135,395.60
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	57.50	297,447.50
	TELUS CORP	4,085	26.68	108,987.80
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	22.48	201,151.04
	ALTAGAS LTD	2,930	19.88	58,248.40
	ATCO LTD -CLASS I	863	38.58	33,294.54
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	64.15	131,892.40
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	32.32	31,899.84
	EMERA INC	4,109	52.00	213,668.00
	FORTIS INC	6,487	51.50	334,080.50
	HYDRO ONE LTD	4,991	28.82	143,840.62
	NORTHLAND POWER INC	3,252	49.22	160,063.44
	カナダドル 小計	516,541		29,285,501.09 (2,426,010,910)
ユーロ	ENI SPA	35,538	8.87	315,541.90
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	9.01	66,793.74
	NESTE OYJ	5,733	57.22	328,042.26
	OMV AG	1,475	35.22	51,949.50
	REPSOL SA	21,728	8.87	192,814.27
	TENARIS SA	5,062	7.11	35,990.82
	TOTAL SE	35,015	34.97	1,224,649.62
	VOPAK	762	43.71	33,307.02
	AIR LIQUIDE SA	6,642	134.90	896,005.80
	AKZO NOBEL	2,659	85.22	226,599.98

ARCELORMITTAL	11,383	18.68	212,702.73
ARKEMA	822	89.38	73,470.36
BASF SE	12,913	66.93	864,267.09
COVESTRO AG	2,528	58.74	148,494.72
CRH PLC	10,365	36.78	381,224.70
EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	27.81	49,863.33
FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,085	47.90	51,971.50
HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	63.34	137,067.76
KONINKLIJKE DSM NV	2,331	145.35	338,810.85
LANXESS AG	745	60.88	45,355.60
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	41.88	166,514.88
SOLVAY SA	925	95.72	88,541.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	16.49	143,726.84
SYMRISE AG	1,815	104.40	189,486.00
UMICORE	2,388	47.58	113,621.04
UPM-KYMMENE OYJ	8,076	32.15	259,643.40
VOESTALPINE AG	2,425	31.08	75,369.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	25.60	73,600.00
AIRBUS SE	7,861	92.21	724,862.81
ALSTOM	3,998	42.04	168,075.92
BOUYGUES SA	3,499	33.55	117,391.45
BRENTAG SE	2,419	65.20	157,718.80
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	12.12	197,289.36
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7,237	42.19	305,329.03
DASSAULT AVIATION SA	11	918.00	10,098.00
EIFFAGE	1,313	81.52	107,035.76
FERROVIAL SA	7,014	20.55	144,137.70
GEA GROUP AG	1,676	30.56	51,218.56
HOCHTIEF AG	17	76.25	1,296.25
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	53.25	109,162.50
KION GROUP AG	740	74.52	55,144.80
KNORR-BREMSE AG	1,136	107.72	122,369.92
KONE OYJ-B	4,561	69.28	315,986.08
LEGRAND SA	3,715	75.54	280,631.10
MTU AERO ENGINES AG	831	194.80	161,878.80

PRYSMIAN SPA	2,867	28.40	81,422.80
RATIONAL AG	80	826.00	66,080.00
SAFRAN SA	4,327	108.90	471,210.30
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,324	129.00	944,796.00
SIEMENS AG-REG	10,651	133.30	1,419,778.30
SIEMENS ENERGY AG	5,006	31.45	157,438.70
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	33.69	77,284.86
THALES SA	1,768	77.90	137,727.20
VINCI SA	7,391	85.66	633,113.06
WARTSILA OYJ ABP	2,705	8.54	23,100.70
BUREAU VERITAS SA	4,564	22.41	102,279.24
RANDSTAD NV	1,871	54.08	101,183.68
TELEPERFORMANCE	832	295.00	245,440.00
WOLTERS KLUWER	3,691	70.46	260,067.86
ADP	314	99.95	31,384.30
AENA SME SA	1,045	131.50	137,417.50
ATLANTIA SPA	8,066	15.75	127,039.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	10.65	14,984.55
DEUTSCHE POST AG-REG	13,231	42.95	568,271.45
GETLINK	4,655	13.26	61,725.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,522	70.35	318,122.70
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	54.75	33,890.25
CONTINENTAL AG	1,647	122.80	202,251.60
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,398	64.82	738,818.36
FAURECIA	800	43.96	35,168.00
FERRARI NV	1,758	168.75	296,662.50
MICHELIN (CGDE)	2,383	116.70	278,096.10
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	60.68	107,707.00
RENAULT SA	3,099	39.34	121,914.66
STELLANTIS NV	15,421	13.25	204,451.61
STELLANTIS NV	16,479	13.26	218,610.41
VALEO SA	3,692	32.36	119,473.12
VOLKSWAGEN AG	462	181.30	83,760.60
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,502	161.46	403,972.92
ADIDAS AG	2,705	291.40	788,237.00

ESSILORLUXOTTICA	3,854	136.90	527,612.60
HERMES INTERNATIONAL	437	924.40	403,962.80
KERING	1,018	547.90	557,762.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,853	529.30	2,039,392.90
MONCLER SPA	2,414	51.24	123,693.36
PUMA SE	1,586	85.80	136,078.80
SEB SA	151	167.60	25,307.60
ACCOR SA	2,330	29.91	69,690.30
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,314	160.20	370,702.80
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	38.56	31,079.36
SODEXO	1,088	74.56	81,121.28
BOLLORE	3,240	3.62	11,741.76
PUBLICIS GROUPE	3,613	47.00	169,811.00
SCOUT24 AG	1,621	66.55	107,877.55
SES	2,232	6.93	15,467.76
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	75.48	82,650.60
VIVENDI	11,862	26.10	309,598.20
DELIVERY HERO SE	1,926	131.85	253,943.10
HELLOFRESH SE	2,219	76.80	170,419.20
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,775	25.71	379,865.25
JUST EAT TAKEAWAY	1,952	90.68	177,007.36
PROSUS NV	6,873	105.30	723,726.90
ZALANDO SE	2,148	100.05	214,907.40
CARREFOUR SA	7,042	14.44	101,721.69
COLRUYT SA	290	50.66	14,691.40
JERONIMO MARTINS	5,217	12.65	65,995.05
KESKO OYJ-B SHS	4,478	21.52	96,366.56
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	14,664	23.51	344,750.64
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,177	52.60	535,310.20
DANONE	8,264	53.92	445,594.88
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	9.78	88,156.92
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	74.35	135,317.00
HEINEKEN NV	3,455	86.04	297,268.20
JDE PEET'S BV	1,184	32.26	38,195.84
KERRY GROUP PLC-A	2,069	108.40	224,279.60

PERNOD RICARD SA	2,853	159.30	454,482.90
REMY COINTREAU	264	159.30	42,055.20
BEIERSDORF AG	1,128	92.20	104,001.60
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	77.95	121,757.90
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	87.42	209,458.32
L'OREAL	3,494	318.30	1,112,140.20
AMPLIFON SPA	2,059	37.49	77,191.91
BIOMERIEUX	402	125.60	50,491.20
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	133.50	32,707.50
DIASORIN SPA	256	185.60	47,513.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	60.98	180,256.88
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,777	36.13	208,723.01
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,089	47.96	579,788.44
ORPEA	501	116.45	58,341.45
SARTORIUS AG-VORZUG	502	480.60	241,261.20
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,463	49.18	170,327.65
ARGENX SE	674	309.80	208,805.20
BAYER AG-REG	12,953	54.00	699,462.00
EUROFINS SCIENTIFIC	1,530	81.45	124,618.50
GALAPAGOS NV	507	70.68	35,834.76
GRIFOLS SA	3,329	22.74	75,701.46
IPSEN	158	74.40	11,755.20
MERCK KGAA	1,798	141.10	253,697.80
ORION OYJ-CLASS B	739	35.81	26,463.59
QIAGEN N.V.	2,679	45.05	120,688.95
RECORDATI SPA	830	44.63	37,042.90
SANOFI	15,691	78.16	1,226,408.56
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	406.00	180,264.00
UCB SA	2,009	87.72	176,229.48
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	8.77	33,378.62
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	91,083	4.40	400,765.20
BANCO SANTANDER SA	240,521	2.79	672,256.19
BNP PARIBAS	14,918	46.48	693,388.64
CAIXABANK S.A	52,513	2.25	118,311.78
COMMERZBANK AG	13,866	5.11	70,938.45

CREDIT AGRICOLE SA	16,523	10.87	179,687.62
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	26.54	104,063.34
FINECOBANK SPA	7,003	15.06	105,500.19
ING GROEP NV-CVA	51,310	8.34	428,387.19
INTESA SANPAOLO	223,051	2.09	467,514.89
KBC GROEP NV	3,531	59.22	209,105.82
MEDIOBANCA SPA	6,857	8.88	60,931.30
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	16.70	20,307.20
SOCIETE GENERALE SA	12,059	17.77	214,312.54
UNICREDIT SPA	29,529	8.39	247,925.48
AMUNDI SA	618	66.25	40,942.50
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,465	8.93	245,289.91
DEUTSCHE BOERSE AG	2,564	136.70	350,498.80
EURAZEO	403	62.00	24,986.00
EXOR NV	1,318	67.50	88,965.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	84.94	168,096.26
NATIXIS	3,105	4.00	12,420.00
SOFINA	168	294.50	49,476.00
WENDEL	294	97.45	28,650.30
AEGON NV	16,557	3.73	61,873.50
AGEAS	2,765	45.43	125,613.95
ALLIANZ SE-REG	5,820	195.98	1,140,603.60
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	15.66	250,733.99
AXA SA	26,166	19.11	500,189.25
CNP ASSURANCES	1,015	13.42	13,621.30
HANNOVER RUECK SE	718	142.10	102,027.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,879	233.70	439,122.30
NN GROUP NV	4,060	35.64	144,698.40
POSTE ITALIANE SPA	5,374	9.67	52,009.57
SAMPO OYJ-A SHS	6,490	36.90	239,481.00
SCOR SE	1,565	27.86	43,600.90
AROUNDTOWN SA	10,475	5.83	61,069.25
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,911	41.20	202,333.20
LEG IMMOBILIEN AG	1,031	118.40	122,070.40
VONOVIA SE	7,029	55.10	387,297.90

ADYEN NV	239	2,190.00	523,410.00
AMADEUS IT GROUP SA	6,112	54.16	331,025.92
ATOS SE	1,599	66.00	105,534.00
BECHTLE AG	414	169.80	70,297.20
CAPGEMINI SA	2,213	135.30	299,418.90
DASSAULT SYSTEMES SA	1,805	190.25	343,401.25
ELENRED	3,764	47.61	179,204.04
NEMETSCHKE SE	536	58.25	31,222.00
NEXI SPA	7,091	16.21	114,945.11
SAP SE	14,429	108.40	1,564,103.60
TEAMVIEWER AG	2,285	45.61	104,218.85
WORLDCON SA	3,094	78.72	243,559.68
NOKIA OYJ	76,089	3.47	264,523.40
CELLNEX TELECOM SA	4,483	45.83	205,455.89
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	47,340	14.80	700,868.70
ELISA OYJ	2,152	49.59	106,717.68
ILIAD SA	98	153.05	14,998.90
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	9.28	22,940.16
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.92	172,593.88
ORANGE	28,127	9.74	274,125.74
PROXIMUS	918	16.98	15,587.64
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.38	27,376.32
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.42	30,677.34
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.28	28,840.17
TELEFONICA SA	69,076	3.76	259,932.98
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	37.68	28,862.88
E.ON SE	30,402	8.76	266,443.12
EDF	10,409	10.61	110,491.53
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,111	4.94	183,365.45
ELIA GROUP SA/NV	345	98.20	33,879.00
ENAGAS SA	2,667	17.76	47,365.92
ENDESA SA	4,803	21.93	105,329.79
ENEL SPA	113,841	8.46	964,005.58
ENGIE	25,193	13.05	328,894.61
FORTUM OYJ	6,395	21.76	139,155.20

	IBERDROLA SA	83,775	10.80	905,188.87
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	20.99	97,561.52
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	14.96	73,433.25
	RWE AG	8,723	34.00	296,582.00
	SNAM SPA	32,585	4.47	145,720.12
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	17.06	98,879.76
	TERNA SPA	16,305	6.17	100,601.85
	UNIPER SE	2,857	30.32	86,624.24
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,568	22.49	192,694.32
	VERBUND AG	797	69.65	55,511.05
	ASML HOLDING NV	5,862	494.75	2,900,224.50
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	18,294	35.51	649,711.41
	STMICROELECTRONICS NV	8,739	35.30	308,486.70
	ユーロ 小計	2,486,076		58,742,911.65 (7,486,196,660)
英債券	BP PLC	284,061	2.61	743,671.69
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	57,449	13.58	780,272.31
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	52,102	13.00	677,638.61
	ANGLO AMERICAN PLC	16,694	26.63	444,561.22
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	15.33	66,225.60
	BHP GROUP PLC	28,186	21.17	596,838.55
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	66.00	144,738.00
	EVRAZ PLC	3,072	5.13	15,765.50
	FRESNILLO PLC	2,896	10.20	29,553.68
	GLENCORE PLC	138,176	2.68	371,417.08
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	30.03	54,144.09
	MONDI PLC	5,627	18.40	103,536.80
	RIO TINTO PLC	15,750	59.34	934,605.00
	ASHTREAD GROUP PLC	6,287	39.18	246,324.66
	BAE SYSTEMS PLC	43,957	4.80	210,993.60
	BUNZL PLC	4,790	23.43	112,229.70
	DCC PLC	1,401	58.82	82,406.82
	FERGUSON PLC	3,075	89.20	274,290.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	76,613	1.70	130,855.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107,239	0.92	99,582.13

