

**【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8月17日提出
【計算期間】	第1期(自 2020年6月15日至 2021年5月17日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド2020-06
【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
一般	年6回			(部分ヘッジ)
公債	(隔月)	欧州		
社債				
その他債券	年12回	アジア		
クレジット属性 ( )	(毎月)	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
( )		アフリカ		
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))		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 ( )				
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

#### < 商品分類の定義 >

##### 1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

##### 2. 投資対象地域による区分

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

##### 3. 投資対象資産による区分

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

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

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

#### 4. 独立した区分

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

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

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

#### < 補足として使用する商品分類 >

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

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

#### < 属性区分の定義 >

##### 1. 投資対象資産による属性区分

###### (1)株式

一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

###### (2)債券

一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

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

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

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

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

###### (3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

###### (4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

###### (5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

##### 2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

### 3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### 4. 投資形態による属性区分

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

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

### 5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

### 6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

### 7. 特殊型

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

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

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

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

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

## ファンドの特色

### ◆「保証契約」の表記について

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

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

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

### ◆「保証会社」の表記について

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

## 投資対象

- 主として複数のマザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）などへの分散投資を行います。
- 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」を、各インデックスについては後述の「インデックスの著作権等について」をご参照ください。

## ファンドの特色

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

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

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

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

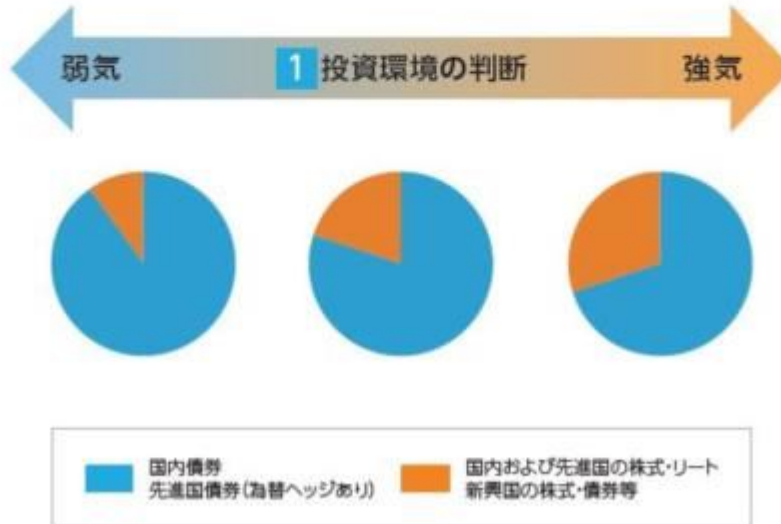
\*基準価額が「確保ライン」を上回っている場合でも、上記の条件以外の理由によって委託会社が繰上償還を決定することがあります。

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

## Point

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

## 投資環境の判断と投資割合のイメージ

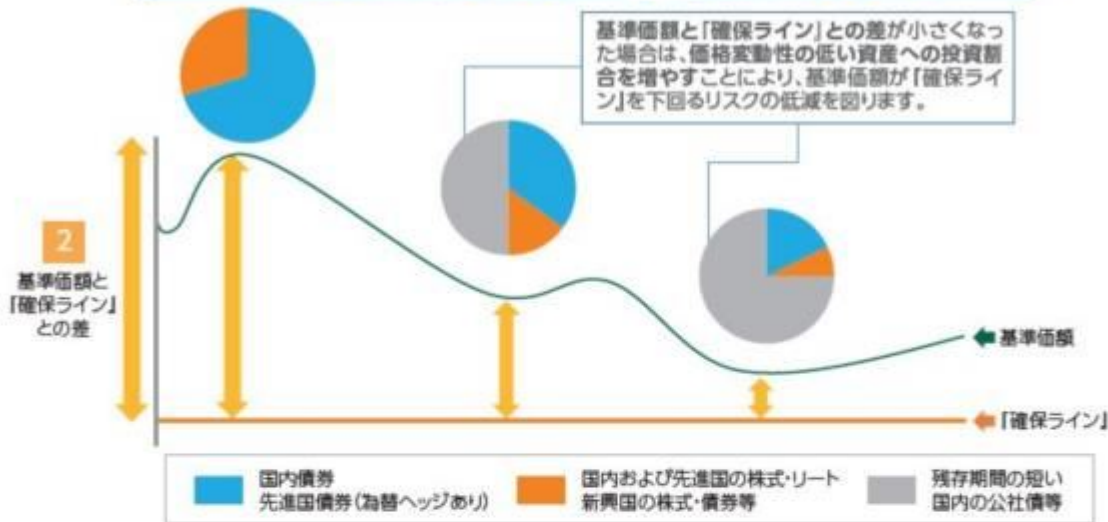


## 2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した『確保ライン』を上回る水準で運用を継続することを目指します。

### Point

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

### 『基準価額と『確保ライン』との差』と投資割合のイメージ

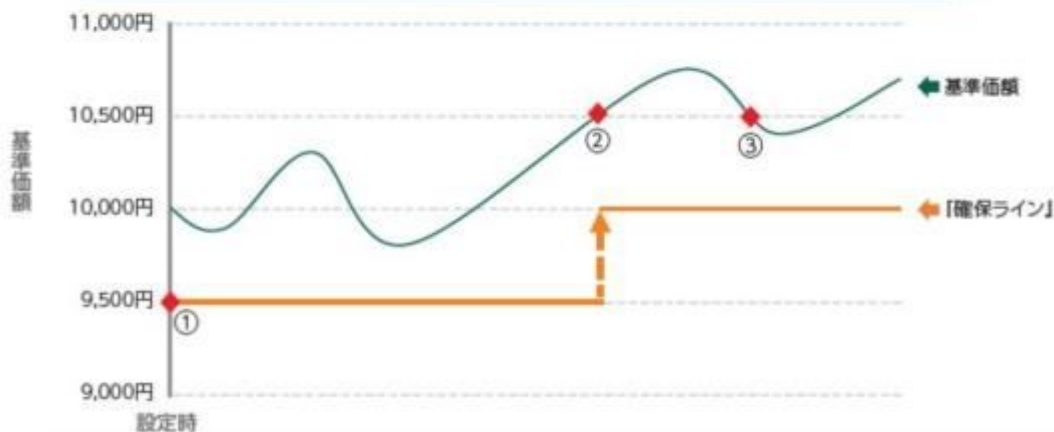


### 『確保ライン』は設定後に見直される場合があります。

### Point

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

### 『確保ライン』の引き上げイメージ



### ⚠️ ご注意ください

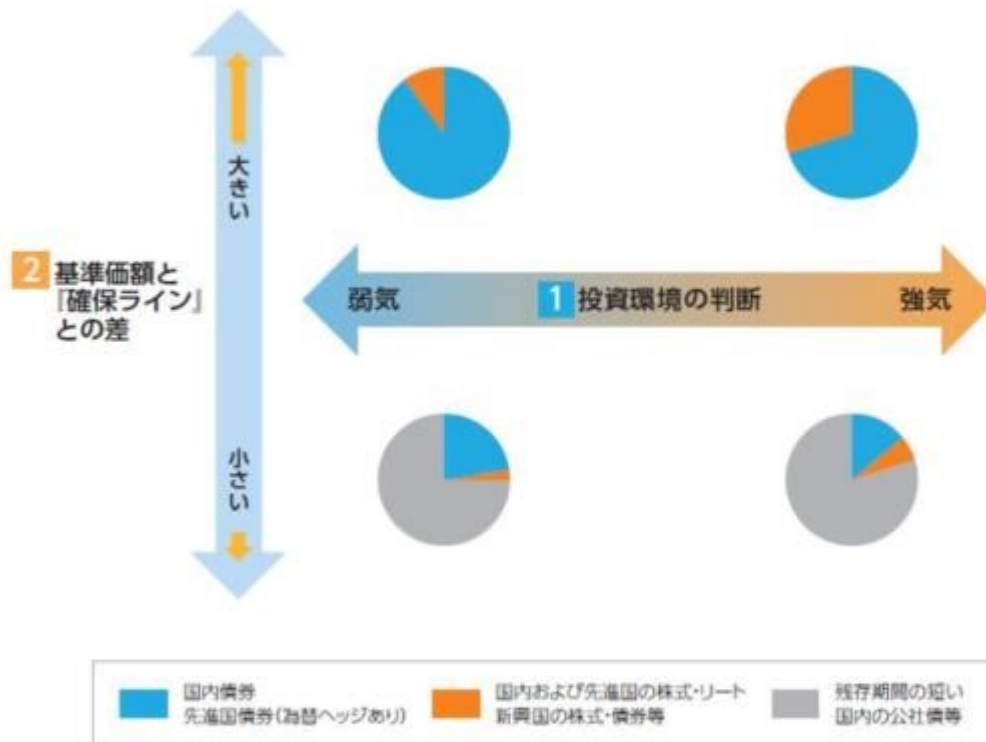
ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ安定的な収益の確保を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託会社が保証するものではありません。



## 投資対象資産への投資割合のイメージ

## 1 投資環境の判断 と 2 基準価額と「確保ライン」との差

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

⚠️ **ご注意ください**

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

3

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

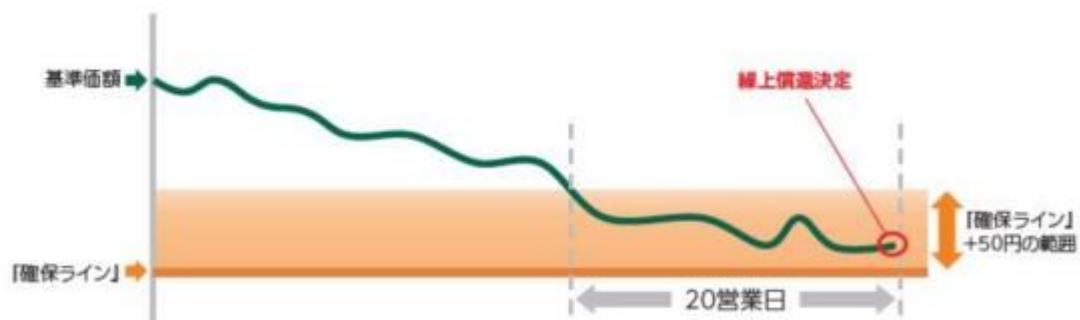
#### 条件① 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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