SMITHS GROUP PLC	3,824	14.97	57,245.28
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	117.65	99,767.20
EXPERIAN PLC	12,198	26.38	321,783.24
INTERTEK GROUP PLC	1,825	58.38	106,543.50
RELX PLC	25,710	18.66	479,877.15
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	5.25	109,688.02
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	6.80	82,422.80
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	43.03	64,458.94
BURBERRY GROUP PLC	5,808	17.88	103,847.04
PERSIMMON PLC	5,194	27.22	141,380.68
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.61	69,895.58
COMPASS GROUP PLC	24,300	14.09	342,508.50
ENTAIN PLC	6,950	13.53	94,033.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	48.95	122,962.40
WHITBREAD PLC	2,921	32.07	93,676.47
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.92	67,130.76
INFORMA PLC	17,619	5.08	89,504.52
PEARSON PLC	7,332	7.63	55,972.48
WPP PLC	19,572	8.25	161,508.14
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.04	39,888.32
KINGFISHER PLC	29,802	2.70	80,733.61
NEXT PLC	1,878	76.78	144,192.84
OCADO GROUP PLC	6,371	26.20	166,920.20
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.29	63,786.02
TESCO PLC	132,370	2.40	318,482.22
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.71	39,343.68
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	22.27	110,770.98
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	32,021	27.14	869,210.04
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	23.75	43,605.00
DIAGEO PLC	32,550	30.09	979,429.50
IMPERIAL BRANDS PLC	14,237	14.93	212,629.59
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,941	63.06	626,879.46
UNILEVER PLC	36,228	39.61	1,434,991.08
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	15.72	190,712.80

	ASTRAZENECA PLC	18,127	74.71	1,354,268.17	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	69,675	12.78	890,446.50	
	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	23.60	31,907.20	
	BARCLAYS PLC	231,567	1.45	337,856.25	
	HSBC HOLDINGS PLC	281,727	4.01	1,131,979.08	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	943,785	0.37	350,144.23	
	NATWEST GROUP PLC	73,118	1.71	125,287.69	
	STANDARD CHARTERED PLC	39,789	4.62	184,183.28	
	3I GROUP PLC	14,053	11.47	161,187.91	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	16.46	50,499.28	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,254	98.00	416,892.00	
	M&G PLC	41,949	1.87	78,738.27	
	SCHRODERS PLC	1,161	35.29	40,971.69	
	ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	12.25	94,937.50	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	32,937	3.19	105,332.52	
	ADMIRAL GROUP PLC	2,745	29.97	82,267.65	
	AVIVA PLC	60,743	3.48	211,750.09	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	3.06	60,025.61	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,505	2.59	217,029.49	
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	7.09	62,037.50	
	PRUDENTIAL PLC	34,888	13.28	463,312.64	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	16,473	6.77	111,522.21	
	AVEVA GROUP PLC	700	38.15	26,705.00	
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	5.90	89,633.67	
	HALMA PLC	4,416	25.59	113,005.44	
	BT GROUP PLC	129,623	1.24	160,797.33	
	VODAFONE GROUP PLC	360,190	1.33	482,366.44	
	NATIONAL GRID PLC	46,737	8.56	400,255.66	
	SEVERN TRENT PLC	2,734	23.48	64,194.32	
	SSE PLC	14,351	14.22	204,071.22	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	9.44	73,962.40	
	英ポンド 小計	4,024,883		22,282,999.82	(3,249,975,523)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	18.60	52,991.40	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	895.00	69,810.00	

GIVAUDAN-REG	124	3,655.00	453,220.00
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	7,141	49.95	356,692.95
SIKA AG-REG	1,908	254.60	485,776.80
ABB LTD-REG	24,382	26.20	638,808.40
GEBERIT AG-REG	504	557.40	280,929.60
SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	250.20	53,793.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	251.00	116,213.00
ADECCO SA-REG	2,354	57.04	134,272.16
SGS SA-REG	90	2,729.00	245,610.00
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	844	208.50	175,974.00
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6,992	87.78	613,757.76
SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	265.00	108,650.00
SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	51.25	12,863.75
BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,022.00	84,924.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	15	8,205.00	123,075.00
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	86,000.00	86,000.00
NESTLE SA-REG	39,531	100.72	3,981,562.32
ALCON INC	6,601	66.50	438,966.50
SONOVA HOLDING AG-REG	840	238.90	200,676.00
STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	1,105.50	128,238.00
LONZA GROUP AG-REG	985	610.00	600,850.00
NOVARTIS AG-REG	30,528	82.00	2,503,296.00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,649	313.20	3,022,066.80
VIFOR PHARMA AG	638	118.00	75,284.00
BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	99.40	27,136.20
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,933	12.32	405,899.22
JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	54.60	194,867.40
PARTNERS GROUP HOLDING AG	259	1,117.50	289,432.50
UBS GROUP AG-REG	48,789	13.70	668,409.30
BALOISE HOLDING AG - REG	658	155.00	101,990.00
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	436.30	160,558.40
SWISS RE AG	4,010	83.90	336,439.00
ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,123	372.70	791,242.10
SWISS PRIME SITE-REG	1,117	87.70	97,960.90
TEMENOS GROUP AG-REG	737	104.95	77,348.15

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,319	104.80	243,031.20	
	SWISSCOM AG-REG	414	464.80	192,427.20	
	スイスフラン 小計	235,120		18,631,043.01 (2,195,668,418)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	254.20	279,365.80	
	BOLIDEN AB	4,039	310.70	1,254,917.30	
	SVENSKA CELLULOOSA AB SCA-B	9,468	151.55	1,434,875.40	
	ALFA LAVAL AB	4,566	249.10	1,137,390.60	
	ASSA ABLOY AB-B	13,841	225.40	3,119,761.40	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,124	492.20	4,490,832.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	5,552	424.80	2,358,489.60	
	EPIROC AB-A	9,564	171.35	1,638,791.40	
	EPIROC AB-B	4,649	155.20	721,524.80	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	203.20	297,484.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,889	290.20	1,418,787.80	
	SANDVIK AB	15,627	216.10	3,376,994.70	
	SKANSKA AB-B SHS	4,937	207.90	1,026,402.30	
	SKF AB-B SHARES	4,538	222.60	1,010,158.80	
	VOLVO AB-B SHS	20,302	210.20	4,267,480.40	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	125.00	479,125.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	3,653	211.30	771,878.90	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	102.80	291,643.60	
	EVOLUTION GAMING GROUP	1,877	1,037.50	1,947,387.50	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	179.85	1,724,941.35	
	ICA GRUPPEN AB	1,462	412.30	602,782.60	
	SWEDISH MATCH AB	1,999	615.80	1,230,984.20	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,201	263.50	2,160,963.50	
	NORDEA BANK ABP	43,708	71.66	3,132,115.28	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,883	94.44	2,255,510.52	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	84.98	1,954,964.90	
SWEDBANK AB - A SHARES	13,356	149.58	1,997,790.48		
EQT AB	2,344	260.00	609,440.00		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	292.60	501,516.40		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	279.20	656,957.60		
INVESTOR AB-B SHS	6,250	650.80	4,067,500.00		

	KINNEVIK AB - B	3,881	439.85	1,707,057.85	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	438.80	403,696.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	418.60	662,643.80	
	ERICSSON LM-B SHS	39,493	113.60	4,486,404.80	
	HEXAGON AB-B SHS	3,933	734.20	2,887,608.60	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	110.25	818,496.00	
	TELIA CO AB	31,100	35.33	1,098,763.00	
	スウェーデンクローナ 小計	352,059		64,283,429.78	(813,828,221)
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	14,162	151.00	2,138,462.00	
	NORSK HYDRO ASA	20,202	41.02	828,686.04	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	413.70	1,146,776.40	
	ADEVINTA ASA	3,943	134.60	530,727.80	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	302.40	166,924.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	360.00	419,400.00	
	MOWI ASA	5,643	192.35	1,085,431.05	
	ORKLA ASA	11,182	81.06	906,412.92	
	DNB ASA	13,159	164.55	2,165,313.45	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	204.00	545,496.00	
	TELENOR ASA	9,278	141.90	1,316,548.20	
	ノルウェークローネ 小計	84,732		11,250,178.66	(139,952,222)
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	573.60	698,644.80	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	405.60	1,352,270.40	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,268.00	292,572.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,706	1,301.00	3,520,506.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	11,750.00	458,250.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	12,670.00	1,254,330.00	
	DSV PANALPINA A S	2,852	1,121.00	3,197,092.00	
	PANDORA A/S	1,659	612.40	1,015,971.60	
	CARLSBERG AS-B	1,603	961.00	1,540,483.00	
	AMBU A/S-B	1,526	330.30	504,037.80	
	COLOPLAST-B	1,680	1,030.00	1,730,400.00	
	DEMANT A/S	550	265.30	145,915.00	
	GN STORE NORD A/S	1,892	551.40	1,043,248.80	

	GENMAB A/S	907	2,508.00	2,274,756.00
	H LUNDBECK A/S	120	255.20	30,624.00
	NOVO NORDISK A/S-B	23,899	460.00	10,993,540.00
	DANSKE BANK A/S	9,894	109.70	1,085,371.80
	TRYG A/S	694	200.60	139,216.40
	ORSTED A/S	2,606	1,042.00	2,715,452.00
	デンマーククローネ 小計	57,407		33,992,681.60 (582,294,635)
オーストラリア ドル	AMPOL LTD	3,012	26.75	80,571.00
	OIL SEARCH LTD	32,812	4.05	132,888.60
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.36	115,138.88
	SANTOS LTD	26,550	6.81	180,805.50
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	28.91	10,320.87
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	24.98	339,952.82
	BHP GROUP LTD	41,230	44.72	1,843,805.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	17.00	106,352.00
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	4.62	74,566.80
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,433	23.83	558,408.39
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	40.70	270,899.20
	NEWCREST MINING LTD	11,374	25.96	295,269.04
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	12.06	179,416.62
	ORICA LTD	6,263	15.30	95,823.90
	RIO TINTO LTD	5,096	117.35	598,015.60
	SOUTH32 LTD	74,829	2.59	193,807.11
	CIMIC GROUP LTD	682	20.55	14,015.10
	BRAMBLES LTD	17,428	10.41	181,425.48
	AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.85	88,688.60
	QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	4.55	39,585.00
	SYDNEY AIRPORT	22,505	5.59	125,802.95
	TRANSURBAN GROUP	37,559	13.05	490,144.95
ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	33.07	301,234.63	
CROWN RESORTS LTD	773	9.89	7,644.97	
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	4.44	94,274.52	
REA GROUP LTD	563	157.16	88,481.08	
SEEK LTD	3,309	31.25	103,406.25	

	WESFARMERS LTD	15,132	55.00	832,260.00	
	COLES GROUP LTD	18,622	18.15	337,989.30	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,961	41.10	697,097.10	
	COCA-COLA AMATIL LTD	5,169	13.13	67,868.97	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	10.15	71,557.50	
	COCHLEAR LTD	1,060	206.41	218,794.60	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	64.52	177,430.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	34.29	249,288.30	
	CSL LTD	6,304	276.76	1,744,695.04	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	37,603	24.82	933,306.46	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	24,511	86.87	2,129,270.57	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	46,101	24.93	1,149,297.93	
	WESTPAC BANKING CORP	47,676	22.14	1,055,546.64	
	AMP LTD	36,656	1.32	48,385.92	
	ASX LTD	3,256	70.42	229,287.52	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,578	144.28	660,513.84	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	48.45	75,436.65	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	5.34	188,453.94	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.87	96,483.66	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	24,270	8.66	210,178.20	
	SUNCORP GROUP LTD	19,255	10.52	202,562.60	
	LENDLEASE GROUP	8,292	11.94	99,006.48	
	AFTERPAY LTD	2,984	151.74	452,792.16	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	14.19	79,520.76	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	32.85	52,560.00	
	XERO LTD	1,891	130.26	246,321.66	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.25	235,173.25	
	TPG TELECOM LTD	287	7.41	2,126.67	
	AGL ENERGY LTD	7,599	11.05	83,968.95	
	APA GROUP	13,816	9.48	130,975.68	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.71	2,457.27	
	オーストラリアドル 小計	964,360		19,371,353.08 (1,580,702,411)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	6.90	153,801.00	
	A2 MILK CO LTD	7,857	10.66	83,755.62	

	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	32.25	214,011.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	14.65	80,662.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.69	107,595.31	
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.80	48,960.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	5.81	133,391.79	
	ニュージーランドドル 小計	95,365		822,177.62	(62,403,281)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,000	53.50	2,086,500.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	21,500	123.90	2,663,850.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	22.30	669,000.00	
	MTR CORP	19,500	44.90	875,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	68.95	2,206,400.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	33.90	1,050,900.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	9.87	19,740.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	14.06	73,112.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	26.20	576,400.00	
	WH GROUP LTD	152,000	6.43	977,360.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	17.74	63,864.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	23.65	1,040,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	146.20	1,739,780.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,200	535.00	9,202,000.00	
	AIA GROUP LTD	168,200	103.50	17,408,700.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	39.95	1,598,000.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	28.30	826,360.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	21.20	572,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	31.25	434,875.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	35.50	923,000.00	
	SINO LAND CO	18,000	11.40	205,200.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	108.80	2,143,360.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	49.30	207,060.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	22.55	112,750.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	43.95	1,010,850.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.52	347,160.00	
	PCCW LTD	4,000	4.58	18,320.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	42.35	186,340.00	

	CLP HOLDINGS LTD	24,000	72.20	1,732,800.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.59	235,290.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	156,874	10.98	1,722,476.52	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	41.35	744,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	120.50	192,800.00	
	香港ドル 小計	1,077,990		53,867,097.52 (730,437,842)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.12	97,280.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.72	44,640.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	4.37	114,931.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.86	69,488.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	5.36	135,072.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,500	26.07	638,715.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,800	10.55	483,190.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,600	23.94	397,404.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	9.95	114,425.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	3.11	154,878.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.18	21,540.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.45	15,645.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	19.93	81,713.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.38	292,978.00		
	シンガポールドル 小計	443,800		2,661,899.00 (211,248,304)	
イスラエルシュ ケル	ICL GROUP LTD	4,122	19.11	78,771.42	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	466.00	177,546.00	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	23.05	420,224.55	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	19.85	355,791.40	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	12.52	94,137.88	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	76.89	108,722.46	
	AZRIELI GROUP	234	203.50	47,619.00	
	NICE SYSTEMS LTD	960	897.00	861,120.00	
	イスラエルシュケル 小計	50,785		2,143,932.71 (69,270,465)	
	合 計	14,636,146		69,644,174,443 (69,644,174,443)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	8,437	137,944.95	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	303,201.12	
		AMERICAN TOWER CORP	6,152	1,397,672.88	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	136,078.56	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	349,864.99	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,200	207,020.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	118,046.32	
		CROWN CASTLE INTL CORP	6,024	990,707.04	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	504,496.12	
		DUKE REALTY CORP	5,513	229,230.54	
		EQUINIX INC	1,170	830,477.70	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	153,497.10	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,175	349,209.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	970	261,269.50	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,920	224,409.60	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	235,329.64	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	156,345.70	
		INVITATION HOMES INC	7,683	238,173.00	
		IRON MOUNTAIN INC	4,068	134,935.56	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	133,470.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,702	235,114.28	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	87,258.50	
		PROLOGIS INC	10,311	1,110,185.37	
		PUBLIC STORAGE	2,131	494,093.66	
		REALTY INCOME CORP	4,769	297,871.74	
		REGENCY CENTERS CORP	1,514	79,666.68	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	398,549.40			
SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	465,229.08			
SUN COMMUNITIES INC	1,389	206,669.31			