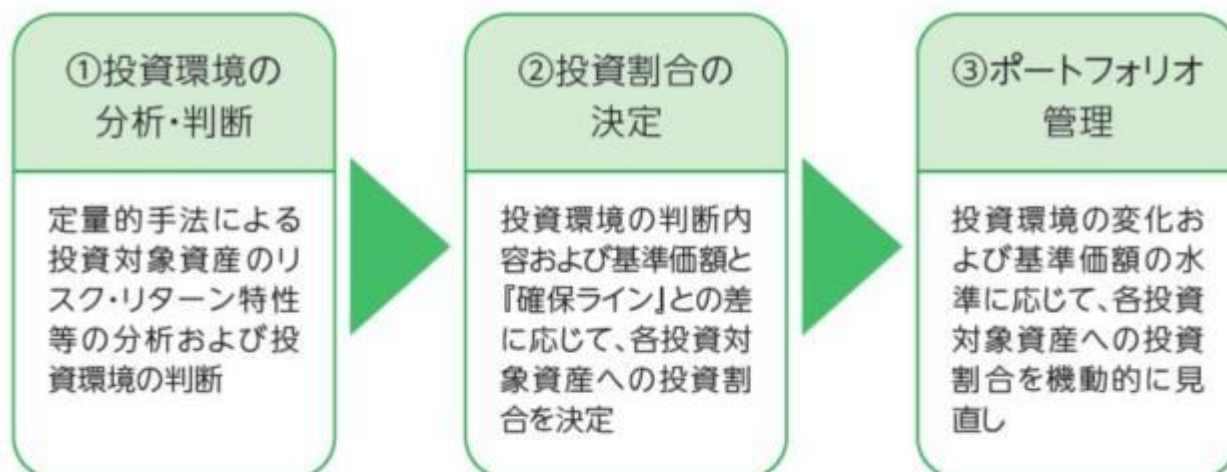


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

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

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

## 運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

## 分配方針

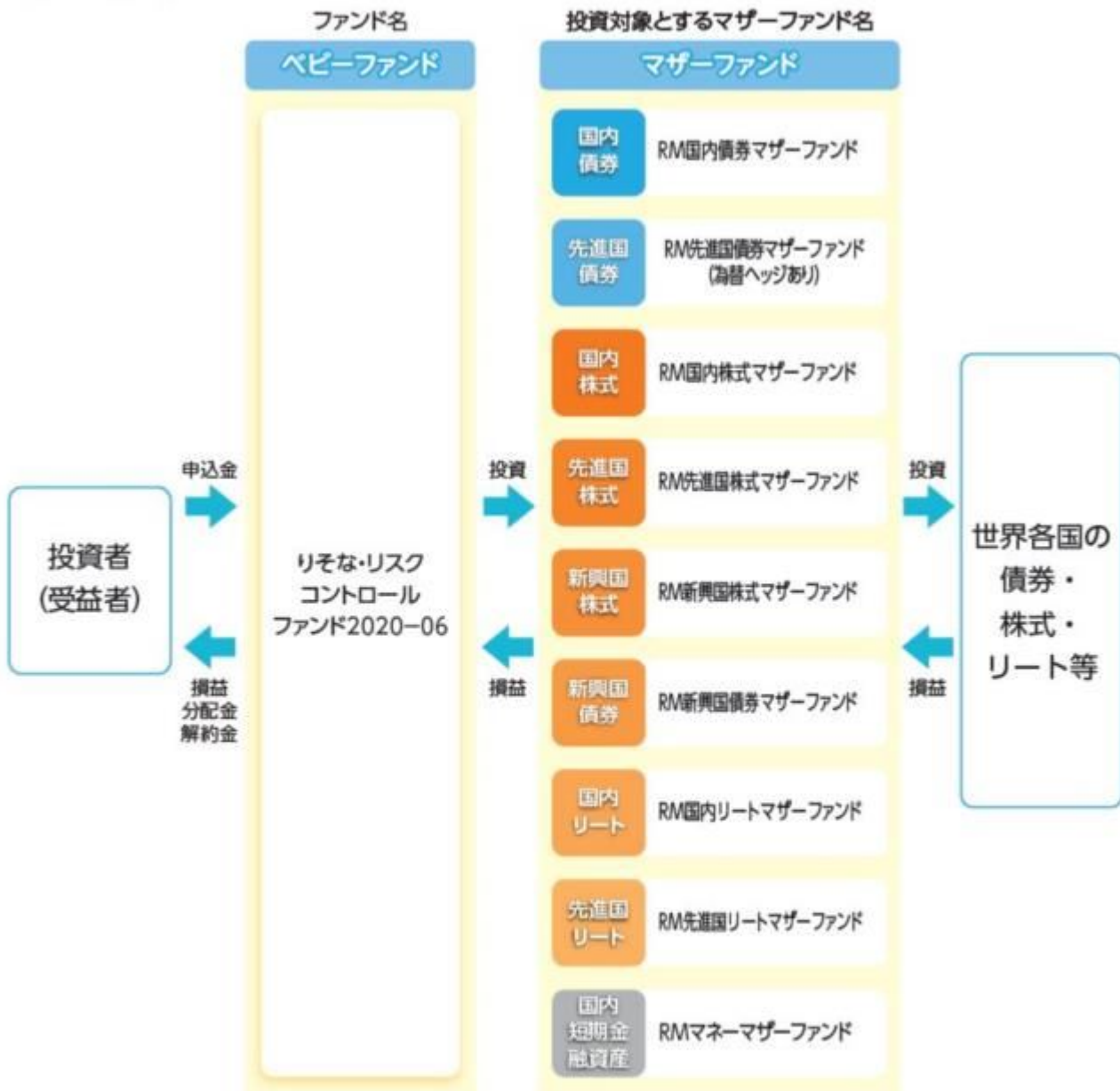
原則、毎年5月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 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、日本の公債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・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

800億円を限度とします。

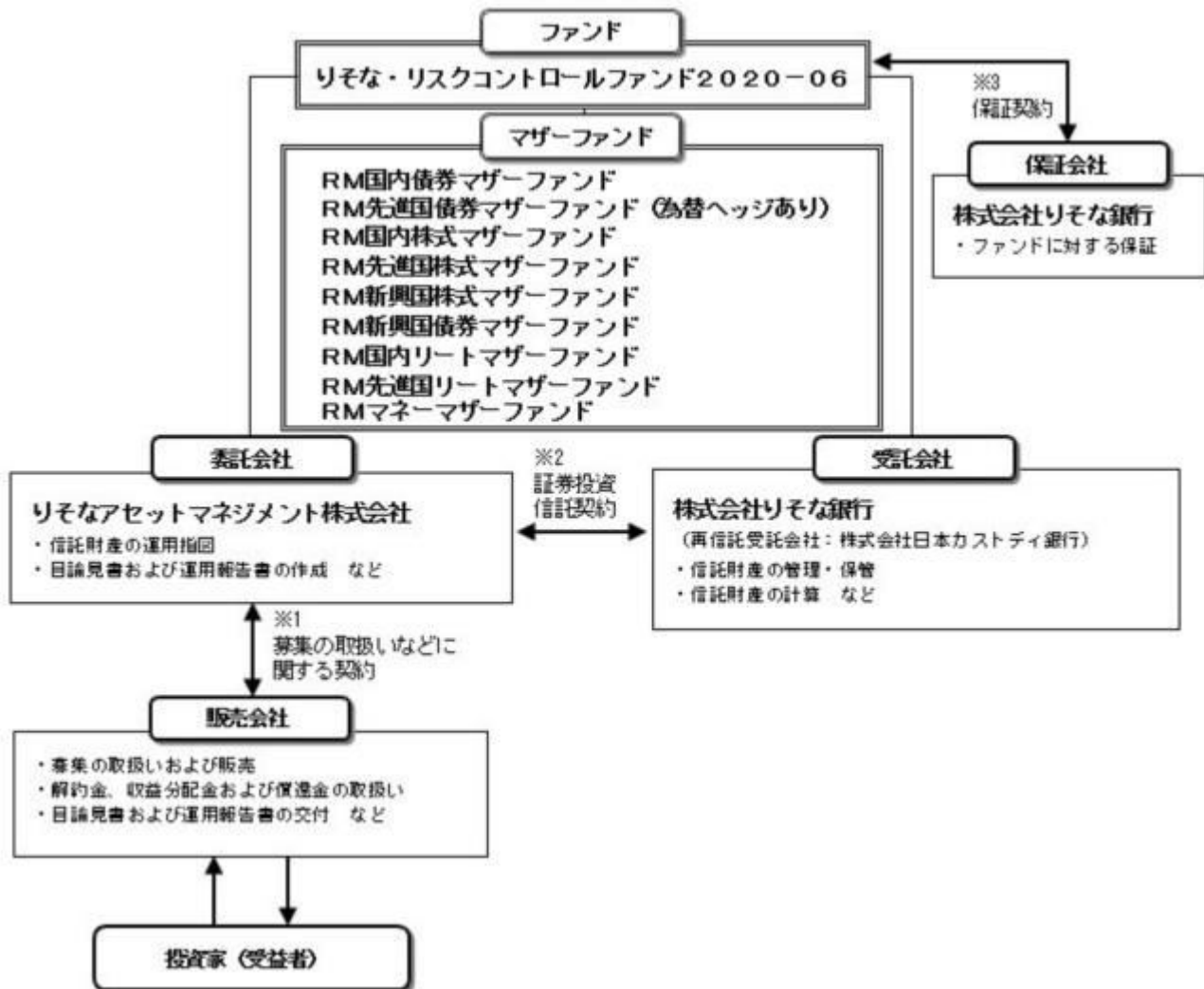
## (2) 【ファンドの沿革】

2020年6月15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。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。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。

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5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。

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

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

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

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

ない場合があります。

## （２）【投資対象】

### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

### 有価証券の指図範囲

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

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

なお、1) の証券または証書ならびに12) および17) の証券または証書のうち1) の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2) から6) までの証券ならびに14) の証券のうち投資法人債券



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

#### 金融商品の指図範囲

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

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

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

#### その他の投資対象と指図範囲

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

#### 《参考情報》

##### 投資対象とするマザーファンドの概要

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

< R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

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

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

## &lt; R M国内株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M先進国株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M新興国株式マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M新興国債券マザーファンド &gt;