	UDR INC	3,355	143,292.05
	VENTAS INC	5,547	281,343.84
	VEREIT INC	2,220	83,916.00
	VICI PROPERTIES INC	7,940	216,444.40
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	48,333.01
	WELLTOWER INC	5,753	388,385.03
	WEYERHAEUSER CO	10,330	361,963.20
	WP CAREY INC	2,436	171,470.04
	米ドル 小計	169,000	12,161,164.91 (1,278,381,655)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	48,877.50
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	27,524.70
	カナダドル 小計	2,480	76,402.20 (6,329,158)
ユーロ	COVIVIO	522	34,243.20
	GECINA SA	569	67,142.00
	KLEPIERRE	1,289	24,413.66
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	132,891.06
	ユーロ 小計	4,661	258,689.92 (32,967,443)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	63,673.20
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	40,353.36
	SEGRO PLC	18,596	180,009.28
	英ポンド 小計	39,086	284,035.84 (41,426,627)
オーストラリアドル	DEXUS	13,745	119,856.40
	GOODMAN GROUP	23,275	418,019.00
	GPT GROUP	32,860	135,711.80
	MIRVAC GROUP	63,099	146,389.68
	SCENTRE GROUP	83,252	223,947.88
	STOCKLAND	29,890	140,184.10
	VICINITY CENTRES	42,168	64,727.88
	オーストラリアドル 小計	288,289	1,248,836.74 (101,905,077)
香港ドル	LINK REIT	31,300	2,106,490.00
		31,300	2,106,490.00

		香港ドル 小計	(28,564,004)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	126,791.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	158,702.40
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	47,840.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	74,305.00
	SUNTEC REIT	8,500	12,665.00
シンガポールドル 小計		185,460	420,303.40 (33,355,277)
合計			1,522,929,241 (1,522,929,241)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 592銘柄	97.5%		70.5%
	投資証券 37銘柄		2.5%	1.8%
カナダドル	株式 87銘柄	99.7%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.3%	0.0%
ユーロ	株式 233銘柄	99.6%		10.6%
	投資証券 4銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式 86銘柄	98.7%		4.6%
	投資証券 3銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式 39銘柄	100.0%		3.1%
スウェーデンクローナ	株式 38銘柄	100.0%		1.1%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 19銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式 58銘柄	93.9%		2.2%
	投資証券 7銘柄		6.1%	0.1%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 33銘柄	96.2%		1.0%
	投資証券 1銘柄		3.8%	0.0%
シンガポールドル	株式 14銘柄	86.4%		0.3%

	投資証券	5銘柄		13.6%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,307,780,161
コール・ローン	48,508,541
株式	11,945,125,872
投資証券	10,809,199
派生商品評価勘定	279,872,013
未収入金	200,481
未収配当金	3,246,817
差入委託証拠金	979,050,152
流動資産合計	14,574,593,236
資産合計	14,574,593,236
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	148,548
未払解約金	40,312,000
未払利息	131
流動負債合計	40,460,679
負債合計	40,460,679
純資産の部	
元本等	
元本	8,411,464,997
剰余金	
剰余金又は欠損金()	6,122,667,560
元本等合計	14,534,132,557
純資産合計	14,534,132,557
負債純資産合計	14,574,593,236

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	<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>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)

2021年 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	5,330,781,126円
期中追加設定元本額	5,640,162,763円
期中一部解約元本額	2,559,478,892円
期末元本額	8,411,464,997円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	500,833,827円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	948,384,952円
りそなラップ型ファンド(成長型)	972,998,135円
DCりそな グローバルバランス	8,806,695円

つみたてバランスファンド	358,658,216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	147,895,406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	14,994,810円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,263,333円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,206,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,222,337円
リスクコントロール・オープン	6,733,100円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	89,887,401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	2,167,487,730円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,158,690,786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	116,697,403円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	315,331,574円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	348,214,808円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	220,384,334円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	135,206,373円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	284,536,802円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	47,525,858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)	1,025,501円
2. 計算日における受益権の総数	8,411,464,997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	1.7279円
(10,000口当たり純資産額)	(17,279円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 2月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

株式	275,437,126
投資証券	1,280,932
合計	276,718,058

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2021年 2月15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	2,284,471,519	-	2,564,343,532	279,872,013
	合計	2,284,471,519	-	2,564,343,532	279,872,013

(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 2月15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	41,751,418	-	41,728,670	22,748
	米ドル	41,751,418	-	41,728,670	22,748
	売建	35,611,600	-	35,737,400	125,800
	米ドル	35,611,600	-	35,737,400	125,800
	合計	77,363,018	-	77,466,070	148,548

(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	79,958	6.12	489,342.96	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,577	77.82	434,002.14	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,253	186.90	234,185.70	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	16,741	6.79	113,671.39	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	14,710	4.50	66,224.42	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,326	42.74	142,153.24	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	4.64	8,816.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	10.27	32,792.11	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	8,612	34.40	296,252.80	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,840	28.00	51,520.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	16.28	38,192.88	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	875	97.15	85,006.25	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	17.36	55,552.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,085	72.46	78,619.10	
	51JOB INC-ADR	300	70.07	21,021.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,600	38.48	215,488.00	
	NIO INC - ADR	16,900	59.85	1,011,465.00	
	XPENG INC - ADR	2,200	46.89	103,158.00	
GSX TECHEDU INC- ADR	1,000	103.87	103,870.00		

HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,200	61.92	136,224.00
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	2,050	195.87	401,533.50
TAL EDUCATION GROUP- ADR	5,100	89.10	454,410.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	5,350	62.59	334,856.50
AUTOHOME INC-ADR	820	136.15	111,643.00
BAIDU INC - SPON ADR	3,650	313.00	1,142,450.00
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	1,500	153.12	229,680.00
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	18.72	29,952.00
HUYA INC-ADR	900	34.01	30,609.00
IQIYI INC-ADR	3,700	26.46	97,902.00
JOYY INC	720	135.26	97,387.20
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	27.20	45,995.20
MOMO INC-SPON ADR	1,950	19.98	38,961.00
NETEASE INC-ADR	5,510	132.12	727,981.20
SINA CORP	630	43.51	27,411.30
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,600	26.36	121,256.00
WEIBO CORP-SPON ADR	630	61.82	38,946.60
YANDEX NV-A	4,000	73.83	295,320.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	24,830	267.85	6,650,715.50
BAOZUN INC-SPN ADR	900	54.04	48,636.00
JD.COM INC-ADR	11,420	99.31	1,134,120.20
PINDUODUO INC-ADR	5,000	196.59	982,950.00
TRIP.COM GROUP LTD	6,450	37.01	238,714.50
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	6,100	33.09	201,849.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	5,297	15.18	80,408.46
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	35.24	66,215.96
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	1,600	24.48	39,168.00
BEIGENE LTD-ADR	600	380.78	228,468.00
HUTCHISON CHINA MEDITECH-ADR	900	34.79	31,311.00
ZAI LAB LTD-ADR	900	182.57	164,313.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	18,976	3.97	75,334.72
CREDICORP LTD	844	165.73	139,876.12
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	35,132	14.45	507,833.06
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	0.96	21,317.37
LUFAX HOLDING LTD	2,100	16.97	35,637.00

	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	50.39	25,195.00	
	KE HOLDINGS INC	1,200	67.32	80,784.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.81	8,225.28	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,200	114.87	137,844.00	
	GLOBANT SA	521	224.10	116,756.10	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	70.35	63,315.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,000	8.91	62,370.00	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	6.54	5,689.80	
	米ドル 小計	384,518		19,090,898.56 (2,006,835,256)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	189,600	13.27	2,515,992.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	42,200	88.19	3,721,618.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	304.68	563,658.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	43.60	619,120.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	52.45	388,130.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,100	202.72	1,033,872.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	339.45	1,028,533.50	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	153.35	421,712.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	33,900	33.95	1,150,905.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	76.09	167,398.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	70,200	60.83	4,270,266.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	93.10	446,880.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	45.95	243,535.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	89.51	693,254.95	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,100	138.87	3,624,507.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	231.38	660,589.90	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	20,400	39.16	798,864.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	35.54	586,410.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	34,800	109.83	3,822,084.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	30,800	19.62	604,296.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	452,000	13.85	6,260,200.00		
TELESITES SAB DE CV	19,700	20.27	399,319.00		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	76.24	472,688.00		
	メキシコペソ 小計	999,630		34,493,832.85 (181,782,499)	

ブラジルリアル	COSAN SA	2,000	87.59	175,180.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	49,500	28.50	1,410,750.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	63,200	28.44	1,797,408.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	23.40	243,360.00	
	BRADSPAR SA -PREF	3,300	62.60	206,580.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	32.83	325,017.00	
	GERDAU SA-PREF	15,200	24.11	366,472.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,200	28.11	286,722.00	
	SUZANO SA	10,207	70.72	721,839.04	
	VALE SA	48,800	93.89	4,581,832.00	
	WEG SA	11,550	86.67	1,001,038.50	
	CCR SA	13,400	12.46	166,964.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	8,010	66.90	535,869.00	
	RUMO SA	17,100	20.18	345,078.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,700	38.66	104,382.00	
	B2W CIA DIGITAL	2,800	85.41	239,148.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	11,200	24.61	275,632.00	
	LOJAS RENNER S.A.	9,800	39.90	391,020.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	39,000	25.91	1,010,490.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	9,600	22.25	213,600.00	
	VIA VAREJO SA	15,900	14.48	230,232.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.15	60,450.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUIC	1,700	88.95	151,215.00	
	RAIA DROGASIL SA	14,000	25.88	362,320.00	
	AMBEV SA	63,100	14.79	933,249.00	
	BRF SA	5,900	23.30	137,470.00	
	JBS SA	13,600	26.83	364,888.00	
	NATURA &CO HOLDING SA	12,000	53.30	639,600.00	
	HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	17.20	295,840.00	
	NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,000	95.09	570,540.00	
	HYPERA SA	4,000	33.82	135,280.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	18,120	22.40	405,888.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	58,890	25.20	1,484,028.00		
BANCO DO BRASIL S.A.	10,700	33.75	361,125.00		
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	40.77	179,388.00		

	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,200	27.76	1,782,192.00	
	ITAUSA SA	59,400	10.60	629,640.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	27,800	59.86	1,664,108.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,400	109.00	370,600.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	28.01	274,498.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	4,358	38.18	166,388.44	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	2,200	21.39	47,058.00	
	TOTVS SA	7,200	34.64	249,408.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	5,600	48.40	271,040.00	
	TIM SA	9,000	14.40	129,600.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	30.21	102,714.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	30.04	147,196.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	14,119	13.53	191,030.07	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	1,100	65.89	72,479.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	41.68	208,400.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	33.50	77,050.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	51.14	102,280.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	45.90	104,422.50	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,900	23.56	280,364.00	
	ブラジルリアル 小計	836,329		27,580,362.55 (538,920,284)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	8,648.00	49,250,360.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	2,189.00	32,447,547.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,512	41,000.00	61,992,000.00	
	FALABELLA SA	10,992	2,790.00	30,667,680.00	
	CENCOSUD SA	18,824	1,390.00	26,165,360.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	6,499.00	11,275,765.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,887.00	5,377,950.00	
	BANCO DE CHILE	601,649	79.90	48,071,755.10	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	594	32,480.00	19,293,120.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	40.70	39,142,166.80	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,182.50	6,154,912.50	
	COLBUN SA	83,944	137.51	11,543,139.44	
	ENEL AMERICAS SA	443,665	114.02	50,586,683.30	
	ENEL CHILE SA	369,172	56.35	20,802,842.20	

	チリペソ 小計	2,522,384		412,771,281.34 (60,058,221)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,150.00	152,701,600.00
	BANCOLOMBIA SA	2,542	30,850.00	78,420,700.00
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,980	31,800.00	190,164,000.00
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	23,300.00	60,300,400.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	23,680.00	157,306,240.00
	コロンビアペソ 小計	88,777		638,892,940.00 (19,166,788)
ユーロ	OPAP SA	2,135	10.66	22,759.10
	JUMBO SA	1,515	13.20	19,998.00
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	12.25	40,327.00
	ユーロ 小計	6,942		83,084.10 (10,588,237)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	3,050	16.10	49,120.25
	英ポンド 小計	3,050		49,120.25 (7,164,188)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	102.60	180,063.00
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	15.11	343,616.51
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	17.65	139,611.50
	KOC HOLDING AS	8,691	22.70	197,285.70
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	7.69	130,730.00
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	12.00	66,000.00
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	162.40	86,234.40
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,969	68.95	411,562.55
	AKBANK T.A.S.	43,035	6.64	285,752.40
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	9.92	314,672.32
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	6.50	162,753.50
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.88	85,282.56
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	11.26	135,784.34
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	16.67	318,246.97
	トルコリラ 小計	230,654		2,857,595.75 (42,778,208)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	678.00	507,822.00
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	75.80	534,011.00