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

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

## &lt; R M国内リートマザーファンド &gt;

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



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

## &lt; R M先進国リートマザーファンド &gt;

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

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

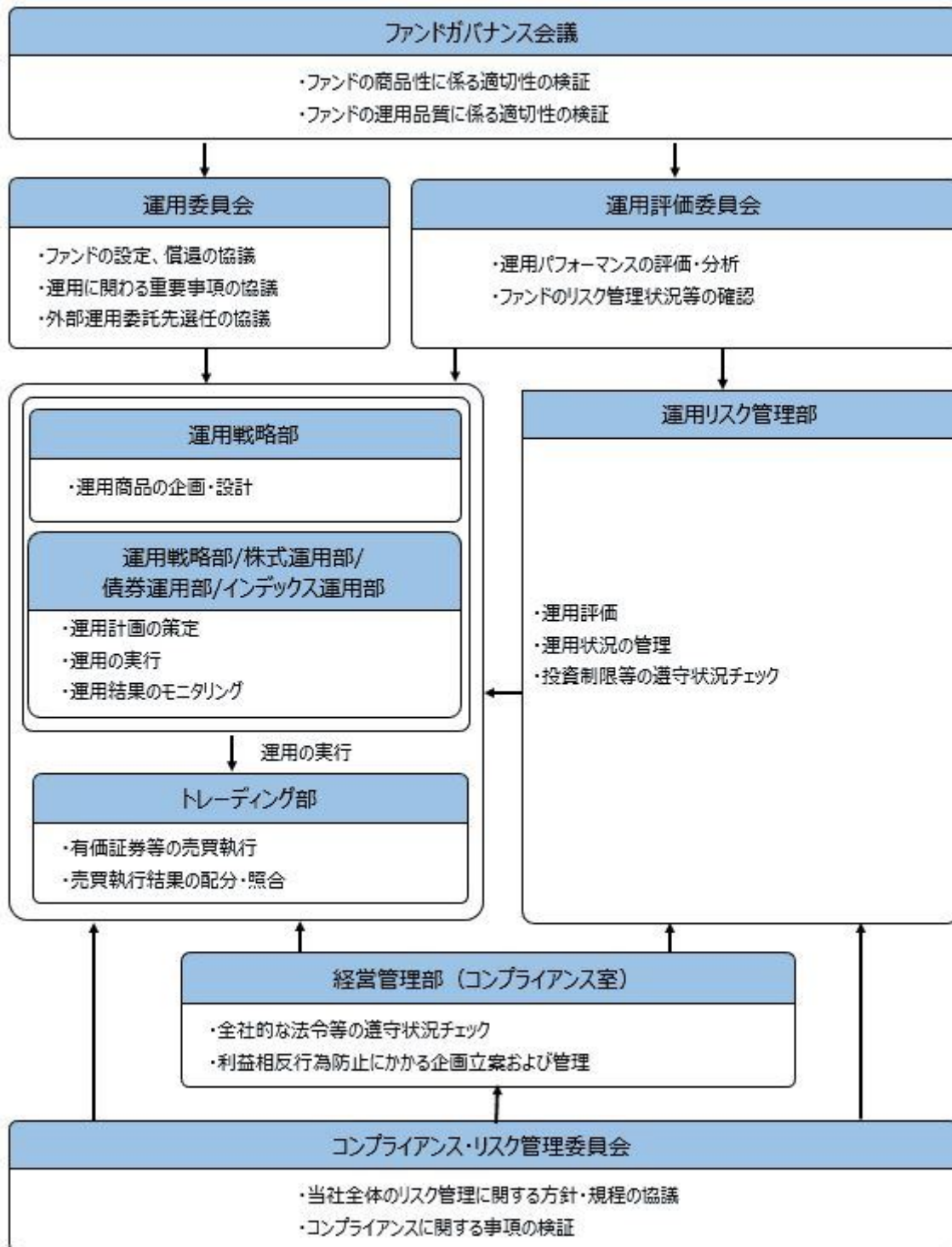
## &lt; RMマネーマザーファンド &gt;

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

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

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



ファンドガバナンス会議は3名程度、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5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 ヶ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者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に 10%、合計で 20% を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
  1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  2. 前記 1. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
  1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  2. 前記 1. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
    - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
    - ロ) 株式分割により取得する株券
    - ハ) 有償増資により取得する株券
    - ニ) 売出しにより取得する株券
    - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前

の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券

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の場合は、基準価額の下落要因となります。

##### ・リートの価格変動リスク

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

##### ・為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、金利動向、政治情勢等のさまざまな要因により変動します。当ファンドは、実質的に外貨建資産に投資を行いますので、投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。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ことがあります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入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5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7月6日まで

年率1.243%（税抜1.13%）

###### 2) 2020年7月7日以降

1カ月に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7月6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7月7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な費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

### １）収益分配金に対する課税

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

### ２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

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

法人受益者の場合

### １）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

### ２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

上記は2021年5月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

## 5【運用状況】

## 【りそな・リスクコントロールファンド2020-06】

以下の運用状況は2021年5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## (1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,635,269,186	99.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,997,598	0.08
合計(純資産総額)		2,637,266,784	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	R M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	1,500,385,288	1.0592	1,589,208,098	1.0340	1,551,398,387	58.83
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式マザーファンド	228,312,899	1.3585	310,163,074	1.8312	418,086,580	15.85
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	368,919,330	1.0545	389,025,434	1.0506	387,586,648	14.70
日本	親投資信託受益証券	R M新興国株式マザーファンド	40,773,999	1.3128	53,528,106	1.7225	70,233,213	2.66
日本	親投資信託受益証券	R M先進国リートマザーファンド	55,302,510	0.9637	53,295,029	1.2645	69,930,023	2.65
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	49,467,336	1.1507	56,922,064	1.3914	68,828,851	2.61
日本	親投資信託受益証券	R M新興国債券マザーファンド	31,039,605	1.0463	32,476,739	1.1228	34,851,268	1.32
日本	親投資信託受益証券	R M国内リートマザーファンド	23,199,768	1.1612	26,939,571	1.4808	34,354,216	1.30

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.92
合計	99.92

## 【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 5月17日)	2,649	2,649	1.0458	1.0458
2020年 6月末日	3,354		1.0032	
7月末日	3,302		1.0129	
8月末日	3,213		1.0171	
9月末日	3,148		1.0159	
10月末日	3,011		1.0089	
11月末日	2,952		1.0302	
12月末日	2,875		1.0361	
2021年 1月末日	2,834		1.0376	
2月末日	2,754		1.0278	
3月末日	2,725		1.0427	
4月末日	2,673		1.0510	
5月末日	2,637		1.0548	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 6月15日～2021年 5月17日	0.0000

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2020年 6月15日～2021年 5月17日	4.58

(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 6月15日～2021年 5月17日	3,377,111,088	843,553,901

(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 M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	78,710,980,490	83.43
地方債証券	日本	4,751,895,100	5.04
特殊債券	日本	5,888,417,473	6.24
社債券	日本	3,720,865,000	3.94
	フランス	200,510,000	0.21
	オーストラリア	99,922,000	0.11
	小計	4,021,297,000	4.26
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		966,676,803	1.02
合計（純資産総額）		94,339,266,866	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	100.29	1,283,750,400	0.100	2022/9/20	1.36
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	1,240,000,000	100.73	1,249,123,600	100.66	1,248,184,000	0.100	2024/3/20	1.32
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	1,180,000,000	100.55	1,186,503,400	100.48	1,185,699,400	0.100	2023/6/20	1.26
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	1,120,000,000	100.77	1,128,729,600	100.70	1,127,884,800	0.100	2024/6/20	1.20
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	1,010,000,000	101.21	1,022,247,600	101.01	1,020,291,900	0.100	2027/3/20	1.08
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	100.42	1,004,240,000	0.100	2023/3/20	1.06
日本	国債証券	第356回利付国債（10年）	960,000,000	101.07	970,297,200	100.78	967,564,800	0.100	2029/9/20	1.03
日本	国債証券	第340回利付国債（10年）	934,000,000	102.47	957,153,860	102.24	955,005,660	0.400	2025/9/20	1.01



日本	国債証券	第137回利付国債（5年）	930,000,000	100.60	935,666,800	100.54	935,049,900	0.100	2023/9/20	0.99
日本	国債証券	第352回利付国債（10年）	830,000,000	101.24	840,355,900	100.98	838,200,400	0.100	2028/9/20	0.89
日本	国債証券	第134回利付国債（5年）	830,000,000	100.44	833,710,100	100.35	832,971,400	0.100	2022/12/20	0.88
日本	国債証券	第353回利付国債（10年）	810,000,000	101.09	818,867,100	100.94	817,654,500	0.100	2028/12/20	0.87
日本	国債証券	第142回利付国債（5年）	800,000,000	100.86	806,933,300	100.80	806,424,000	0.100	2024/12/20	0.85
日本	国債証券	第138回利付国債（5年）	800,000,000	100.68	805,450,000	100.60	804,816,000	0.100	2023/12/20	0.85
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	780,000,000	101.01	787,880,200	100.91	787,144,800	0.100	2025/6/20	0.83
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	770,000,000	100.94	777,289,600	100.96	777,399,700	0.100	2025/12/20	0.82
日本	国債証券	第357回利付国債（10年）	760,000,000	100.91	766,955,600	100.72	765,517,600	0.100	2029/12/20	0.81
日本	国債証券	第345回利付国債（10年）	750,000,000	101.19	758,989,800	101.00	757,530,000	0.100	2026/12/20	0.80
日本	国債証券	第349回利付国債（10年）	730,000,000	101.07	737,824,000	101.05	737,679,600	0.100	2027/12/20	0.78
日本	国債証券	第359回利付国債（10年）	730,000,000	100.81	735,916,600	100.54	733,949,300	0.100	2030/6/20	0.78
日本	国債証券	第361回利付国債（10年）	720,000,000	99.89	719,228,500	100.33	722,390,400	0.100	2030/12/20	0.77
日本	国債証券	第360回利付国債（10年）	710,000,000	100.66	714,686,000	100.46	713,287,300	0.100	2030/9/20	0.76
日本	国債証券	第343回利付国債（10年）	680,000,000	101.15	687,834,400	100.96	686,555,200	0.100	2026/6/20	0.73
日本	国債証券	第355回利付国債（10年）	680,000,000	100.99	686,767,600	100.84	685,746,000	0.100	2029/6/20	0.73
日本	国債証券	第348回利付国債（10年）	660,000,000	101.21	668,026,600	101.04	666,890,400	0.100	2027/9/20	0.71
日本	国債証券	第143回利付国債（5年）	660,000,000	100.97	666,404,400	100.85	665,669,400	0.100	2025/3/20	0.71
日本	国債証券	第332回利付国債（10年）	652,000,000	102.09	665,660,080	101.87	664,192,400	0.600	2023/12/20	0.70
日本	国債証券	第145回利付国債（5年）	650,000,000	101.03	656,701,500	100.95	656,181,500	0.100	2025/9/20	0.70
日本	国債証券	第338回利付国債（10年）	631,000,000	102.20	644,932,480	102.00	643,645,240	0.400	2025/3/20	0.68
日本	国債証券	第344回利付国債（10年）	630,000,000	101.19	637,519,800	100.98	636,205,500	0.100	2026/9/20	0.67

## ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.43
地方債証券	5.04
特殊債券	6.24
社債券	4.26
合計	98.98

## 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

該当事項はありません。

### R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	100,641,191,775	43.85
	カナダ	4,816,377,423	2.10
	メキシコ	1,789,365,306	0.78
	ドイツ	17,441,299,468	7.60
	イタリア	21,979,575,079	9.58
	フランス	23,946,077,937	10.43
	オランダ	4,505,110,159	1.96
	スペイン	14,071,540,099	6.13
	ベルギー	5,598,448,797	2.44
	オーストリア	3,479,943,414	1.52
	フィンランド	1,430,740,641	0.62
	アイルランド	1,917,173,364	0.84
	イギリス	15,088,218,970	6.57
	スウェーデン	806,148,859	0.35
	ノルウェー	594,837,276	0.26
	デンマーク	1,144,386,049	0.50
	ポーランド	1,443,789,684	0.63
	オーストラリア	5,100,812,718	2.22
	シンガポール	976,658,352	0.43
	マレーシア	1,068,084,084	0.47
イスラエル	1,063,044,328	0.46	
	小計	228,902,823,782	99.74
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		602,595,409	0.26
合計（純資産総額）		229,505,419,191	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		230,836,408,160	100.58

(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	22,230,000	10,627.79	2,362,559,108	10,661.94	2,370,149,355	0.750	2028/1/31	1.03
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	16,100,000	10,963.13	1,765,065,109	10,968.28	1,765,893,350	0.125	2023/7/15	0.77
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,650,000	10,453.61	1,635,991,055	10,107.78	1,581,867,701	0.625	2030/8/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,280,000	10,969.76	1,237,389,736	10,976.42	1,238,141,086	0.125	2023/2/28	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,900,000	10,968.44	1,195,560,266	10,974.71	1,196,243,784	0.125	2023/3/31	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,190,000	10,853.71	997,456,767	10,993.14	1,010,270,484	1.250	2028/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,403.02	969,257,091	11,382.45	967,508,628	1.500	2024/10/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,760,000	10,976.00	961,498,424	10,981.57	961,985,848	0.125	2022/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,000,000	10,122.34	1,012,234,741	9,544.83	954,483,167	1.375	2040/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,590,000	12,514.87	949,878,882	12,181.21	924,554,239	2.875	2028/8/15	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,680,000	13,579.86	907,135,096	13,534.48	904,103,351	0.000	2023/3/25	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,310,000	14,523.63	916,441,609	14,268.77	900,359,646	0.750	2028/11/25	0.39
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,770,000	15,901.79	917,533,496	15,227.27	878,613,785	1.500	2031/5/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	10,897.76	868,551,501	10,969.14	874,240,458	0.750	2026/3/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,210,000	10,512.86	863,106,413	10,520.66	863,746,778	1.125	2031/2/15	0.38
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,720,000	25,061.91	932,303,131	23,073.76	858,343,908	4.500	2041/4/25	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,320,000	16,448.08	875,038,139	15,996.56	851,017,053	2.750	2027/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	12,973.54	840,685,734	12,382.51	802,386,909	3.125	2028/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,460,000	9,937.71	741,353,774	10,011.31	746,843,851	1.875	2051/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,140,000	9,993.48	813,469,746	9,137.73	743,811,551	1.125	2040/8/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,699.88	783,231,542	10,149.15	742,918,136	0.625	2030/5/15	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	12,698.71	773,351,878	12,174.35	741,418,237	2.875	2028/5/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,590,000	16,382.36	751,950,645	15,982.11	733,579,181	3.500	2026/4/25	0.32
イタリア	国債証券	GOV OF ITALY	5,440,000	13,460.00	732,224,240	13,448.25	731,584,933	0.000	2024/1/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,440,000	17,149.73	761,448,440	16,376.15	727,101,300	2.500	2030/5/25	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,160,000	14,210.42	733,257,844	14,015.51	723,200,350	1.750	2023/5/25	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,330,000	13,724.44	731,512,731	13,398.51	714,140,826	0.000	2029/11/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,828.35	722,712,456	11,686.22	714,028,288	2.375	2024/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	12,567.94	735,224,962	12,084.31	706,932,606	2.750	2028/2/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,580.10	729,546,808	10,986.93	692,176,722	1.500	2030/2/15	0.30

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.74
合計	99.74

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

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	924,841,000.00	101,639,563,479	101,486,502,294	44.22
	カナダドル	売建	53,205,000.00	4,838,590,392	4,830,162,720	2.10
	メキシコペソ	売建	332,818,000.00	1,824,108,894	1,824,108,894	0.79
	ユーロ	売建	711,625,000.00	95,345,218,283	95,214,001,750	41.49
	英ポンド	売建	97,966,000.00	15,273,741,907	15,240,962,484	6.64
	スウェーデンクローナ	売建	61,904,000.00	820,859,420	817,132,800	0.36
	ノルウェークローネ	売建	45,830,000.00	602,536,176	601,197,940	0.26
	デンマーククローネ	売建	64,646,000.00	1,164,597,690	1,162,981,540	0.51
	ポーランドズロチ	売建	49,369,000.00	1,473,521,479	1,473,116,654	0.64
	オーストラリアドル	売建	60,472,000.00	5,144,921,476	5,114,721,760	2.23
	シンガポールドル	売建	11,763,000.00	976,443,101	975,082,122	0.42
	マレーシアリングット	売建	38,830,000.00	1,027,806,802	1,028,233,932	0.45
	イスラエルシェケル	売建	31,613,000.00	1,071,628,538	1,068,203,270	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 M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	50,774,481,930	98.60
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		723,316,699	1.40
合計(純資産総額)		51,497,798,629	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	694,260,000	1.35

(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	194,900	7,822.15	1,524,538,294	9,115.00	1,776,513,500	3.45
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	120,500	10,598.87	1,277,164,797	10,785.00	1,299,592,500	2.52
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	149,800	8,957.61	1,341,850,915	8,256.00	1,236,748,800	2.40
日本	株式	キーエンス	電気機器	18,900	55,604.02	1,050,916,043	53,870.00	1,018,143,000	1.98
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,298,200	511.66	664,243,760	620.00	804,884,000	1.56
日本	株式	任天堂	その他製品	11,000	62,977.62	692,753,858	67,700.00	744,700,000	1.45
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	131,700	4,841.61	637,641,207	5,555.00	731,593,500	1.42
日本	株式	信越化学工業	化学	34,800	19,115.63	665,224,074	18,855.00	656,154,000	1.27
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	220,800	2,762.42	609,943,216	2,931.50	647,275,200	1.26
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	160,100	3,744.05	599,423,499	3,719.00	595,411,900	1.16
日本	株式	日本電産	電気機器	46,300	14,082.37	652,013,791	12,530.00	580,139,000	1.13
日本	株式	KDDI	情報・通信業	151,400	3,292.64	498,507,155	3,717.00	562,753,800	1.09
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	11,300	44,204.75	499,513,754	48,660.00	549,858,000	1.07
日本	株式	HOYA	精密機器	37,900	13,423.40	508,747,001	14,350.00	543,865,000	1.06
日本	株式	日立製作所	電気機器	92,500	4,631.61	428,424,184	5,736.00	530,580,000	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	24,500	22,824.74	559,206,353	21,605.00	529,322,500	1.03
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	131,300	3,489.78	458,208,163	3,951.00	518,766,300	1.01
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	151,500	2,928.27	443,633,324	3,353.00	507,979,500	0.99
日本	株式	村田製作所	電気機器	56,500	10,080.54	569,550,671	8,279.00	467,763,500	0.91
日本	株式	ファナック	電気機器	16,900	26,926.82	455,063,359	26,300.00	444,470,000	0.86
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	257,900	1,452.92	374,708,934	1,673.00	431,466,700	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	132,600	3,197.86	424,036,480	3,249.00	430,817,400	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	151,200	3,416.30	516,544,560	2,530.00	382,536,000	0.74
日本	株式	S M C	機械	5,600	66,637.63	373,170,763	65,520.00	366,912,000	0.71
日本	株式	三井物産	卸売業	151,200	2,108.02	318,732,624	2,414.00	364,996,800	0.71
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	74,100	4,123.24	305,532,122	4,736.00	350,937,600	0.68
日本	株式	三菱商事	卸売業	115,400	2,803.48	323,522,286	2,984.00	344,353,600	0.67
日本	株式	三菱電機	電気機器	192,400	1,663.36	320,032,101	1,692.00	325,540,800	0.63
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	62,500	5,367.70	335,481,550	5,179.00	323,687,500	0.63
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	19,600	16,402.09	321,481,148	16,310.00	319,676,000	0.62

## ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.17
		建設業	2.29

食料品	3.34
繊維製品	0.47
パルプ・紙	0.23
化学	7.27
医薬品	5.01
石油・石炭製品	0.41
ゴム製品	0.66
ガラス・土石製品	0.78
鉄鋼	0.83
非鉄金属	0.75
金属製品	0.61
機械	5.54
電気機器	17.54
輸送用機器	7.53
精密機器	2.67
その他製品	2.52
電気・ガス業	1.21
陸運業	3.27
海運業	0.27
空運業	0.47
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	8.90
卸売業	4.66
小売業	4.45
銀行業	5.11
証券、商品先物取引業	0.81
保険業	1.92
その他金融業	1.11
不動産業	1.98
サービス業	5.54
合 計	98.60

## 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	36	日本円	696,124,800	694,260,000	1.35

(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 M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	54,983,121,136	57.49
	カナダ	3,053,447,930	3.19
	パナマ	36,435,798	0.04
	ドイツ	2,491,299,849	2.61
	イタリア	501,953,066	0.52
	フランス	2,823,610,992	2.95
	オランダ	1,601,906,056	1.68
	スペイン	690,540,318	0.72
	ベルギー	234,475,098	0.25
	オーストリア	57,461,545	0.06
	ルクセンブルク	80,455,707	0.08
	フィンランド	329,546,125	0.34
	アイルランド	1,527,707,507	1.60
	ポルトガル	44,976,214	0.05
	イギリス	3,617,020,637	3.78
	スイス	2,744,974,457	2.87
	スウェーデン	958,790,452	1.00
	ノルウェー	168,198,982	0.18
	デンマーク	672,424,125	0.70
	ケイマン	176,170,242	0.18
	リベリア	35,789,654	0.04
	オーストラリア	1,735,855,135	1.82
	バミューダ	191,878,602	0.20
	ニュージーランド	79,856,941	0.08
	パプアニューギニア	10,323,889	0.01
	香港	659,128,779	0.69
	シンガポール	243,659,058	0.25
	イスラエル	150,382,372	0.16
	キュラソー	70,395,282	0.07
	ジャージー	330,736,529	0.35
マン島	17,838,023	0.02	
小計		80,320,360,500	83.99
投資証券	アメリカ	1,549,499,409	1.62
	カナダ	7,720,048	0.01