	CEZ AS	2,147	539.00	1,157,233.00	
	チェココルナ 小計	9,941		2,199,066.00	(10,885,376)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,234.00	12,128,386.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	8,475.00	17,170,350.00	
	OTP BANK PLC	2,819	13,150.00	37,069,850.00	
	ハンガリーフォリント 小計	10,274		66,368,586.00	(23,587,395)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,010	59.76	239,637.60	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	19,031	5.80	110,455.92	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,815	189.45	343,851.75	
	LPP SA	19	7,925.00	150,575.00	
	CD PROJEKT SA	857	263.00	225,391.00	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	29.10	92,887.20	
	ALLEGRO.EU SA	3,100	69.00	213,900.00	
	DINO POLSKA SA	707	266.00	188,062.00	
	BANK PEKAO SA	2,676	64.66	173,030.16	
	PKO BANK POLSKI SA	11,255	28.08	316,040.40	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	196.10	105,501.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,829	30.48	238,627.92	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.40	30,073.60	
	PGE SA	9,929	6.79	67,417.91	
	ポーランドズロチ 小計	69,657		2,495,452.26	(70,696,162)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	9.85	275,800.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	330,000	3.81	1,257,300.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	43,000	14.02	602,860.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	268,000	2.43	651,240.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	6.24	87,360.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	2.74	180,840.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	46.05	805,875.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	26,000	9.14	237,640.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	5.68	272,640.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	10.04	481,920.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	8.74	314,640.00	

JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	15.30	229,500.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	7.13	156,860.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	14.00	280,000.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	16.38	155,610.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	8.45	109,850.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	74,000	11.40	843,600.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	6.02	264,880.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	64.15	224,525.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.56	99,680.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	35.80	751,800.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	15.62	203,060.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	3.64	160,160.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	4.76	142,800.00	
CITIC LTD	77,000	6.11	470,470.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	34,500	12.00	414,000.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	31.00	248,000.00	
HEBEI CONSTRUCTION GROUP C-H	8,000	3.30	26,400.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	27.00	216,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	26,000	24.85	646,100.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	17.36	222,208.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	6,700	36.70	245,890.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	12.92	253,232.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	7,250	33.35	241,787.50	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	41,000	4.65	190,650.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	19,000	64.40	1,223,600.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	8.39	167,800.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.01	180,300.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.45	109,000.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	11.22	201,960.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.91	127,660.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	39,000	7.67	299,130.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	5.72	102,960.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.85	177,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15,500	12.48	193,440.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.67	120,060.00	

BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.36	250,240.00	
BYD CO LTD-H	10,500	265.00	2,782,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	8.19	262,080.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	7,600	66.50	505,400.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	80,000	29.85	2,388,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	43,000	27.35	1,176,050.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	40,000	7.82	312,800.00	
MINTH GROUP LTD	10,000	39.05	390,500.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	16,000	21.75	348,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	15,000	145.30	2,179,500.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	3.65	197,100.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	28,800	36.15	1,041,120.00	
LI NING CO LTD	28,500	53.40	1,521,900.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,300	181.20	2,047,560.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	19.00	114,000.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	11,000	17.00	187,000.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.09	85,080.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10,000	82.15	821,500.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	25.80	64,500.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.07	149,800.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,200	84.80	356,160.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	75,600	757.00	57,229,200.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	29.80	238,400.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	1.68	233,520.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	3,000	159.10	477,300.00	
MEITUAN	47,500	445.00	21,137,500.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	14.12	203,328.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	12.70	177,800.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,000	52.20	417,600.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	7.10	223,650.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	122.02	134,222.00	
CHINA FEIHE LTD	16,000	23.20	371,200.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	37,000	49.00	1,813,000.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	20,000	71.25	1,425,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.62	140,910.00	

SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	7,000	75.45	528,150.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	15.00	390,000.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	77.20	463,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	8.93	133,950.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.77	415,440.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	142.70	856,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	9,000	54.10	486,900.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	24.70	98,800.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	14.00	56,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	54,000	27.40	1,479,600.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	20.05	401,000.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	11,000	57.00	627,000.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	128.00	921,600.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	15.74	503,680.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	13.20	149,160.00
SINOPHARM GROUP CO-H	17,600	18.88	332,288.00
3SBIO INC	13,000	7.97	103,610.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	600	419.20	251,520.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	13.82	221,120.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	4.25	46,750.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	4.52	108,480.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	124,000	8.22	1,019,280.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	12.24	220,320.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	186.00	353,400.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	16,000	42.45	679,200.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	13,500	97.50	1,316,250.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	17,500	5.59	97,825.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	160.00	336,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	42.45	254,700.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	142,250	7.58	1,078,255.00
SSY GROUP LTD	10,000	4.50	45,000.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	3,624	206.80	749,443.20
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	40,500	124.40	5,038,200.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	2.85	1,094,400.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,059,000	2.70	2,859,300.00

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	111,000	4.33	480,630.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	4.09	161,555.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	115,000	3.64	418,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,273,000	6.23	7,930,790.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	3.35	157,450.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	52,500	64.75	3,399,375.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	4.68	351,468.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.46	62,280.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	810,000	5.00	4,050,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.97	746,250.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.50	157,500.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	10.16	142,240.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.66	260,960.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	0.89	91,670.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,600	20.95	368,720.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,500	17.72	505,020.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.11	235,190.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	10.98	171,288.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	6.91	301,276.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	12.04	209,496.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	100,000	16.40	1,640,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	37,800	36.45	1,377,810.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	14.30	348,920.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	10,700	29.45	315,115.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.41	303,660.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	86,000	5.89	506,540.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	78,500	89.80	7,049,300.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	5,200	55.50	288,600.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	10.02	180,360.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	7.15	100,100.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	16.10	386,400.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	74,000	3.20	236,800.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	53,500	18.12	969,420.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	5.06	75,900.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	31.25	1,375,000.00	

CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	29.50	651,950.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	7.05	296,100.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	106,000	9.26	981,560.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	10.46	156,900.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	9.81	258,984.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	12,000	22.55	270,600.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	3.71	137,270.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	10.50	147,000.00	
LOGAN GROUP CO LTD	19,000	11.76	223,440.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,000	41.50	1,037,500.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	54.10	64,920.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	7.36	176,640.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.62	136,240.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	16,000	22.20	355,200.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	36,000	30.10	1,083,600.00	
WHARF HOLDINGS LTD	20,000	17.30	346,000.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	104,000	1.61	167,440.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	4.45	53,400.00	
CHINA YOUZAN LTD	204,000	3.88	791,520.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	34,000	37.85	1,286,900.00	
KINGSOFT CORP LTD	10,000	77.70	777,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	17.90	232,700.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,500	42.25	401,375.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	9,000	54.55	490,950.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	9,500	35.30	335,350.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	13.86	228,690.00	
LENOVO GROUP LTD	92,000	10.00	920,000.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,700	222.00	2,153,400.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	188,000	28.05	5,273,400.00	
ZTE CORP-H	8,800	21.75	191,400.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	614,000	1.12	687,680.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	26.30	157,800.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	3.15	182,700.00	
CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.69	185,900.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	36,200	29.85	1,080,570.00	

	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	49,000	14.14	692,860.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.85	109,150.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	40.50	486,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	8.24	214,240.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,900	125.10	1,363,590.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	38,000	13.70	520,600.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	2.50	130,000.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	52,000	7.50	390,000.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	5,000	60.25	301,250.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	19.66	1,022,320.00	
	香港ドル 小計	11,175,624		202,495,300.70 (2,745,836,277)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	50,000	3.11	155,500.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	19.50	56,550.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	30,700	7.50	230,250.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	16,700	8.55	142,785.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.44	72,240.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.28	62,928.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.23	73,813.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.50	70,950.00	
	MISC BHD	17,600	6.26	110,176.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.29	29,172.00	
	GENTING BHD	32,900	4.40	144,760.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.68	87,368.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	30.00	63,000.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	9.50	28,500.00	
	IOI CORP BHD	32,500	4.27	138,775.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	23.00	147,200.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	136.50	136,500.00	
	PPB GROUP BERHAD	8,220	18.70	153,714.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	6.03	103,414.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	4.94	150,176.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	12.70	300,990.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.13	163,134.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	4.05	67,230.00	

	SUPERMAX CORP BHD	19,217	6.24	119,914.08	
	TOP GLOVE CORP BHD	66,500	6.18	410,970.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	3.38	79,092.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	80,200	4.19	336,038.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	18.40	132,480.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	17.30	31,140.00	
	MALAYAN BANKING BHD	53,700	7.98	428,526.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	195,500	4.24	828,920.00	
	RHB BANK BHD	18,100	5.32	96,292.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.43	104,272.00	
	DIGI.COM BHD	39,700	3.77	149,669.00	
	MAXIS BHD	30,200	4.83	145,866.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	6.60	121,440.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,400	16.20	168,480.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	29,400	10.06	295,764.00	
	マレーシアリングット 小計	1,061,787		6,137,988.58	(159,587,703)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	20,000	111.50	2,230,000.00	
	PTT PCL-NVDR	154,400	40.25	6,214,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	58.00	765,600.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	39.75	655,875.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	63.25	2,074,600.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	10,800	375.00	4,050,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	59,300	63.25	3,750,725.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	8.00	716,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	9.40	991,700.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.80	298,560.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	29.00	1,409,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	33.50	690,937.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	13.50	1,189,350.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	33.00	544,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	79,400	58.50	4,644,900.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	27.25	1,545,075.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	34.75	225,875.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	13.80	670,680.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	132,600	20.80	2,758,080.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	126.50	759,000.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	37.50	502,500.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	126.00	982,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	21,300	145.00	3,088,500.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	12.50	312,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	106.00	1,049,400.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	22.40	409,920.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	69.25	567,850.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	66.00	501,600.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	67.25	605,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	52.00	1,528,800.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	8.00	771,200.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,100	408.00	2,080,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,600	173.00	2,871,800.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	57.00	1,630,200.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	9,700	32.25	312,825.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.26	277,426.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	51.25	486,875.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	184.00	736,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	65.50	1,172,450.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	80.75	589,475.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	32,200	35.00	1,127,000.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	51.75	579,600.00	
	タイパーツ 小計	1,541,325		58,370,228.50	(205,463,204)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	43.15	1,007,984.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	802.00	3,039,580.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	550.00	858,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,131	64.60	2,592,462.60	
	SM INVESTMENTS CORP	3,185	1,068.00	3,401,580.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	125.00	1,462,500.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	178.70	1,241,965.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	38.80	368,600.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,280	138.50	1,839,280.00	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	86.25	2,277,862.50	
	BDO UNIBANK INC	28,100	107.00	3,006,700.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	48.70	1,344,704.40	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	4.20	609,000.00	
	AYALA LAND INC	105,400	40.35	4,252,890.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	3.80	372,400.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	128,800	37.20	4,791,360.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,040.00	918,000.00	
	PLDT INC	980	1,350.00	1,323,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	26.30	420,800.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	289.20	908,088.00	
	フィリピンベソ 小計	693,348		36,036,756.50 (78,920,496)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,215.00	183,343,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	23,500.00	519,350,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	1,170.00	441,675,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	14,125.00	379,962,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	13,875.00	321,900,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,580.00	414,090,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	10,950.00	352,590,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	250,800	5,850.00	1,467,180,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	50,000	1,570.00	78,500,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	108,300	6,075.00	657,922,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	38,725.00	255,585,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	8,975.00	293,482,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	6,300.00	303,660,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	7,175.00	722,522,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,525.00	345,412,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	132,200	34,400.00	4,547,680,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	230,800	6,500.00	1,500,200,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	6,200.00	654,100,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	740,200	4,680.00	3,464,136,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,075.00	373,347,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	665,000	3,190.00	2,121,350,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,420.00	186,730,000.00	

	インドネシアルピア 小計	3,969,600		19,584,719,500.00 (148,843,868)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	38,800.00	19,012,000.00	
	S-OIL CORP	483	82,700.00	39,944,100.00	
	SK INNOVATION CO LTD	750	296,500.00	222,375,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,444	53,400.00	77,109,600.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,255	40,950.00	51,392,250.00	
	KOREA ZINC CO LTD	121	413,000.00	49,973,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	268,000.00	58,424,000.00	
	LG CHEM LTD	607	960,000.00	582,720,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	471,500.00	41,492,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	239	303,000.00	72,417,000.00	
	POSCO	989	271,000.00	268,019,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	286	147,000.00	42,042,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	400,500.00	44,055,000.00	
	CJ CORP	193	98,200.00	18,952,600.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	26,600.00	13,672,400.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	35,100.00	20,358,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	2,846	12,200.00	34,721,200.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	40,700.00	34,147,300.00	
	HANWHA CORPORATION	800	33,800.00	27,040,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	42,750.00	37,107,000.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	110	266,000.00	29,260,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	39,600.00	39,600,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	101,000.00	56,257,000.00	
	LG CORP	1,224	110,000.00	134,640,000.00	
	LOTTE CORP	242	35,050.00	8,482,100.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,073	131,000.00	140,563,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	13,500.00	32,467,500.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	6,480.00	44,757,360.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	454	309,500.00	140,513,000.00	
	S-1 CORPORATION	228	84,600.00	19,288,800.00	
CJ LOGISTICS	135	173,500.00	23,422,500.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	208,500.00	45,661,500.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	955	30,500.00	29,127,500.00		

PAN OCEAN CO LTD	3,277	4,835.00	15,844,295.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	48,550.00	46,899,300.00	
HANON SYSTEMS	2,393	18,350.00	43,911,550.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	885	331,500.00	293,377,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,979	245,000.00	484,855,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	464	113,000.00	52,432,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	118,500.00	39,816,000.00	
KIA MOTORS CORP	3,506	86,400.00	302,918,400.00	
COWAY CO LTD	531	71,600.00	38,019,600.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	44,150.00	28,874,100.00	
HLB INC	571	91,700.00	52,360,700.00	
LG ELECTRONICS INC	1,352	167,500.00	226,460,000.00	
KANGWON LAND INC	1,387	24,450.00	33,912,150.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	20,350.00	21,367,500.00	
KAKAO CORP	760	489,500.00	372,020,000.00	
NAVER CORP	1,629	366,500.00	597,028,500.00	
NCSOFT CORP	220	1,027,000.00	225,940,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	138,000.00	37,398,000.00	
PEARL ABYSS CORP	70	361,100.00	25,277,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	144,000.00	16,272,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	82,100.00	33,414,700.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	120,500.00	9,640,000.00	
SHINSEGAE INC	109	244,000.00	26,596,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	170,500.00	9,718,500.00	
E-MART INC	257	173,500.00	44,589,500.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	35,750.00	6,971,250.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	429,000.00	37,752,000.00	
KT&G CORP	1,569	80,500.00	126,304,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	125,000.00	31,375,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	575,000.00	7,475,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	422	229,500.00	96,849,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	63,100.00	27,069,900.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	125	1,672,000.00	209,000,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	722,000.00	22,382,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	852	141,400.00	120,472,800.00	

ALTEOGEN INC	240	143,100.00	34,344,000.00
CELLTRION INC	1,291	332,000.00	428,612,000.00
CELLTRION PHARM INC	238	172,600.00	41,078,800.00
HANMI PHARM CO LTD	87	360,000.00	31,320,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	227	799,000.00	181,373,000.00
SEEGENE INC	240	176,400.00	42,336,000.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	78,300.00	31,320,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	227	152,500.00	34,617,500.00
YUHAN CORP	539	66,700.00	35,951,300.00
HANA FINANCIAL GROUP	4,027	36,750.00	147,992,250.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	8,470.00	21,945,770.00
KB FINANCIAL GROUP INC	5,250	45,500.00	238,875,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,544	32,950.00	182,674,800.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	9,580.00	71,016,540.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	557	86,600.00	48,236,200.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	3,795.00	8,793,015.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	4,302	9,890.00	42,546,780.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	11,750.00	18,095,000.00
SAMSUNG CARD CO	517	32,350.00	16,724,950.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	39,750.00	32,754,000.00
DB INSURANCE CO LTD	726	38,950.00	28,277,700.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	968	20,600.00	19,940,800.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	381	169,500.00	64,579,500.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	71,700.00	69,262,200.00
DOUZONE BIZON CO LTD	190	114,000.00	21,660,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	430	194,500.00	83,635,000.00
KMW CO LTD	357	74,900.00	26,739,300.00
LG DISPLAY CO LTD	3,338	23,750.00	79,277,500.00
LG INNOTEK CO LTD	153	212,500.00	32,512,500.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	724	201,500.00	145,886,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	62,780	81,600.00	5,122,848,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	10,879	74,300.00	808,309,700.00
SAMSUNG SDI CO LTD	731	783,000.00	572,373,000.00
LG UPLUS CORP	2,330	12,500.00	29,125,000.00
SK TELECOM	534	246,000.00	131,364,000.00

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,411	23,950.00	81,693,450.00	
	KOREA GAS CORPORATION	525	33,000.00	17,325,000.00	
	SK HYNIX INC	7,250	126,000.00	913,500,000.00	
	韓国ウォン 小計	191,572		16,202,523,010.00 (1,544,100,442)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	15,000	91.90	1,378,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	40.90	1,267,900.00	
	CHINA STEEL CORP	150,000	23.40	3,510,000.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	45,000	79.90	3,595,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	52,000	89.80	4,669,600.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	70,000	68.50	4,795,000.00	
	TAIWAN CEMENT	61,477	40.85	2,511,335.45	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,000	1,040.00	2,080,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	27.05	1,054,950.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,174	398.00	1,263,252.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	33.70	1,063,235.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	29.40	646,800.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	22,000	41.80	919,600.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	413.50	835,270.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	182.00	1,106,560.00	
	GIANT MANUFACTURING	4,000	288.00	1,152,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	373.50	747,000.00	
	POU CHEN	34,000	28.80	979,200.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	598.00	2,392,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	268.00	2,144,000.00	
	STANDARD FOODS CORP	3,120	57.00	177,840.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	68.70	4,465,500.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	220.00	660,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	16.90	1,210,310.40	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	238,000	19.40	4,617,200.00		
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	140,906	24.10	3,395,834.60		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	130,627	20.60	2,690,916.20		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	107,416	17.45	1,874,409.20		
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	149,000	28.80	4,291,200.00		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	11.20	1,623,944.00		

TAISHIN FINANCIAL HOLDING	118,769	12.70	1,508,366.30	
TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.29	740,152.88	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	118,374	19.60	2,320,130.40	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	49,000	38.75	1,898,750.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,997	164.00	2,623,508.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	125,920	21.00	2,644,320.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	99,000	40.60	4,019,400.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	176,000	9.06	1,594,560.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	23.10	644,466.90	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	84,000	46.90	3,939,600.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	8.18	1,266,550.30	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,600	43.60	287,760.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	39.50	374,460.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	271.50	1,900,500.00	
ACER INC	38,000	26.50	1,007,000.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	349.50	1,852,000.50	
ASUSTEK COMPUTER INC	9,000	288.50	2,596,500.00	
AU OPTRONICS CORP	122,000	16.10	1,964,200.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	191.50	1,723,500.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	87.40	438,311.00	
COMPAL ELECTRONICS	46,000	21.90	1,007,400.00	
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	280.50	7,293,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	70.40	985,600.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	165,800	113.50	18,818,300.00	
INNOLUX CORP	90,000	14.60	1,314,000.00	
INVENTEC CORP	28,000	23.15	648,200.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,350	3,050.00	4,117,500.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	27,000	55.90	1,509,300.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	134.00	1,340,000.00	
PEGATRON CORP	26,000	78.40	2,038,400.00	
QUANTA COMPUTER INC	37,000	85.10	3,148,700.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	46.80	795,600.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	89.70	1,524,900.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	236.00	1,180,000.00	
WISTRON CORP	29,951	30.80	922,490.80	

	WIWYNN CORP	1,000	872.00	872,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	17,960	43.50	781,260.00	
	YAGEO CORPORATION	5,198	588.00	3,056,424.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	115.50	693,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	108.50	5,533,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	60.20	1,444,800.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	21,000	97.20	2,041,200.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	105.50	4,325,500.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,955.00	977,500.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	634.00	1,902,000.00	
	MEDIATEK INC	20,000	950.00	19,000,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	86.70	1,473,900.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	479.00	3,353,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	387.00	387,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	99.70	997,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	495.00	2,970,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	2,820.00	2,820,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	324,000	632.00	204,768,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	146,000	52.90	7,723,400.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	126.00	1,512,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	370.50	1,482,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	28.30	1,188,600.00	
	新台湾ドル 小計	4,219,600		414,408,367.93 (1,554,031,379)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	8,598	418.10	3,594,823.80	
	COAL INDIA LTD	16,101	133.85	2,155,118.85	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	223.85	1,815,871.20	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	95.10	2,327,477.40	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	26,490	97.00	2,569,530.00	
	PETRONET LNG LTD	7,875	242.20	1,907,325.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	37,549	2,041.60	76,660,038.40	
	ACC LTD	1,105	1,765.75	1,951,153.75	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	277.45	2,147,463.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,129	2,486.10	12,751,206.90	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	770.35	2,032,953.65	

GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	1,242.10	4,014,467.20
HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,528	290.80	6,260,342.40
JSW STEEL LTD	9,306	403.80	3,757,762.80
PI INDUSTRIES LTD	1,184	2,225.00	2,634,400.00
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	1,760.70	3,748,530.30
SHREE CEMENT LTD	150	27,965.85	4,194,877.50
TATA STEEL LTD	9,239	680.50	6,287,139.50
ULTRATECH CEMENT LTD	1,426	6,397.25	9,122,478.50
UPL LTD	5,324	535.80	2,852,599.20
VEDANTA LTD	19,986	182.35	3,644,447.10
HAVELLS INDIA LTD	2,780	1,141.95	3,174,621.00
LARSEN & TOUBRO LTD	9,499	1,521.35	14,451,303.65
SIEMENS LTD	766	1,846.15	1,414,150.90
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,672	616.60	4,113,955.20
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	549.50	2,257,346.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,643.15	2,134,451.85
BAJAJ AUTO LTD	881	4,136.05	3,643,860.05
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	1,655.15	2,011,007.25
BHARAT FORGE LTD	3,030	640.10	1,939,503.00
EICHER MOTORS LTD	1,839	2,781.25	5,114,718.75
HERO MOTOCORP LTD	1,613	3,515.75	5,670,904.75
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,773	908.55	9,787,809.15
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,802	7,568.50	13,638,437.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	12,820	197.30	2,529,386.00
MRF LTD	27	91,278.05	2,464,507.35
TATA MOTORS LTD	22,991	325.40	7,481,271.40
PAGE INDUSTRIES LTD	54	30,692.15	1,657,376.10
TITAN CO LTD	4,773	1,494.20	7,131,816.60
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	2,789.30	3,126,805.30
INFO EDGE INDIA LTD	964	5,373.80	5,180,343.20
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	212.50	1,979,862.50
TRENT LTD	2,541	685.65	1,742,236.65
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,002	2,928.90	5,863,657.80
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,464	3,421.25	5,008,710.00
ITC LTD	39,545	217.45	8,599,060.25

NESTLE INDIA LTD	452	17,294.30	7,817,023.60
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,154	607.50	4,953,555.00
UNITED SPIRITS LTD	3,058	567.65	1,735,873.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,591.05	2,680,919.25
DABUR INDIA LTD	7,196	534.00	3,842,664.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	754.30	4,058,134.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,853	2,241.55	24,327,542.15
MARICO LTD	7,098	411.65	2,921,891.70
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,300	2,748.10	3,572,530.00
AUROBINDO PHARMA LTD	3,700	929.95	3,440,815.00
BIOCON LTD	5,970	408.05	2,436,058.50
CIPLA LTD	6,268	848.55	5,318,711.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,884	3,719.40	7,007,349.60
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,471	4,792.00	7,049,032.00
IPCA LABORATORIES LTD	1,001	1,897.95	1,899,847.95
LUPIN LTD	2,363	1,053.00	2,488,239.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,895	627.15	6,832,799.25
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,601.85	1,248,888.00
AXIS BANK LTD	29,968	750.40	22,487,987.20
BANDHAN BANK LTD	9,895	337.50	3,339,562.50
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	22,428	2,791.50	62,607,762.00
ICICI BANK LTD	67,302	647.60	43,584,775.20
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	7,353	1,951.05	14,346,070.65
STATE BANK OF INDIA	22,200	393.15	8,727,930.00
YES BANK LTD	141,484	16.40	2,320,337.60
BAJAJ FINANCE LTD	3,685	5,577.45	20,552,903.25
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,998.40	2,128,864.00
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,315.00	2,385,410.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,198	1,729.95	2,072,480.10
REC LTD	14,000	147.30	2,062,200.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,438.25	3,936,490.25
BAJAJ FINSERV LTD	521	10,278.80	5,355,254.80
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	8,748	710.95	6,219,390.60
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,586	1,494.90	3,865,811.40
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	487.25	1,815,980.75

	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,992	896.85	4,477,075.20	
	DLF LTD	9,206	311.75	2,869,970.50	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	14,482	960.40	13,908,512.80	
	INFOSYS LTD	44,914	1,309.80	58,828,357.20	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	4,039.90	3,021,845.20	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	12,388	3,190.80	39,527,630.40	
	TECH MAHINDRA LTD	8,467	991.20	8,392,490.40	
	WIPRO LTD	14,289	442.00	6,315,738.00	
	BHARTI AIRTEL LTD	15,312	586.25	8,976,660.00	
	INDUS TOWERS LTD	2,400	245.65	589,560.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,600	1,068.95	5,986,120.00	
	GAIL INDIA LTD	24,471	132.90	3,252,195.90	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	559.80	2,640,016.80	
	NTPC LTD	63,698	95.95	6,111,823.10	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	29,117	212.65	6,191,730.05	
	インドルピー 小計	1,037,576		751,077,918.10 (1,096,573,760)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	18.01	115,264.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.38	125,343.53	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	1.96	95,644.80	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	12.22	292,216.86	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	4.40	95,744.00	
	MASRAF AL RAYAN	44,940	4.39	197,286.60	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	8.91	83,614.24	
	QATAR ISLAMIC BANK	15,926	16.86	268,512.36	
	QATAR NATIONAL BANK	60,107	17.02	1,023,021.14	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.35	82,969.15	
	QOOREDOO QPSC	12,412	8.60	106,743.20	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	17.90	144,954.20	
	カタールリアル 小計	313,315		2,631,314.08 (75,571,340)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	172.92	484,176.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	278.56	456,002.72	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	677	1,668.37	1,129,486.49	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,636	346.54	1,953,099.44	

GOLD FIELDS LTD	11,992	137.11	1,644,223.12	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	58.65	404,391.75	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	10,824	225.20	2,437,564.80	
KUMBA IRON ORE LTD	703	617.46	434,074.38	
NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	205.07	1,021,248.60	
SASOL LTD	7,017	200.24	1,405,084.08	
SIBANYE STILLWATER LTD	27,980	64.84	1,814,223.20	
BIDVEST GROUP LTD	4,193	175.00	733,775.00	
MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	133.54	815,662.32	
MR PRICE GROUP LTD	2,802	187.46	525,262.92	
NASPERS LTD-N SHS	5,730	3,711.00	21,264,030.00	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,960	46.93	608,212.80	
BID CORP LTD	4,319	284.35	1,228,107.65	
CLICKS GROUP LTD	3,433	255.32	876,513.56	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,519	144.44	941,604.36	
SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	202.41	514,323.81	
TIGER BRANDS LTD	2,099	216.44	454,307.56	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,174	144.60	748,160.40	
ABSA GROUP LTD	9,806	134.07	1,314,690.42	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	941	1,405.00	1,322,105.00	
NEDBANK GROUP LTD	5,252	137.73	723,357.96	
STANDARD BANK GROUP LTD	17,330	141.27	2,448,209.10	
FIRSTRAND LTD	64,793	51.82	3,357,573.26	
REINET INVESTMENTS SCA	2,213	290.25	642,323.25	
REMGRO LTD	7,030	108.85	765,215.50	
DISCOVERY LTD	5,539	145.32	804,927.48	
OLD MUTUAL LTD	59,174	14.28	845,004.72	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	31.66	317,043.24	
SANLAM LTD	21,916	62.65	1,373,037.40	
NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	91.19	544,313.11	
MTN GROUP LTD	20,781	74.46	1,547,353.26	
VODACOM GROUP LTD	7,934	129.72	1,029,198.48	
南アフリカランド 小計	375,711		58,927,887.14 (426,048,624)	
アラブディルハ	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	33,706	6.68	225,156.08