	フランス	48,552,179	0.05
	イギリス	48,452,624	0.05
	オーストラリア	114,704,851	0.12
	香港	33,127,262	0.03
	シンガポール	32,836,588	0.03
	小計	1,834,892,961	1.92
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		13,479,027,438	14.09
合計(純資産総額)		95,634,280,899	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	10,770,314,136	11.26
	買建	ドイツ	2,860,072,686	2.99

(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		713,274,031	0.75

(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	236,450	15,232.19	3,601,653,364	13,677.19	3,233,972,427	3.38
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	100,924	24,878.70	2,510,858,447	27,404.87	2,765,809,786	2.89
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	6,031	361,114.48	2,177,881,471	353,764.16	2,133,551,668	2.23
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	33,940	30,321.75	1,029,120,243	36,081.40	1,224,602,879	1.28
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	4,161	210,207.62	874,673,925	264,692.82	1,101,386,847	1.15
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,244	209,272.28	888,151,566	258,687.85	1,097,871,261	1.15
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	43,072	14,790.29	637,047,410	18,026.98	776,458,186	0.81
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	10,846	91,589.12	993,375,665	68,624.14	744,297,501	0.78
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	37,160	17,968.47	667,708,381	18,576.88	690,316,861	0.72



アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	8,740	60,466.69	528,478,943	71,319.85	623,335,513	0.65
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	19,366	25,794.20	499,530,658	31,768.93	615,237,184	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	13,408	38,347.21	514,159,429	45,212.33	606,207,044	0.63
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	23,965	22,272.89	533,769,981	24,948.44	597,889,556	0.63
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	40,778	12,351.10	503,653,318	13,546.63	552,404,853	0.58
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	15,229	31,292.48	476,553,301	35,003.56	533,069,240	0.56
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	34,868	14,287.94	498,192,087	14,801.13	516,086,010	0.54
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	109,837	3,494.98	383,878,439	4,652.72	511,041,510	0.53
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	25,708	18,987.49	488,130,418	19,608.62	504,098,506	0.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	12,537	36,195.29	453,780,358	39,577.26	496,180,119	0.52
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	15,742	27,682.46	435,777,353	28,539.79	449,273,456	0.47
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	5,862	61,908.24	362,906,138	73,864.60	432,994,297	0.45
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	64,843	5,374.05	348,469,700	6,293.63	408,098,395	0.43
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	60,005	5,242.31	314,565,236	6,406.69	384,433,505	0.40
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	9,977	38,801.12	387,118,808	38,474.79	383,863,040	0.40
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	6,780	51,937.58	352,136,806	55,382.70	375,494,711	0.39
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	58,730	6,304.04	370,236,270	6,200.34	364,146,109	0.38
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	57,490	6,222.37	357,724,284	6,269.49	360,433,049	0.38
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	58,090	5,349.01	310,724,228	6,068.63	352,526,740	0.37
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	59,853	4,938.52	295,585,650	5,806.30	347,524,713	0.36
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	6,290	61,802.16	388,735,589	55,188.42	347,135,197	0.36

## 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	2.84
		素材	3.97
		資本財	5.78
		商業・専門サービス	1.05
		運輸	1.87

	自動車・自動車部品	1.69
	耐久消費財・アパレル	1.75
	消費者サービス	1.66
	メディア・娯楽	6.24
	小売	4.69
	食品・生活必需品小売り	1.17
	食品・飲料・タバコ	3.46
	家庭用品・パーソナル用品	1.55
	ヘルスケア機器・サービス	4.44
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.35
	銀行	5.62
	各種金融	4.13
	保険	2.77
	不動産	0.39
	ソフトウェア・サービス	9.94
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.71
	電気通信サービス	1.52
	公益事業	2.57
	半導体・半導体製造装置	3.85
投資証券		1.92
合計		85.91

## 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

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	SP500MIN2106	買建	467	米ドル	94,662,975	10,390,208,136	98,126,040	10,770,314,136	11.26
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002106	買建	953	ユーロ	20,504,525	2,742,275,171	21,385,320	2,860,072,686	2.99

(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	5,292,000.00	579,675,430	580,842,526	0.61
	カナダドル	買建	388,000.00	35,101,972	35,233,747	0.04
	ユーロ	買建	54,000.00	7,222,213	7,222,230	0.01
	スイスフラン	買建	196,000.00	23,913,320	23,895,514	0.02

スウェーデンクローナ	買建	3,437,000.00	45,157,009	45,368,400	0.05
ノルウェークローネ	買建	264,000.00	3,463,442	3,463,680	0.00
オーストラリアドル	買建	142,000.00	12,031,578	12,010,360	0.01
イスラエルシケル	買建	155,000.00	5,213,425	5,237,574	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

#### R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

#### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	51,736,682	0.34
	アルゼンチン	980,157	0.01
	メキシコ	221,576,218	1.45
	ブラジル	647,465,483	4.22
	チリ	55,534,829	0.36
	コロンビア	17,262,075	0.11
	ペルー	4,037,342	0.03
	オランダ	38,043,266	0.25
	ルクセンブルク	27,836,788	0.18
	ギリシャ	17,657,670	0.12
	トルコ	32,068,682	0.21
	チェコ	12,953,742	0.08
	キプロス	16,032,314	0.10
	ハンガリー	29,826,659	0.19
	ポーランド	86,745,652	0.57
	ロシア	345,926,820	2.26
	ケイマン	3,130,284,986	20.42
	バミューダ	94,679,554	0.62
	香港	152,490,173	0.99
	シンガポール	3,459,351	0.02
	マレーシア	167,254,790	1.09
	タイ	216,647,678	1.41
	フィリピン	78,895,887	0.51
	インドネシア	151,948,677	0.99
韓国	1,684,635,137	10.99	
台湾	1,730,846,234	11.29	
中国	1,457,616,832	9.51	
インド	1,294,141,101	8.44	
カタール	81,709,532	0.53	

	エジプト	7,821,111	0.05
	南アフリカ	477,470,886	3.12
	ジャージー	13,594,733	0.09
	英ヴァージン諸島	4,280,032	0.03
	アラブ首長国連邦	71,050,111	0.46
	マン島	4,550,321	0.03
	クウェート	63,370,498	0.41
	サウジアラビア	336,454,515	2.20
	小計	12,828,886,518	83.70
新株予約権証券	タイ	53,075	0.00
投資証券	メキシコ	5,876,031	0.04
	南アフリカ	5,648,032	0.04
	小計	11,524,063	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,486,380,140	16.22
合計（純資産総額）		15,326,843,796	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,457,175,695	16.03

(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		27,840,518	0.18
	売建		13,255,513	0.09

(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	339,700	2,557.47	868,774,987	2,336.99	793,875,503	5.18
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	79,400	9,710.42	771,008,034	8,505.21	675,313,674	4.41
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	24,830	28,386.13	704,827,638	23,484.24	583,113,918	3.80
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	65,938	8,505.04	560,805,592	7,881.84	519,712,766	3.39
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	49,800	5,296.27	263,754,740	3,749.92	186,746,414	1.22

南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	6,040	28,099.27	169,719,651	24,134.37	145,771,604	0.95
ブラジル	株式	VALE SA	素材	55,100	2,000.69	110,238,301	2,344.33	129,173,052	0.84
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	39,549	3,110.79	123,028,769	3,184.09	125,927,813	0.82
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,332,000	85.83	114,336,067	90.49	120,540,672	0.79
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	87,500	1,360.27	119,024,165	1,199.77	104,980,663	0.68
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	47,314	2,043.74	96,697,635	2,135.67	101,047,374	0.66
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	12,020	10,296.46	123,763,544	8,115.65	97,550,166	0.64
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	7,600	12,627.35	95,967,934	12,300.00	93,480,000	0.61
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	23,828	3,934.00	93,739,436	3,862.85	92,044,037	0.60
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	6,100	17,926.33	109,350,646	13,706.82	83,611,656	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	11,429	7,610.47	86,980,111	7,104.48	81,197,102	0.53
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,750	27,403.00	102,761,284	21,542.59	80,784,732	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	199,600	420.78	83,989,394	404.40	80,719,038	0.53
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	21,000	3,635.73	76,350,497	3,806.52	79,936,941	0.52
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	47,000	1,700.17	79,908,045	1,627.51	76,493,158	0.50
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	18,000	6,645.16	119,613,028	4,238.93	76,300,762	0.50
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	172,800	478.52	82,689,270	439.67	75,975,149	0.50
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	5,510	12,815.57	70,613,832	12,943.99	71,321,422	0.47
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	71,302	821.67	58,587,030	977.43	69,693,142	0.45
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	37,432	1,585.02	59,330,647	1,852.19	69,331,550	0.45
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	82,493	635.75	52,445,703	779.73	64,322,682	0.42
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,838	5,015.90	64,394,126	4,778.27	61,343,456	0.40
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,719	33,876.20	58,233,202	35,227.20	60,555,557	0.40
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	786,000	71.26	56,014,762	72.11	56,681,604	0.37
中国	株式	CHINA MERCHANTS BANK-H	銀行	54,500	844.08	46,002,581	1,013.83	55,254,171	0.36

## 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	4.10
		素材	7.24
		資本財	2.24

商業・専門サービス	0.28
運輸	1.42
自動車・自動車部品	2.82
耐久消費財・アパレル	1.41
消費者サービス	1.06
メディア・娯楽	7.44
小売	8.76
食品・生活必需品小売り	0.96
食品・飲料・タバコ	3.00
家庭用品・パーソナル用品	0.87
ヘルスケア機器・サービス	1.09
医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.02
銀行	11.08
各種金融	1.94
保険	2.39
不動産	1.73
ソフトウェア・サービス	2.09
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.46
電気通信サービス	2.06
公益事業	1.71
半導体・半導体製造装置	7.53
新株予約権証券	0.00
投資証券	0.08
合計	83.78