ム	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	4.89	99,623.97
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	4.93	100,769.20
	EMIRATES NBD PJSC	34,921	11.60	405,083.60
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,331	14.90	556,231.90
	ALDAR PROPERTIES PJSC	51,017	3.73	190,293.41
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.66	50,918.84
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	3.77	185,382.21
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,250	19.92	423,300.00
アラブディルハム 小計		298,885		2,236,759.21 (64,127,886)
クウェートディ ナール	AGILITY	17,000	0.74	12,665.00
	BOUBAYAN BANK K.S.C	13,763	0.55	7,597.17
	GULF BANK	19,790	0.21	4,314.22
	KUWAIT FINANCE HOUSE	55,281	0.71	39,691.75
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	85,336	0.83	71,596.90
	MABANEE CO KPSC	7,369	0.66	4,915.12
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	28,329	0.62	17,818.94
クウェートディナール 小計		226,868		158,599.10 (55,222,620)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	4.66	9,320.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.17	49,206.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	16.73	92,015.00
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	2.48	2,728.00
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.80	2,400.00
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.20	91,140.00
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	2,500	10.30	25,750.00
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	520	4.67	2,428.40
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	5.42	1,626.00
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	8.09	29,933.00
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	52.80	47,520.00
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	8.88	8,800.08
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	3.59	7,539.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	51.89	145,292.00
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	6.81	128,709.00
BBMG CORPORATION-A	900	2.72	2,448.00	

BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,800	56.06	100,908.00	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.86	38,064.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	27.58	79,982.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	6.58	44,744.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	18.77	9,385.00	
GEM CO LTD-A	3,500	7.51	26,285.00	
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	4.60	6,440.00	
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	30.29	15,145.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	700	100.00	70,000.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	46.14	167,026.80	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	16.57	32,311.50	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.06	3,090.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	19.83	21,813.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	4.78	16,730.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.15	20,585.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.43	19,005.00	
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	9.27	17,613.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	161.51	48,453.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	22.92	6,876.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	133.99	147,389.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	29.50	94,400.00	
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	48.48	82,416.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.04	14,688.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	44.10	149,940.00	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,568	21.73	34,072.64	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	48.70	68,180.00	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	4.19	41,900.00	
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	55.68	44,544.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	19.27	42,394.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	300	104.08	31,224.00	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	3.58	17,184.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	84.99	50,994.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	25.03	55,066.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.66	2,196.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	400	179.91	71,964.00	

TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	14.24	15,664.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	28.69	43,035.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.44	3,660.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	5.99	7,787.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	140.42	322,966.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	90.51	36,204.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	20.83	24,996.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	8.77	20,872.60
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	143.53	86,118.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	260	98.13	25,513.80
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	9.03	20,769.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	17.61	7,044.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	8.15	3,260.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	12.08	213,816.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	21.35	21,350.00
AECC AVIATION POWER CO-A	1,400	64.91	90,874.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	11.60	34,800.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,100	80.82	88,902.00
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	2,500	31.64	79,100.00
AVICOPTER PLC-A	500	55.47	27,735.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	55.47	77,658.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	6.56	15,088.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	16.90	1,690.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	6.59	3,295.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	6.29	3,145.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.36	114,704.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	25,300	4.09	103,477.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	4.80	143,040.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,900	412.66	784,054.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	11.94	7,164.00
EAST GROUP CO LTD-A	3,000	6.23	18,690.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	111.00	168,720.00
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	6.49	2,706.33
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	40.45	40,450.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	198.21	79,284.00

HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	46.80	28,080.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	64.28	19,284.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	10.32	14,448.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	127.24	131,820.64
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	9.52	24,752.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	1,800	2.80	5,040.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	33.78	119,547.42
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.71	14,840.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	47.93	297,166.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.86	16,016.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.63	4,504.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,800	114.10	205,380.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	11.25	14,625.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	119.09	178,635.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	28.90	37,570.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	8.68	3,472.00
TBEA CO LTD-A	400	13.93	5,572.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	18.20	16,380.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	25.37	149,683.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	6.91	7,601.00
XIAMEN C & D INC-A	300	7.99	2,397.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	15.17	6,068.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	700	85.10	59,570.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	35.96	71,920.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	136.01	57,124.20
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	25.49	76,215.10
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	21.23	27,599.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	14.25	2,850.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	14.90	95,360.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.31	19,006.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	97.60	78,080.00
AIR CHINA LTD-A	800	7.79	6,232.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	10,400	5.46	56,784.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	4.75	6,175.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.16	56,056.00

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	9,900	10.87	107,613.00
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	6.55	72,705.00
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	12.25	9,800.00
S F HOLDING CO LTD-A	3,500	117.10	409,850.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	58.18	58,180.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.41	4,410.00
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	7.79	14,801.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.09	8,180.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	64.00	6,400.00
STO EXPRESS CO LTD-A	3,400	10.32	35,088.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	11.68	46,720.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	17.42	20,381.40
BYD CO LTD -A	1,600	266.95	427,120.00
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	212.00	42,400.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	4,300	19.02	81,786.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	59.98	113,962.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	29.48	41,272.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	25.43	30,516.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	43.74	34,992.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	21.93	151,536.30
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	53.80	5,380.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	23.69	2,369.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	34.90	198,930.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	39.83	3,983.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	88.70	70,960.00
JOYOUNG CO LTD -A	600	32.49	19,494.00
NAVINFO CO LTD-A	900	17.03	15,327.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	163.72	22,920.80
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	36.73	14,692.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	9.13	56,606.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	300	71.04	21,312.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.15	3,660.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	81.38	24,414.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	39.39	39,390.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	57.59	34,554.00

SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	7.15	7,865.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	18.69	20,185.20
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	13.20	17,160.00
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	21.12	16,896.00
CHINA FILM CO LTD-A	200	13.15	2,630.00
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	9.16	1,832.00
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	12.29	148,709.00
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	330.13	33,013.00
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	17.37	3,474.00
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	3.05	12,505.00
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	79.50	104,145.00
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	10.23	11,253.00
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	8.43	2,529.00
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	23.69	31,981.50
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	29.22	26,298.00
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	6.19	18,570.00
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,700	387.86	659,362.00
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	22.14	4,428.00
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	10.23	51,150.00
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	6.72	22,176.00
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.43	26,580.00
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	600	96.85	58,110.00
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	78.40	21,952.00
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	106.00	44,520.00
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	7.25	22,475.00
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	59.69	41,783.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	252.53	75,759.00
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	64.40	32,200.00
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	9.06	4,530.00
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	63.80	38,280.00
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.51	15,624.00
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	66.51	26,604.00
CHONGQING BREWERY CO-A	400	162.00	64,800.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	50.69	35,483.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,300	206.11	474,053.00

FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	277.50	111,000.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	29.48	26,532.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	86.05	111,865.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	16.08	40,200.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	51.28	123,072.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	46.49	195,258.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	61.50	61,500.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	228.81	320,334.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	15.93	31,860.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	66.81	20,043.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	104.11	31,233.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,000	2,601.00	2,601,000.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	313.99	313,990.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,940	124.55	366,177.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	23.84	61,984.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	800	443.54	354,832.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	94.40	37,760.00
TOLY BREAD CO LTD-A	500	56.38	28,190.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	54.06	178,398.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	95.78	9,578.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	17.53	99,219.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,200	342.65	1,096,480.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	18.78	20,658.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	22.13	28,769.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	25.59	25,590.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	209.20	20,920.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	51.45	30,870.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,521	91.10	320,763.10
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	131.16	13,116.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	38.73	7,746.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	39.71	15,884.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	166.35	33,270.00
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	300	90.00	27,000.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	29.91	7,178.40
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	235.27	70,581.00

JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	93.00	35,340.00
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	27.99	13,995.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	17.15	3,430.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	33.72	23,604.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	16.88	8,102.40
OVCTEK CHINA INC-A	300	125.26	37,578.00
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	41.29	24,774.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	18.52	3,704.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	494.55	346,185.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	388.00	38,800.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	16.07	16,712.80
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	23.62	21,258.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	329.35	65,870.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	43.52	47,001.60
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	141.45	42,435.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	161.04	48,312.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	494.52	197,808.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	37.07	22,242.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	26.18	2,618.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,300	212.60	276,380.00
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	33.54	20,124.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	42.91	4,291.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	28.79	5,758.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	190.36	57,108.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	53.98	42,104.40
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	19.66	13,762.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	30.01	42,014.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	4,180	109.20	456,456.00
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.40	15,400.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	23.97	21,573.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.69	20,304.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	36.89	18,445.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	44.43	44,430.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	34.07	22,145.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	21.46	5,579.60

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	50.31	60,372.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.86	22,794.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	19.45	17,505.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	203.20	121,920.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	38.54	3,854.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	23.92	23,920.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	20.17	4,034.00	
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	3.95	8,690.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.01	2,402.00	
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	54.66	32,796.00	
WUXI APPTec CO LTD-A	1,440	185.00	266,400.00	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	20.70	20,700.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	160.80	176,880.00	
ZHANGZHOU PIENZHEHUANG PHA-A	600	393.96	236,376.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	26.75	32,367.50	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	40.33	71,787.40	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	92.30	36,920.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.21	161,463.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.78	89,386.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	10.38	15,570.00	
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.20	52,160.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.53	123,216.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	17.47	101,326.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	5.68	18,176.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	8.82	78,498.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	42.53	212,650.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.51	74,973.10	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	7.16	21,480.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	4.15	144,835.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,300	54.55	943,715.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	5.16	153,768.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.32	27,808.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	5.25	190,050.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	26.64	479,520.00	
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	23.82	312,042.00	

SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	10.69	207,386.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	3.98	3,582.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	11.15	16,725.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.11	48,348.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.42	29,176.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	11.06	33,180.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	23.40	156,780.00	
CITIC SECURITIES CO-A	8,600	27.87	239,682.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,500	37.01	92,525.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.41	2,082.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	8,420	38.49	324,085.80	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	15.83	50,656.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.81	3,905.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.45	60,840.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	15.86	93,574.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	13.86	33,264.00	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	15.55	34,210.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.98	55,108.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	16.31	112,539.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.89	3,945.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	11.97	106,533.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	159.79	79,895.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	6.57	2,628.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	17.29	95,095.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	10.01	3,003.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.48	56,816.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	10.35	16,560.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.66	25,980.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	2.80	3,360.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	9.67	50,284.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.17	10,144.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	3,600	12.38	44,568.00	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.58	11,450.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.04	2,816.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.68	71,136.00	

SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	13.24	56,932.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	8.45	2,535.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.67	17,746.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	5.06	21,758.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	9.00	4,500.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	12.89	16,757.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	33.62	84,050.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	39.15	172,260.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	3.75	2,250.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	49.02	93,138.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	5.96	20,860.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	8,900	79.25	705,325.00
CHINA FORTUNE LAND DEVELOP-A	1,430	9.45	13,513.50
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	17.97	12,579.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	11.78	42,408.00
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	28.83	256,587.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	5.84	2,336.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	44.00	35,200.00
GEMDALE CORP-A	3,300	11.56	38,148.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	5.25	6,300.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	7.67	23,777.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	7.02	4,914.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	13.83	114,789.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	6.38	3,828.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,400	18.67	26,138.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	16.40	14,760.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.06	3,672.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	6.03	20,502.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	7.96	24,676.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.67	13,617.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	16.27	65,080.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	25.60	12,288.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	33.96	3,396.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	18.00	12,600.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	800	17.44	13,952.00

CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	53.34	10,668.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	16.30	11,410.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.29	2,916.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	106.35	73,275.15
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	53.55	53,550.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	27.80	22,240.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	100	317.93	31,793.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	66.60	26,640.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	142.14	42,642.00
VENUSTECH GROUP INC-A	400	30.13	12,052.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	6.26	5,634.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	43.26	99,844.08
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	23.86	14,316.00
ADDSINO CO LTD -A	1,700	20.10	34,170.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	77.15	69,435.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	42.44	21,220.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	6.19	212,317.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	43.72	30,604.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	15.87	41,262.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	18.63	20,493.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	14.04	53,352.00
GOERTEK INC -A	2,000	34.16	68,320.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	8.96	19,712.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	10.51	26,275.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.07	2,721.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	144.60	72,300.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	12.08	2,416.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	21.73	21,730.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	30.64	18,384.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	32.84	151,064.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	6.08	13,984.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	5,533	52.78	292,031.74
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	200	647.88	129,576.00
NINESTAR CORP-A	100	26.39	2,639.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	10.36	4,144.00

SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	23.32	23,320.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	112.92	31,617.60	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	19.44	19,440.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	32.10	28,890.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	22.50	15,750.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	40.55	28,385.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	15.50	4,650.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	20.93	39,264.68	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	19.14	24,882.00	
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	8.79	9,669.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	114.09	79,863.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	42.11	57,269.60	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	7.81	19,525.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	16.98	27,168.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	97.20	38,880.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	91.13	27,339.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	23.28	55,872.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	50.46	25,230.00	
ZTE CORP-A	2,700	32.21	86,967.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.82	20,726.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,400	19.69	342,606.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.08	4,004.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	3.84	3,072.00	
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	2,400	10.29	24,696.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	8.28	54,648.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	6.68	14,696.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.10	3,570.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	5.64	3,384.00	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	700	10.89	7,623.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.55	15,265.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	540	183.82	99,262.80	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,000	105.99	105,990.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	24.60	49,200.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	39.94	47,928.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	121.98	317,148.00	

	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	201.59	40,318.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	28.25	124,300.00	
	SG MICRO CORP-A	100	269.60	26,960.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	133.60	33,400.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	28.09	64,607.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	13.01	24,719.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	26.02	20,816.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	116.00	58,000.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	302.97	242,376.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	8.44	12,660.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	41.69	37,521.00	
	オフショア人民元 小計	1,318,888		32,976,455.26 (539,824,572)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	13.88	22,582.76	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	29,604	34.55	1,022,818.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	66.10	77,601.40	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	13.40	50,678.80	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	2,572	97.80	251,541.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	19.14	66,990.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	5,424	48.95	265,504.80	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	12,072	102.80	1,241,001.60	
	SAUDI CEMENT	1,265	65.10	82,351.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	27.10	80,839.30	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	14.66	119,303.08	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	65.70	239,082.30	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	74.60	31,481.20	
	JARIR MARKETING CO	611	174.00	106,314.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	125.20	50,831.20	
	ALMARAI CO	3,167	51.80	164,050.60	
	SAVOLA	3,337	39.50	131,811.50	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	117.00	91,962.00	
	AL RAJHI BANK	16,412	83.50	1,370,402.00	
	ALINMA BANK	12,351	16.22	200,333.22	
	ARAB NATIONAL BANK	8,707	20.40	177,622.80	
	BANK AL-JAZIRA	5,356	13.50	72,306.00	