## 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 2106	買建	329	米ドル	21,785,035	2,391,125,437	22,386,805	2,457,175,695	16.03

(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	225,146.72	24,729,413	24,711,761	0.16
	フィリピンペソ	買建	1,362,521.17	3,128,957	3,128,757	0.02
	米ドル	売建	28,452.84	3,128,957	3,122,963	0.02

ブラジルリアル	売建	3,979.67	83,516	83,606	0.00
チリペソ	売建	791,440.00	119,380	120,088	0.00
タイバーツ	売建	2,793,813.66	9,806,285	9,806,285	0.06
フィリピンペソ	売建	10,152.18	23,249	23,312	0.00
オフショア人民元	売建	5,758.74	98,997	99,259	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 M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,719,404,102	29.97
	アイルランド	3,976,489,355	69.32
	小計	5,695,893,457	99.29
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		40,842,335	0.71
合計(純資産総額)		5,736,735,792	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	買建		31,347,256	0.55

(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 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	631,937	6,346.86	4,010,816,893	6,292.54	3,976,489,355	69.32
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	491,532	3,535.75	1,737,934,752	3,498.05	1,719,404,102	29.97

#### ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.29
合計	99.29

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
為替予約取引	米ドル	買建	285,600.00	31,156,104	31,347,256	0.55

(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。

## RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	27,181,583,800	97.67
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		648,945,516	2.33
合計(純資産総額)		27,830,529,316	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	690,475,500	2.48

(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	2,734	615,223.66	1,682,021,506	694,000	1,897,396,000	6.82
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,430	620,574.53	1,507,996,126	660,000	1,603,800,000	5.76
日本	投資証券	GLP投資法人	7,592	172,263.15	1,307,821,846	186,900	1,418,944,800	5.10
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	7,857	158,048.45	1,241,786,720	173,400	1,362,403,800	4.90
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	12,102	98,830.08	1,196,041,748	110,800	1,340,901,600	4.82
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,841	334,354.63	1,284,256,160	339,500	1,304,019,500	4.69
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,467	277,103.65	960,718,357	306,000	1,060,902,000	3.81



日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4,841	175,948.72	851,767,779	203,500	985,143,500	3.54
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,196	139,529.91	724,997,436	157,000	815,772,000	2.93
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,308	314,133.13	725,019,280	352,000	812,416,000	2.92
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,434	191,486.55	657,564,818	196,000	673,064,000	2.42
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,513	374,005.23	565,869,924	430,500	651,346,500	2.34
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,146	78,345.26	559,855,291	90,600	647,427,600	2.33
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	752	685,715.63	515,658,159	812,000	610,624,000	2.19
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,217	434,260.72	528,495,304	498,500	606,674,500	2.18
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	837	576,786.76	482,770,520	634,000	530,658,000	1.91
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	7,827	55,803.92	436,777,307	67,200	525,974,400	1.89
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,939	165,611.16	486,731,214	178,500	524,611,500	1.89
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,588	311,578.49	494,786,650	309,000	490,692,000	1.76
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	848	527,821.33	447,592,488	562,000	476,576,000	1.71
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	10,159	36,818.99	374,044,195	44,600	453,091,400	1.63
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,854	147,718.35	421,588,189	157,800	450,361,200	1.62
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	806	431,674.8	347,929,895	504,000	406,224,000	1.46
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	518	681,417.9	352,974,475	778,000	403,004,000	1.45
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,464	140,245.75	345,565,544	154,100	379,702,400	1.36
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,656	189,495.95	313,805,301	225,200	372,931,200	1.34
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,092	304,573.8	332,594,590	339,000	370,188,000	1.33
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,173	99,923.69	317,057,881	112,000	355,376,000	1.28
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	2,255	131,113.37	295,660,665	157,200	354,486,000	1.27
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,014	159,981.95	322,203,660	174,900	352,248,600	1.27

## ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.67
合計	97.67

## 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	333	日本円	637,359,130	690,475,500	2.48

(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 M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 5月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

## 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	13,843,589	0.06
	オーストラリア	17,647,211	0.08
	小計	31,490,800	0.13
投資証券	アメリカ	17,225,725,737	73.58
	カナダ	459,723,559	1.96
	ドイツ	64,734,395	0.28
	イタリア	5,946,222	0.03
	フランス	578,842,398	2.47
	オランダ	48,235,691	0.21
	スペイン	113,572,919	0.49
	ベルギー	312,772,556	1.34
	アイルランド	28,432,431	0.12
	イギリス	1,315,644,873	5.62
	オーストラリア	1,614,575,849	6.90
	ニュージーランド	97,714,251	0.42
	香港	370,741,184	1.58
	シンガポール	858,374,197	3.67
	韓国	31,872,262	0.14
	イスラエル	15,436,137	0.07
	ガーンジー	61,193,832	0.26
小計	23,203,538,493	99.12	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		175,453,060	0.75
合計（純資産総額）		23,410,482,353	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	買建		88,392,271	0.38
	売建		46,358	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	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	107,747	11,343.41	1,222,219,134	12,934.11	1,393,612,455	5.95
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	13,015	78,562.90	1,022,496,218	80,862.38	1,052,423,969	4.50
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	22,157	25,348.57	561,648,439	31,005.00	686,977,891	2.93
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	41,010	15,512.40	636,163,858	16,635.22	682,210,602	2.91
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,926	11,026.85	528,472,929	14,103.06	675,903,369	2.89
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	60,974	7,174.61	437,464,750	8,206.75	500,398,692	2.14
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,362	18,723.72	381,252,581	22,713.73	462,497,060	1.98
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	50,069	7,036.93	352,332,218	8,500.91	425,632,163	1.82
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	54,533	6,705.12	365,650,564	7,507.58	409,411,078	1.75
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	245,622	1,509.57	370,784,691	1,634.93	401,575,120	1.72
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,588	18,568.83	345,157,523	19,565.81	363,689,418	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	54,786	5,512.22	301,993,029	6,086.19	333,438,115	1.42
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	82,885	3,364.36	278,855,662	3,980.99	329,964,787	1.41
香港	投資証券	LINK REIT	304,800	980.29	298,795,206	1,058.37	322,593,919	1.38
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,261	13,232.76	254,876,294	16,443.14	316,711,427	1.35
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,497	27,744.80	263,492,383	32,411.03	307,807,556	1.31
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	16,299	16,366.23	266,753,280	18,376.01	299,510,737	1.28
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,717	15,084.49	252,167,577	17,638.43	294,861,668	1.26
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,832	3,367.74	265,485,753	3,663.78	288,823,799	1.23
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	174,117	1,509.75	262,874,119	1,623.68	282,711,334	1.21
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	54,623	4,490.36	245,277,222	5,099.44	278,547,236	1.19
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	20,731	10,353.37	214,635,891	12,903.38	267,500,087	1.14
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	77,686	2,954.20	229,500,664	3,416.82	265,439,762	1.13
アメリカ	投資証券	UDR INC	42,885	4,417.42	189,441,185	5,227.86	224,197,153	0.96
アメリカ	投資証券	WIP CAREY INC	25,667	7,500.29	192,510,022	8,281.39	212,558,488	0.91
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	41,755	3,522.80	147,094,605	4,778.95	199,545,074	0.85
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,288	8,077.37	163,873,855	9,652.01	195,820,097	0.84
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	84,271	2,359.51	198,839,012	2,323.61	195,813,714	0.84
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	103,655	1,654.30	171,476,980	1,884.57	195,346,057	0.83
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,101	11,516.81	162,398,649	13,761.70	194,053,856	0.83

## 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	0.13
投資証券			99.12
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

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	677,421.83	74,157,262	74,352,721	0.32
	英ポンド	買建	25,000.00	3,902,457	3,889,950	0.02
	オーストラリアドル	買建	120,000.00	10,134,188	10,149,600	0.04
	韓国ウォン	売建	471,120.00	46,452	46,358	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。

## 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 号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。

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

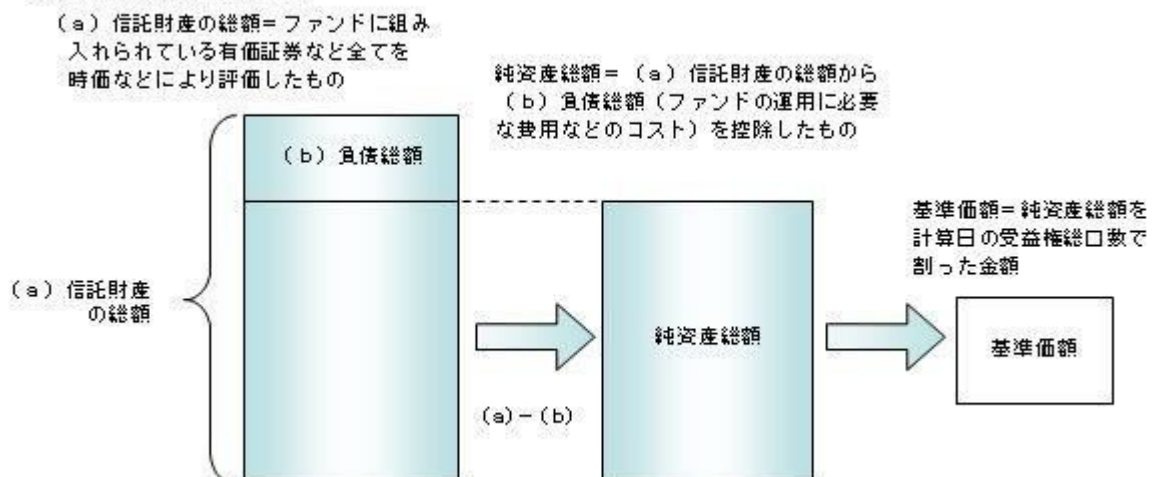
## 3 【資産管理等の概要】

### （ 1 ） 【資産の評価】

#### 基準価額の算出

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

#### < 基準価額算出の流れ >



#### 有価証券などの評価基準

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

#### < 主な資産の評価方法 >

##### マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

##### 国内上場株式

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

##### 外国株式

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

##### 公社債（国内・外国）

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

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

## ・ 価格情報会社の提供する価額

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

\* 外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

## 国内上場不動産投信

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

## 海外上場不動産投信

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

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

## 基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

## 委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

## （2）【保管】

該当事項はありません。

## （3）【信託期間】

2030年5月15日までとします（2020年6月15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5月16日から翌年5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。

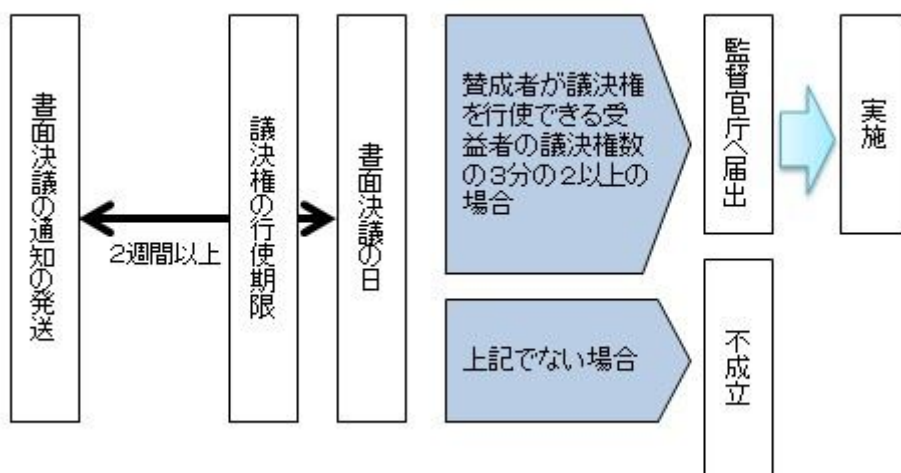
信託約款の変更など

- 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せん。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないません。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 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 6月15日から2021年 5月17日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【りそな・リスクコントロールファンド2020 - 06】

## (1) 【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 2021年 5月17日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン		19,149,750
親投資信託受益証券		2,647,384,614
未収入金		3,248,000
流動資産合計		2,669,782,364
資産合計		2,669,782,364
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		3,120,900
未払受託者報酬		368,089
未払委託者報酬		13,495,637
未払利息		51
その他未払費用		3,258,122
流動負債合計		20,242,799
負債合計		20,242,799
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		2,533,557,187
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )		115,982,378
元本等合計		2,649,539,565
純資産合計		2,649,539,565
負債純資産合計		2,669,782,364

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2020年 6月15日 至 2021年 5月17日
営業収益	
有価証券売買等損益	179,332,614
営業収益合計	179,332,614
営業費用	
支払利息	20,507
受託者報酬	909,127
委託者報酬	33,334,630
その他費用	7,646,825
営業費用合計	41,911,089
営業利益又は営業損失（ ）	137,421,525
経常利益又は経常損失（ ）	137,421,525
当期純利益又は当期純損失（ ）	137,421,525
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	21,439,147
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,439,147
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	115,982,378

## (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6月15日)から2021年5月17日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第1期 2021年5月17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6月15日
設定元本額	3,377,111,088円
期首元本額	3,377,111,088円
元本残存率	75.0%
2. 計算期間の末日における受益権の総数	2,533,557,187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	1.0458円
(10,000口当たり純資産額)	(10,458円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年6月15日 至 2021年5月17日	
分配金の計算過程	
A 当ファンドの配当等収益額	20,507円
B 親ファンドの配当等収益額	47,532,860円
RM国内株式マザーファンド	1,534,560円
RM国内リートマザーファンド	1,375,516円
RM先進国株式マザーファンド	5,485,487円
RM新興国株式マザーファンド	982,089円
RM先進国リートマザーファンド	2,257,937円
RM国内債券マザーファンド	3,205,275円
RM新興国債券マザーファンド	1,520,280円
RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	31,171,716円
C 配当等収益額合計(A+B)	47,512,353円
D 経費	41,890,582円
E 差引配当等収益額(C-D)	5,621,771円
F 当ファンドの当期末残存受益権口数	2,533,557,187口

G 当ファンドの期中平均残存受益権口数	2,904,045,196口
H 分配対象配当等収益額(E×F/G)	4,904,564円
I 元本超過額	115,982,378円
J 分配可能額(H<I)	115,982,378円
K 10,000口当たり分配可能額(J/F×10,000)	457円
L 10,000口当たりの分配額	0円
M 収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

<p>第1期</p> <p>自 2020年 6月15日</p> <p>至 2021年 5月17日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

<p>第1期</p> <p>2021年 5月17日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお</p> <p>ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額</p> <p>が異なることもあります。</p>

## （関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2020年 6月15日 至 2021年 5月17日
該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2020年 6月15日 至 2021年 5月17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	111,426,984
合計	111,426,984

## 2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

## （4）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	364,548,893	383,250,251	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	1,484,554,133	1,525,082,460	
	R M国内株式マザーファンド	53,294,976	72,449,190	
	R M先進国株式マザーファンド	247,891,965	446,825,266	
	R M新興国株式マザーファンド	43,713,470	72,157,824	
	R M新興国債券マザーファンド	33,499,560	37,251,510	
	R M国内リートマザーファンド	25,243,887	36,535,477	
	R M先進国リートマザーファンド	60,070,488	73,832,636	
合計		2,312,817,372	2,647,384,614	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

### （参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

### R M国内債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 5月17日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	688,684
コール・ローン	875,409,833
国債証券	77,475,865,350
地方債証券	4,752,731,700
特殊債券	5,889,889,685
社債券	3,820,634,000
未収入金	401,810,700
未収利息	166,453,856
前払費用	8,032,031
流動資産合計	93,391,515,839
資産合計	93,391,515,839
負債の部	
流動負債	
未払解約金	820,277,000
未払利息	2,374
流動負債合計	820,279,374
負債合計	820,279,374
純資産の部	
元本等	
元本	88,055,874,201
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,515,362,264
元本等合計	92,571,236,465
純資産合計	92,571,236,465
負債純資産合計	93,391,515,839

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	81,343,087,600円
期中追加設定元本額	42,484,752,918円
期中一部解約元本額	35,771,966,317円
期末元本額	88,055,874,201円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,197,952,560円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,497,792,521円



りそなラップ型ファンド(成長型)	159,625,544円
DCりそな グローバルバランス	533,243,952円
つみたてバランスファンド	2,692,483,807円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,299,677,444円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	522,809,616円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	148,503,258円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	106,027,372円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	33,507,404円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	7,245,862円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,229,824円
リスクコントロール・オープン	68,948,093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	50,969,823,128円
Smart-i 国内債券インデックス	1,127,637,329円
Smart-i 8資産バランス 安定型	731,602,707円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	470,588,430円
Smart-i 8資産バランス 成長型	180,292,018円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,371,370,419円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,624,347,610円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,550,644,225円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,025,770,649円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,138,424,136円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	364,548,893円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	11,814,206円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	7,879,374,868円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	816,279,194円
2. 計算日における受益権の総数	88,055,874,201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	1.0513円
(10,000口当たり純資産額)	(10,513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 5月17日現在

#### 1. 金融商品に対する取組方針

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

#### 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

#### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

### 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券
	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務
	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお
	ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額
	が異なることもあります。

### （関連当事者との取引に関する注記）

2021年 5月17日現在	
該当事項はありません。	

### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

### （その他の注記）

#### 1 有価証券に関する注記

##### 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		101,977,340
地方債証券		4,386,200
特殊債券		9,612,557

社債券	1,710,000
合計	114,266,097

(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 3 回利付国債(2年)	550,000,000	551,314,500	
	第4 1 4 回利付国債(2年)	560,000,000	561,506,400	
	第4 1 5 回利付国債(2年)	240,000,000	240,693,600	
	第4 1 6 回利付国債(2年)	120,000,000	120,372,000	
	第4 1 7 回利付国債(2年)	350,000,000	351,155,000	
	第4 1 8 回利付国債(2年)	440,000,000	441,540,000	
	第4 2 0 回利付国債(2年)	370,000,000	371,413,400	
	第4 2 1 回利付国債(2年)	600,000,000	602,412,000	
	第4 2 3 回利付国債(2年)	200,000,000	200,524,000	
	第1 3 2 回利付国債(5年)	40,000,000	40,098,000	
	第1 3 3 回利付国債(5年)	1,280,000,000	1,283,865,600	
	第1 3 4 回利付国債(5年)	830,000,000	833,037,800	
	第1 3 5 回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,004,330,000	
	第1 3 6 回利付国債(5年)	1,180,000,000	1,185,805,600	
	第1 3 7 回利付国債(5年)	930,000,000	935,133,600	

第138回利付国債(5年)	800,000,000	804,992,000	
第139回利付国債(5年)	1,240,000,000	1,248,469,200	
第140回利付国債(5年)	1,010,000,000	1,017,362,900	
第141回利付国債(5年)	300,000,000	302,367,000	
第142回利付国債(5年)	730,000,000	736,051,700	
第143回利付国債(5年)	660,000,000	665,722,200	
第144回利付国債(5年)	730,000,000	736,599,200	
第145回利付国債(5年)	650,000,000	656,240,000	
第146回利付国債(5年)	770,000,000	777,461,300	
第147回利付国債(5年)	260,000,000	261,326,000	
第1回利付国債(40年)	40,000,000	58,052,400	
第2回利付国債(40年)	100,000,000	140,854,000	
第3回利付国債(40年)	110,000,000	155,563,100	
第4回利付国債(40年)	170,000,000	241,277,600	
第5回利付国債(40年)	170,000,000	233,452,500	
第6回利付国債(40年)	170,000,000	229,998,100	
第7回利付国債(40年)	190,000,000	247,674,500	
第8回利付国債(40年)	210,000,000	256,172,700	
第9回利付国債(40年)	340,000,000	310,994,600	
第10回利付国債(40年)	320,000,000	342,755,200	
第11回利付国債(40年)	270,000,000	280,783,800	
第12回利付国債(40年)	250,000,000	235,042,500	
第13回利付国債(40年)	280,000,000	262,897,600	
第323回利付国債(10年)	340,000,000	343,804,600	
第324回利付国債(10年)	183,000,000	184,848,300	
第325回利付国債(10年)	330,000,000	334,101,900	
第326回利付国債(10年)	280,000,000	283,682,000	
第327回利付国債(10年)	387,000,000	392,708,250	
第328回利付国債(10年)	411,000,000	416,527,950	
第329回利付国債(10年)	297,000,000	302,821,200	
第330回利付国債(10年)	257,000,000	262,646,290	
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,554,300	
第332回利付国債(10年)	652,000,000	664,459,720	
第333回利付国債(10年)	225,000,000	229,743,000	
第334回利付国債(10年)	261,000,000	266,950,800	
第335回利付国債(10年)	345,000,000	352,355,400	