BANK ALBILAD	5,393	29.00	156,397.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	7,513	31.80	238,913.40	
NATIONAL COMMERCIAL BANK	19,926	44.95	895,673.70	
RIYAD BANK	16,646	21.46	357,223.16	
SAMBA FINANCIAL GROUP	13,662	32.70	446,747.40	
SAUDI BRITISH BANK	8,978	25.65	230,285.70	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	116.00	92,800.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	82.00	54,202.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	8.41	33,152.22	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	8.76	37,624.20	
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	29.15	162,773.60	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	13.94	72,488.00	
SAUDI TELECOM CO	8,115	117.40	952,701.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	22.14	273,628.26	
サウジアラビアリアル 小計	240,409		9,922,019.50 (278,511,087)	
合 計	31,826,664		11,945,125,872 (11,945,125,872)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	45,800	1,095,078.00	
	メキシコペソ 小計		45,800	1,095,078.00 (5,771,061)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	696,837.96	
	南アフリカランド 小計		48,594	696,837.96 (5,038,138)	
合 計				10,809,199 (10,809,199)	

(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 62銘柄	100.0%		16.8%
メキシコペソ	株式 23銘柄	96.9%		1.5%
	投資証券 1銘柄		3.1%	0.0%
ブラジルレアル	株式 54銘柄	100.0%		4.5%
チリペソ	株式 14銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
英ポンド	株式 1銘柄	100.0%		0.1%
トルコリラ	株式 14銘柄	100.0%		0.4%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.2%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%		0.6%
香港ドル	株式 196銘柄	100.0%		23.0%
マレーシアリンギット	株式 38銘柄	100.0%		1.3%
タイバーツ	株式 42銘柄	100.0%		1.7%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	100.0%		0.7%
インドネシアルピア	株式 22銘柄	100.0%		1.2%
韓国ウォン	株式 106銘柄	100.0%		12.9%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%		13.0%
インドルピー	株式 96銘柄	100.0%		9.2%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%		0.6%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.8%		3.6%
	投資証券 1銘柄		1.2%	0.0%
アラブディルハム	株式 9銘柄	100.0%		0.5%
クウェートディナール	株式 7銘柄	100.0%		0.5%
オフショア人民元	株式 447銘柄	100.0%		4.5%
サウジアラビアリアル	株式 36銘柄	100.0%		2.3%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 2月15日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	7,784,251
コール・ローン	21,438,171
投資信託受益証券	5,312,895,353
流動資産合計	5,342,117,775
資産合計	
5,342,117,775	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,835,000
未払利息	58
流動負債合計	4,835,058
負債合計	
4,835,058	
純資産の部	
元本等	
元本	4,842,031,112
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	495,251,605
元本等合計	5,337,282,717
純資産合計	
5,337,282,717	
負債純資産合計	
5,342,117,775	

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	3,709,933,148円
期中追加設定元本額	3,397,189,442円
期中一部解約元本額	2,265,091,478円
期末元本額	4,842,031,112円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	768,269,287円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	511,493,022円
りそなラップ型ファンド(成長型)	271,936,589円
DCりそな グローバルバランス	13,522,003円
つみたてバランスファンド	527,255,018円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	223,306,610円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	112,697,552円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	69,266,488円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	11,316,268円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	8,091,538円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,104,804円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,954,751円
リスクコントロール・オープン	2,592,358円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	67,966,431円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	48,079,962円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	938,636,156円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,638,101円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	86,985,880円
Smart-i 8資産バランス 成長型	89,227,858円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	244,380,267円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	267,302,172円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	169,226,320円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	103,837,874円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	219,361,202円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	36,760,658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)	821,943円

2. 計算日における受益権の総数	4,842,031,112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	1.1023円
(10,000口当たり純資産額)	(11,023円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

投資信託受益証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 2月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		49,753,315
合計		49,753,315

(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	601,067	35,384,814.29	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	460,262	15,156,427.66	

	米ドル 小計	1,061,329	50,541,241.95 (5,312,895,353)
	合計		5,312,895,353 (5,312,895,353)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RAM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,775,368,203
投資証券	27,870,142,410
派生商品評価勘定	71,822,990
未収配当金	194,159,230
差入委託証拠金	82,253,500
流動資産合計	31,993,746,333
資産合計	31,993,746,333
負債の部	
流動負債	

2021年 2月15日現在

前受金	66,563,400
未払金	3,341,074,070
未払解約金	29,040,000
未払利息	10,240
流動負債合計	3,436,687,710
負債合計	3,436,687,710
純資産の部	
元本等	
元本	20,846,254,157
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,710,804,466
元本等合計	28,557,058,623
純資産合計	28,557,058,623
負債純資産合計	31,993,746,333

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 2月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	13,297,314,709円
期中追加設定元本額	17,733,978,373円
期中一部解約元本額	10,185,038,925円
期末元本額	20,846,254,157円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	810,733,595円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	533,012,500円
りそなラップ型ファンド(成長型)	391,730,555円
DCりそな グローバルバランス	16,953,718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	71,284,712円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	11,569,658円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	8,177,403円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,011,611円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,627,042円
リスクコントロール・オープン	2,147,414円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	57,805,774円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,273,012,624円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,332,919,801円
Smart-i Jリートインデックス	2,520,380,666円
Smart-i 8資産バランス 安定型	33,763,137円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	92,985,133円
Smart-i 8資産バランス 成長型	89,975,368円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	199,839,747円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	221,975,586円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	140,498,617円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	86,201,946円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	181,651,027円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	30,218,153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)	1,064,730円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	917,742,573円
J-REITインデックス202102(適格機関投資家専用)	2,371,034,993円
2. 計算日における受益権の総数	20,846,254,157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	1.3699円
(10,000口当たり純資産額)	(13,699円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15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）

2021年 2月15日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

投資証券	1,804,540,093
合計	1,804,540,093

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

2 デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

(2021年 2月15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	567,007,010	-	638,830,000	71,822,990
合計		567,007,010	-	638,830,000	71,822,990

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	437	55,630,100	
	サンケイリアルエステート投資法人	654	74,556,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	702	91,540,800	
	日本アコモデーションファンド投資法人	920	551,080,000	

MCUBS MidCity投資法人	3,268	361,114,000	
森ヒルズリート投資法人	3,137	457,688,300	
産業ファンド投資法人	3,775	717,627,500	
アドバンス・レジデンス投資法人	2,537	820,719,500	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,742	332,199,400	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,338	605,445,000	
GLP投資法人	8,346	1,482,249,600	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,201	379,516,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,222	1,435,480,000	
星野リゾート・リート投資法人	406	227,360,000	
Oneリート投資法人	416	124,550,400	
イオンリート投資法人	2,709	394,159,500	
ヒューリックリート投資法人	2,150	377,110,000	
日本リート投資法人	868	356,314,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,159	287,241,660	
積水ハウス・リート投資法人	7,856	646,548,800	
トーセイ・リート投資法人	591	73,697,700	
ケネディクス商業リート投資法人	982	262,881,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人	570	77,748,000	
サムティ・レジデンシャル投資法人	514	57,825,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,637	1,476,063,300	
いちごホテルリート投資法人	467	39,228,000	
ラサールロジポート投資法人	2,976	493,718,400	
スターアジア不動産投資法人	2,744	143,785,600	
マリモ地方創生リート投資法人	250	30,425,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	932	479,048,000	
大江戸温泉リート投資法人	431	33,359,400	
投資法人みらい	2,885	131,123,250	
森トラスト・ホテルリート投資法人	578	74,446,400	
三菱地所物流リート投資法人	601	254,523,500	
CREロジスティクスファンド投資法人	855	132,696,000	
ザイマックス・リート投資法人	409	45,439,900	
タカラレーベン不動産投資法人	803	91,301,100	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,036	137,166,400	
日本ビルファンド投資法人	3,006	1,926,846,000	

ジャパンリアルエステイト投資法人	2,671	1,738,821,000	
日本リテールファンド投資法人	5,018	1,103,458,200	
オリックス不動産投資法人	5,322	1,014,373,200	
日本プライムリアルティ投資法人	1,663	650,233,000	
プレミア投資法人	2,412	334,785,600	
東急リアル・エステート投資法人	1,791	319,335,300	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,855	215,180,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	5,712	839,664,000	
森トラスト総合リート投資法人	1,909	282,532,000	
インヴィンシブル投資法人	11,168	442,252,800	
フロンティア不動産投資法人	886	413,319,000	
平和不動産リート投資法人	1,639	235,196,500	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,745	545,312,500	
福岡リート投資法人	1,381	238,913,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	826	574,896,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,216	196,337,600	
大和証券オフィス投資法人	569	396,593,000	
阪急阪神リート投資法人	1,206	174,025,800	
スターツプロシード投資法人	416	88,067,200	
大和ハウスリート投資法人	3,811	1,107,476,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,604	519,681,600	
大和証券リビング投資法人	3,488	349,846,400	
ジャパンエクセレント投資法人	2,478	350,389,200	
合計	161,896	27,870,142,410	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

RAM先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 2月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	96,075,211
コール・ローン	13,538,946
株式	16,793,280
投資証券	23,932,764,076
派生商品評価勘定	181,471
未収入金	37,667,048
未収配当金	43,758,912
流動資産合計	24,140,778,944
資産合計	
24,140,778,944	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	209,100
未払解約金	20,279,000
未払利息	36
流動負債合計	20,488,136
負債合計	
20,488,136	
純資産の部	
元本等	
元本	22,246,292,394
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,873,998,414
元本等合計	24,120,290,808
純資産合計	
24,120,290,808	
負債純資産合計	
24,140,778,944	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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>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> <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)

2021年 2月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 3月31日
期首元本額	13,000,812,433円
期中追加設定元本額	19,603,237,891円
期中一部解約元本額	10,357,757,930円
期末元本額	22,246,292,394円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	576,154,519円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	696,634,613円
りそなラップ型ファンド（成長型）	2,119,481,450円
DCりそな グローバルバランス	6,804,845円
つみたてバランスファンド	551,362,751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	97,326,312円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	15,939,817円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	11,208,411円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,677,869円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,990,943円
リスクコントロール・オープン	10,608,562円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	70,619,210円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	8,312,884,086円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,392,792,578円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,418,174,978円
Smart-i 8資産バランス 安定型	40,972,682円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	112,833,619円
Smart-i 8資産バランス 成長型	128,339,234円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	499,205,324円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	548,785,882円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	347,323,754円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	213,083,433円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	449,680,563円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	75,175,648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）	1,872,400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	22,246,292,394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	1.0842円
(10,000口当たり純資産額)	(10,842円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 2月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 2月15日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 2月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		205,632
投資証券		708,486,089
合計		708,691,721

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

2 デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2021年 2月15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	49,122,919	-	49,296,590	173,671
	米ドル	49,122,919	-	49,296,590	173,671
	売建	57,895,200	-	58,096,500	201,300
	香港ドル	17,635,800	-	17,628,000	7,800
	シンガポールドル	40,259,400	-	40,468,500	209,100
合計		107,018,119	-	107,393,090	27,629

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	84,000	2.45	205,800.00	
オーストラリアドル 小計		84,000		205,800.00 (16,793,280)	
合計		84,000		16,793,280 (16,793,280)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	14,937	268,268.52	
		AGREE REALTY CORP	10,273	668,464.11	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	12,439	216,438.60	
		ALEXANDER'S INC	368	98,727.04	

ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,718	3,758,517.08	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	8,604	258,808.32	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	24,282	1,055,295.72	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	19,224	161,866.08	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	47,276	1,535,524.48	
AMERICOLD REALTY TRUST	36,008	1,283,325.12	
APARTMENT INCOME REIT CO	26,261	1,112,941.18	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	25,440	124,656.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,710	501,458.60	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,000	119,100.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,384	4,377,171.84	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	38,611.80	
BOSTON PROPERTIES INC	24,849	2,338,290.90	
BRANDYWINE REALTY TRUST	29,394	352,434.06	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52,157	1,008,194.81	
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	6,484	119,629.80	
BRT APARTMENTS CORP	877	13,225.16	
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,155	1,827,693.70	
CARETRUST REIT INC	16,895	389,429.75	
CENTERSPACE	2,204	159,790.00	
CHATHAM LODGING TRUST	8,481	103,553.01	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	23,860.00	
CITY OFFICE REIT INC	8,644	87,045.08	
CLIPPER REALTY INC	1,350	10,449.00	
COLONY CAPITAL INC	84,474	465,451.74	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,730	281,744.40	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,736	175,330.48	
COREPOINT LODGING INC	7,200	59,256.00	
CORESITE REALTY CORP	7,545	928,563.15	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	19,836	521,290.08	
COUSINS PROPERTIES INC	25,927	872,962.09	
CTO REALTY GROWTH INC	900	43,749.00	
CUBESMART	34,097	1,223,059.39	
CYRUSONE INC	21,210	1,537,937.10	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	34,437	309,588.63	

DIGITAL REALTY TRUST INC	48,963	6,857,757.78	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	40,962	183,509.76	
DOUGLAS EMMETT INC	29,081	864,578.13	
DUKE REALTY CORP	65,196	2,710,849.68	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	11,234.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	14,000	318,220.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,954	1,017,926.52	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	24,101	241,733.03	
EPR PROPERTIES	13,208	544,565.84	
EQUINIX INC	15,584	11,061,679.04	
EQUITY COMMONWEALTH	21,472	621,399.68	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	29,844	1,873,606.32	
EQUITY RESIDENTIAL	59,729	4,030,512.92	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,144	419,307.84	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,473	3,090,252.55	
EXTRA SPACE STORAGE INC	22,578	2,638,916.64	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	38,065.12	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,108	1,239,011.64	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	22,686	991,378.20	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,736	353,169.28	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,990	69,396.60	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	38,059	1,676,118.36	
GEO GROUP INC/THE	20,721	183,173.64	
GETTY REALTY CORP	6,175	174,567.25	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,178	119,235.40	
GLADSTONE LAND CORP	4,163	77,431.80	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	7,453	100,615.50	
GLOBAL NET LEASE INC	15,387	284,967.24	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,961	741,832.56	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	38,463	1,115,042.37	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	94,648	2,928,409.12	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	4,093	34,954.22	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	18,342	734,780.52	
HOST HOTELS & RESORTS INC	124,138	1,849,656.20	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,871	654,577.56	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	16,444	239,424.64	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	11,229	255,235.17	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,898	835,731.20	
INVITATION HOMES INC	97,629	3,026,499.00	
IRON MOUNTAIN INC	50,643	1,679,828.31	
JBG SMITH PROPERTIES	19,660	644,061.60	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	118,000	80,830.00	
KILROY REALTY CORP	18,485	1,114,460.65	
KIMCO REALTY CORP	76,059	1,371,343.77	
KITE REALTY GROUP TRUST	14,475	261,273.75	
LEXINGTON REALTY TRUST	48,408	540,717.36	
LIFE STORAGE INC	12,812	1,053,402.64	
LTC PROPERTIES INC	6,749	285,212.74	
MACERICH CO/THE	19,273	248,621.70	
MACK-CALI REALTY CORP	14,687	204,736.78	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	241,500	173,880.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	99,878	2,247,255.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	20,127	2,780,343.78	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	16,864	303,552.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	30,552	1,292,349.60	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,952	413,438.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,884	552,510.72	
NETSTREIT CORP	2,174	39,175.48	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	66,462.75	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,850	163,779.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	8,332	209,883.08	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,932	1,495,453.40	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	46,292.55	
PARAMOUNT GROUP INC	28,845	259,893.45	
PARK HOTELS & RESORTS INC	41,562	817,940.16	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	23,153	499,873.27	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,682	667,245.58	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,354	386,500.66	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	62,361.00	

PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	8,584	70,560.48	
PRIME US REIT	85,000	68,850.00	
PROLOGIS INC	129,319	13,923,776.73	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,489	506,184.12	
PUBLIC STORAGE	26,657	6,180,692.02	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	11,357	723,327.33	
REALTY INCOME CORP	61,507	3,841,727.22	
REGENCY CENTERS CORP	27,636	1,454,206.32	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	20,290	318,451.55	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	37,545	400,605.15	
RETAIL VALUE INC	3,515	60,668.90	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	22,944	1,181,616.00	
RLJ LODGING TRUST	29,208	415,337.76	
RPT REALTY	12,940	137,034.60	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,703	713,170.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	36,455	650,721.75	
SAFEHOLD INC	2,502	205,414.20	
SAUL CENTERS INC	2,130	72,143.10	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	6,786	123,844.50	
SERVICE PROPERTIES TRUST	28,456	341,187.44	
SIMON PROPERTY GROUP INC	57,489	6,281,248.14	
SITE CENTERS CORP	25,914	319,260.48	
SL GREEN REALTY CORP	12,804	832,131.96	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,753	814,218.66	
STAG INDUSTRIAL INC	26,236	854,244.16	
STORE CAPITAL CORP	41,345	1,361,490.85	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	19,040	184,497.60	
SUN COMMUNITIES INC	18,928	2,816,297.12	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,155	455,189.15	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	17,345	245,431.75	
TERRENO REALTY CORP	12,022	734,784.64	
UDR INC	51,848	2,214,428.08	
UMH PROPERTIES INC	7,056	116,635.68	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,201	139,763.50	
URBAN EDGE PROPERTIES	18,861	303,096.27	

	URSTADT BIDDLE - CLASS A	5,449	82,552.35
	VENTAS INC	65,289	3,311,458.08
	VEREIT INC	38,223	1,444,829.40
	VICI PROPERTIES INC	94,214	2,568,273.64
	VORNADO REALTY TRUST	27,648	1,061,406.72
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	4,054	48,972.32
	WASHINGTON REIT	14,167	329,241.08
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,745	528,167.70
	WELLTOWER INC	72,819	4,916,010.69
	WHITESTONE REIT	7,716	68,286.60
	WP CAREY INC	30,796	2,167,730.44
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	19,627	319,527.56
	米ドル 小計	4,266,995	168,512,397.21 (17,714,023,194)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,812	390,529.44
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,925	116,679.00
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	38,815.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,838	136,632.80
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,676	755,080.20
	CHOICE PROPERTIES REIT	27,939	356,781.03
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,714	131,248.88
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	8,506	122,401.34
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,959	138,685.32
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	15,723	203,927.31
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	75,466.08
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	18,666	277,190.10
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,679	432,285.48
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	24,460	319,936.80
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,727	158,314.50
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,477	152,331.69
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	3,394	68,117.58
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	3,847	56,743.25
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	17,280	224,294.40
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	36,600.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,137	488,194.63

	SLATE GROCERY REIT	4,620	53,823.00
	SLATE OFFICE REIT	4,169	17,968.39
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,390	310,493.40
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	13,293	182,512.89
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	4,800	30,480.00
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,500	132,535.00
	カナダドル 小計	299,913	5,408,067.51 (448,004,312)
ユーロ	AEDIFICA	5,759	577,051.80
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	31,856	434,515.84
	ALTAREA	659	92,128.20
	BEFIMMO	4,423	151,487.75
	CARE PROPERTY INVEST	4,100	103,115.00
	CARMILA	8,000	93,440.00
	COFINIMMO	4,724	619,788.80
	COVIVIO	8,469	555,566.40
	CROMWELL EUROPEAN REIT	225,700	113,978.50
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	6,310	99,067.00
	GECINA SA	9,466	1,116,988.00
	HAMBORNER REIT AG	11,172	99,095.64
	HIBERNIA REIT PLC	111,215	120,112.20
	ICADE	5,242	312,947.40
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,951	42,106.59
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	44,462	345,914.36
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	4,158	91,891.80
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	75,761	113,641.50
	KLEPIERRE	35,741	676,934.54
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	11,511	50,936.17
	MERCIALYS	7,081	54,806.94
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	58,287	455,221.47
	MONTEA	1,744	172,656.00
	NSI NV	3,522	113,056.20
	RETAIL ESTATES	1,704	103,092.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	24,141	1,406,454.66
	VASTNED RETAIL NV	2,832	62,870.40
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,749	661,085.94

	WERELDHAVE NV	7,169	84,880.96
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,850	142,072.50
	ユーロ 小計	751,758	9,066,904.56 (1,155,486,317)
英債券	AEW UK REIT PLC	20,000	16,520.00
	ASSURA PLC	463,400	334,574.80
	BIG YELLOW GROUP PLC	28,898	322,790.66
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	141,000	101,661.00
	BRITISH LAND CO PLC	164,055	754,653.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	159,605	255,368.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	105,935	113,986.06
	CUSTODIAN REIT PLC	77,000	69,916.00
	DERWENT LONDON PLC	19,707	616,829.10
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	101,057	69,729.33
	GCP STUDENT LIVING PLC	77,427	112,733.71
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	44,877	290,443.94
	HAMMERSON PLC	647,780	137,394.13
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	60,000	68,100.00
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	131,445	797,871.15
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	159,727	356,830.11
	LXI REIT PLC	103,361	131,268.47
	NEWRIVER REIT PLC	56,051	42,935.06
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	98,400	84,624.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	230,444	337,370.01
	RDI REIT PLC	48,350	43,998.50
	REGIONAL REIT LTD	63,471	48,301.43
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	36,357	281,948.53
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	40,987.18
	SEGRO PLC	208,920	2,022,345.60
	SHAFTESBURY PLC	53,158	300,608.49
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	42,435.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	112,136	122,228.24
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	62,802.58
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	298,379	546,331.94

	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	131,710	87,323.73
	UNITE GROUP PLC	69,705	666,728.32
	WORKSPACE GROUP PLC	21,840	152,880.00
	英bond 小計	4,282,941	9,434,518.07 (1,376,024,460)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	78,482	208,762.12
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	77,574.15
	ARENA REIT	53,742	165,525.36
	AVENTUS GROUP	62,000	172,360.00
	BWP TRUST	86,544	340,117.92
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	82,504	254,112.32
	CENTURIA OFFICE REIT	69,642	138,239.37
	CHARTER HALL GROUP	81,867	1,166,604.75
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	91,081	439,010.42
	CHARTER HALL RETAIL REIT	86,920	304,220.00
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	55,561	173,350.32
	CROMWELL PROPERTY GROUP	319,051	263,217.07
	DEXUS	192,032	1,674,519.04
	GDI PROPERTY GROUP	88,291	100,651.74
	GOODMAN GROUP	295,509	5,307,341.64
	GPT GROUP	343,057	1,416,825.41
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	52,477	166,876.86
	HOME CONSORTIUM	24,000	101,520.00
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	44,081	59,068.54
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	93,362.20
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	49,989	268,940.82
	IRONGATE GROUP	96,000	120,960.00
	MIRVAC GROUP	693,222	1,608,275.04
	NATIONAL STORAGE REIT	159,326	305,905.92
	RURAL FUNDS GROUP	57,679	143,620.71
	SCENTRE GROUP	913,056	2,456,120.64
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	190,453	458,991.73
	STOCKLAND	420,131	1,970,414.39
	VICINITY CENTRES	681,797	1,046,558.39
	WAYPOINT REIT LTD	132,972	331,100.28

オーストラリアドル 小計		5,558,705	21,334,147.15 (1,740,866,407)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	145,533	226,303.81
	GOODMAN PROPERTY TRUST	195,611	437,190.58
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	279,950	349,937.50
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	185,741	308,330.06
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	64,548	207,199.08
ニュージーランドドル 小計		871,383	1,528,961.03 (116,048,142)
香港ドル	CHAMPION REIT	338,000	1,487,200.00
	FORTUNE REIT	278,000	1,998,820.00
	LINK REIT	360,900	24,288,570.00
	PROSPERITY REIT	226,000	546,920.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	164,000	637,960.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	270,000	1,012,500.00
香港ドル 小計		1,636,900	29,971,970.00 (406,419,913)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	81,100	107,052.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	190,300	137,016.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	557,100	1,710,297.00
	ASCOTT TRUST	320,196	320,196.00
	CAPITALAND CHINA TRUST	166,100	232,540.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	796,632	1,704,792.48
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	129,100	154,920.00
	EC WORLD REIT	50,000	35,750.00
	ESR REIT	403,200	157,248.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	93,717.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	283,400	58,097.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	235,600	593,712.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	66,850.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	468,479	669,924.97
	IREIT GLOBAL	55,000	36,575.00
	KEPPEL DC REIT	225,600	658,752.00
	KEPPEL REIT	322,500	377,325.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	109,889.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	55,124.20

	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	384,800	800,384.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	293,600	825,016.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	494,900	955,157.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	362,700	350,005.50	
	OUÉ COMMERCIAL REAL ESTATE I	403,100	151,162.50	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	66,200	274,730.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	160,100	60,838.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	92,100	75,522.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	165,900	87,927.00	
	SPH REIT	161,200	133,796.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	251,500	130,780.00	
	SUNTEC REIT	379,300	565,157.00	
	シンガポールドル 小計	8,821,807	11,690,252.65 (927,738,450)	
韓国ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	19,740,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	93,240,000.00	
	LOTTE REIT CO LTD	22,200	112,776,000.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	16,000	63,680,000.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	8,600	61,060,000.00	
	韓国ウォン 小計	68,800	350,496,000.00 (33,402,268)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	29,265	456,534.00	
	イスラエルシェケル 小計	29,265	456,534.00 (14,750,613)	
合計			23,932,764,076 (23,932,764,076)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	投資証券 155銘柄		100.0%	73.9%
カナダドル	投資証券 27銘柄		100.0%	1.9%

ユーロ	投資証券	30銘柄		100.0%	4.8%
英ポンド	投資証券	34銘柄		100.0%	5.7%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.0%		0.1%
	投資証券	30銘柄		99.0%	7.3%
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%	1.7%
シンガポールドル	投資証券	31銘柄		100.0%	3.9%
韓国ウォン	投資証券	5銘柄		100.0%	0.1%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄		100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 2月26日現在です。

【りそな・リスクコントロールファンド2020-03】

【純資産額計算書】

資産総額	16,569,278,195円
負債総額	215,467,417円
純資産総額（ - ）	16,353,810,778円
発行済口数	15,814,974,788口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0341円

（参考）

RAM国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	84,205,008,360円
負債総額	1,446,321,524円
純資産総額（ - ）	82,758,686,836円
発行済口数	79,500,523,959口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0410円

RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

純資産額計算書

資産総額	211,876,265,991円
負債総額	10,623,227,371円
純資産総額（ - ）	201,253,038,620円
発行済口数	194,400,415,389口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0353円

RAM国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	41,376,356,627円
負債総額	301,741,856円
純資産総額（ - ）	41,074,614,771円
発行済口数	30,738,186,514口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3363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	88,107,081,220円
負債総額	1,401,997,617円
純資産総額（ - ）	86,705,083,603円
発行済口数	53,720,552,563口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6140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	13,788,241,179円
負債総額	245,540,109円
純資産総額（ - ）	13,542,701,070円
発行済口数	8,071,487,615口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6778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	5,339,847,569円
負債総額	100,383,290円
純資産総額（ - ）	5,239,464,279円
発行済口数	4,849,091,615口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0805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	27,065,529,718円
負債総額	133,907,811円
純資産総額（ - ）	26,931,621,907円
発行済口数	19,665,043,663口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3695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	25,715,726,300円
負債総額	223,206,097円
純資産総額（ - ）	25,492,520,203円
発行済口数	23,148,975,117口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1012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) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年2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2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2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	898,187
単位型株式投資信託	7	107,957
合計	92	1,006,145

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
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	
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
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。

(3) 保証会社

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

2【関係業務の概要】

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

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年12月28日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 畑中 建二 印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年4月5日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそな・リスクコントロールファンド2020-03の2020年3月31日から2021年2月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・リスクコントロールファンド2020-03の2021年2月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月4日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ 東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 畑中 建二 印

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第6期事業年度の中間会計期間

（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2020年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間

（2020年4月1日から2020年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。

- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。