第336回利付国債(10年)	210,000,000	214,773,300	
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,636,700	
第338回利付国債(10年)	631,000,000	643,771,440	
第339回利付国債(10年)	385,000,000	393,227,450	
第340回利付国債(10年)	934,000,000	955,192,460	
第341回利付国債(10年)	440,000,000	448,426,000	
第342回利付国債(10年)	380,000,000	383,693,600	
第343回利付国債(10年)	680,000,000	686,779,600	
第344回利付国債(10年)	630,000,000	636,419,700	
第345回利付国債(10年)	870,000,000	879,039,300	
第346回利付国債(10年)	890,000,000	899,389,500	
第347回利付国債(10年)	310,000,000	313,317,000	
第348回利付国債(10年)	660,000,000	666,930,000	
第349回利付国債(10年)	600,000,000	606,348,000	
第350回利付国債(10年)	480,000,000	484,939,200	
第351回利付国債(10年)	180,000,000	181,791,000	
第352回利付国債(10年)	750,000,000	757,170,000	
第353回利付国債(10年)	740,000,000	746,748,800	
第354回利付国債(10年)	500,000,000	504,310,000	
第355回利付国債(10年)	550,000,000	554,449,500	
第356回利付国債(10年)	960,000,000	967,200,000	
第357回利付国債(10年)	760,000,000	765,213,600	
第358回利付国債(10年)	580,000,000	583,578,600	
第359回利付国債(10年)	810,000,000	814,398,300	
第360回利付国債(10年)	710,000,000	713,294,400	
第361回利付国債(10年)	720,000,000	722,397,600	
第362回利付国債(10年)	290,000,000	290,707,600	
第1回利付国債(30年)	60,000,000	73,891,800	
第7回利付国債(30年)	40,000,000	49,552,400	
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,203,000	
第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,422,000	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	110,371,500	
第14回利付国債(30年)	60,000,000	76,810,800	
第15回利付国債(30年)	160,000,000	207,604,800	
第16回利付国債(30年)	100,000,000	130,143,000	
第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,598,000	

第18回利付国債(30年)	60,000,000	76,914,600	
第19回利付国債(30年)	100,000,000	128,514,000	
第20回利付国債(30年)	100,000,000	131,700,000	
第21回利付国債(30年)	90,000,000	116,301,600	
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,238,000	
第23回利付国債(30年)	160,000,000	212,504,000	
第24回利付国債(30年)	100,000,000	133,147,000	
第25回利付国債(30年)	100,000,000	130,470,000	
第26回利付国債(30年)	145,000,000	191,910,400	
第27回利付国債(30年)	215,000,000	289,362,050	
第28回利付国債(30年)	110,000,000	148,789,300	
第29回利付国債(30年)	70,000,000	93,922,500	
第30回利付国債(30年)	190,000,000	252,842,500	
第31回利付国債(30年)	130,000,000	171,303,600	
第32回利付国債(30年)	215,000,000	288,330,050	
第33回利付国債(30年)	290,000,000	374,648,100	
第34回利付国債(30年)	315,000,000	419,983,200	
第35回利付国債(30年)	316,000,000	411,109,680	
第36回利付国債(30年)	315,000,000	411,153,750	
第37回利付国債(30年)	320,000,000	412,761,600	
第38回利付国債(30年)	220,000,000	280,170,000	
第39回利付国債(30年)	190,000,000	246,344,500	
第40回利付国債(30年)	175,000,000	223,413,750	
第41回利付国債(30年)	195,000,000	245,235,900	
第42回利付国債(30年)	190,000,000	239,185,300	
第43回利付国債(30年)	130,000,000	163,818,200	
第44回利付国債(30年)	180,000,000	227,048,400	
第45回利付国債(30年)	250,000,000	304,685,000	
第46回利付国債(30年)	240,000,000	292,675,200	
第47回利付国債(30年)	270,000,000	335,658,600	
第48回利付国債(30年)	233,000,000	279,415,930	
第49回利付国債(30年)	240,000,000	287,930,400	
第50回利付国債(30年)	250,000,000	265,105,000	
第51回利付国債(30年)	270,000,000	254,556,000	
第52回利付国債(30年)	230,000,000	227,189,400	
第53回利付国債(30年)	210,000,000	212,116,800	

第54回利付国債(30年)	270,000,000	285,268,500	
第55回利付国債(30年)	120,000,000	126,699,600	
第56回利付国債(30年)	200,000,000	211,018,000	
第57回利付国債(30年)	230,000,000	242,493,600	
第58回利付国債(30年)	420,000,000	442,482,600	
第59回利付国債(30年)	280,000,000	287,865,200	
第60回利付国債(30年)	190,000,000	204,590,100	
第61回利付国債(30年)	180,000,000	184,478,400	
第62回利付国債(30年)	230,000,000	223,711,800	
第63回利付国債(30年)	240,000,000	226,824,000	
第64回利付国債(30年)	220,000,000	207,332,400	
第65回利付国債(30年)	190,000,000	178,761,500	
第66回利付国債(30年)	230,000,000	216,034,400	
第67回利付国債(30年)	160,000,000	158,430,400	
第68回利付国債(30年)	230,000,000	227,444,700	
第69回利付国債(30年)	280,000,000	284,177,600	
第70回利付国債(30年)	50,000,000	50,624,500	
第56回利付国債(20年)	10,000,000	10,232,000	
第57回利付国債(20年)	110,000,000	112,432,100	
第58回利付国債(20年)	100,000,000	102,723,000	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	41,164,000	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,729,600	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	51,041,000	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,559,200	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	62,427,000	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	125,722,800	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	400,060,200	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,156,600	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	95,973,300	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	63,811,200	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	118,635,000	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	107,229,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	225,720,600	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	193,798,800	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	108,560,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	107,789,000	

第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,634,800	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	54,140,500	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,738,400	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	98,192,700	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,769,000	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	186,432,200	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	11,019,900	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	131,684,400	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	166,003,500	
第86回利付国債(20年)	100,000,000	111,641,000	
第87回利付国債(20年)	90,000,000	100,039,500	
第88回利付国債(20年)	185,000,000	207,662,500	
第89回利付国債(20年)	120,000,000	134,086,800	
第90回利付国債(20年)	170,000,000	190,898,100	
第91回利付国債(20年)	80,000,000	90,264,000	
第92回利付国債(20年)	255,000,000	286,303,800	
第93回利付国債(20年)	80,000,000	89,760,000	
第94回利付国債(20年)	140,000,000	157,901,800	
第95回利付国債(20年)	185,000,000	211,882,350	
第96回利付国債(20年)	70,000,000	79,314,900	
第97回利付国債(20年)	130,000,000	148,752,500	
第98回利付国債(20年)	70,000,000	79,651,600	
第99回利付国債(20年)	85,000,000	97,149,900	
第100回利付国債(20年)	151,000,000	174,312,890	
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,362,200	
第102回利付国債(20年)	145,000,000	170,156,050	
第103回利付国債(20年)	100,000,000	116,638,000	
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,521,600	
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,880,760	
第106回利付国債(20年)	40,000,000	46,563,600	
第107回利付国債(20年)	80,000,000	92,895,200	
第108回利付国債(20年)	220,000,000	252,115,600	
第109回利付国債(20年)	80,000,000	91,986,400	
第110回利付国債(20年)	195,000,000	227,274,450	
第111回利付国債(20年)	50,000,000	58,899,000	
第112回利付国債(20年)	205,000,000	239,827,450	



第113回利付国債(20年)	85,000,000	99,807,850	
第114回利付国債(20年)	160,000,000	188,544,000	
第115回利付国債(20年)	100,000,000	118,697,000	
第116回利付国債(20年)	140,000,000	166,779,200	
第117回利付国債(20年)	225,000,000	266,055,750	
第118回利付国債(20年)	131,000,000	154,325,860	
第119回利付国債(20年)	150,000,000	173,989,500	
第120回利付国債(20年)	240,000,000	274,034,400	
第121回利付国債(20年)	205,000,000	240,376,850	
第122回利付国債(20年)	190,000,000	221,021,300	
第123回利付国債(20年)	265,000,000	316,555,750	
第124回利付国債(20年)	200,000,000	237,002,000	
第125回利付国債(20年)	120,000,000	144,974,400	
第126回利付国債(20年)	100,000,000	118,858,000	
第127回利付国債(20年)	130,000,000	153,245,300	
第128回利付国債(20年)	225,000,000	266,121,000	
第129回利付国債(20年)	240,000,000	281,460,000	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	258,680,400	
第131回利付国債(20年)	140,000,000	163,179,800	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	198,611,000	
第133回利付国債(20年)	245,000,000	288,803,550	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,173,800	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	46,836,800	
第136回利付国債(20年)	210,000,000	243,644,100	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	199,505,200	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	103,649,400	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	209,269,800	
第140回利付国債(20年)	420,000,000	494,256,000	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	218,166,800	
第142回利付国債(20年)	210,000,000	250,047,000	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	391,956,700	
第144回利付国債(20年)	190,000,000	220,090,300	
第145回利付国債(20年)	375,000,000	444,022,500	
第146回利付国債(20年)	400,000,000	474,556,000	
第147回利付国債(20年)	425,000,000	499,919,000	
第148回利付国債(20年)	415,000,000	484,043,550	

	第149回利付国債（20年）	380,000,000	443,862,800
	第150回利付国債（20年）	430,000,000	497,376,700
	第151回利付国債（20年）	455,000,000	514,864,350
	第152回利付国債（20年）	480,000,000	543,532,800
	第153回利付国債（20年）	330,000,000	378,447,300
	第154回利付国債（20年）	238,000,000	269,865,820
	第155回利付国債（20年）	380,000,000	420,416,800
	第156回利付国債（20年）	450,000,000	458,671,500
	第157回利付国債（20年）	380,000,000	375,595,800
	第158回利付国債（20年）	160,000,000	165,056,000
	第159回利付国債（20年）	360,000,000	376,646,400
	第160回利付国債（20年）	360,000,000	381,769,200
	第161回利付国債（20年）	370,000,000	386,442,800
	第162回利付国債（20年）	250,000,000	260,870,000
	第163回利付国債（20年）	330,000,000	344,015,100
	第164回利付国債（20年）	530,000,000	543,504,400
	第165回利付国債（20年）	330,000,000	337,979,400
	第166回利付国債（20年）	540,000,000	570,434,400
	第167回利付国債（20年）	310,000,000	316,655,700
	第168回利付国債（20年）	310,000,000	311,035,400
	第169回利付国債（20年）	370,000,000	364,065,200
	第170回利付国債（20年）	370,000,000	363,365,900
	第171回利付国債（20年）	330,000,000	323,726,700
	第172回利付国債（20年）	320,000,000	319,158,400
	第173回利付国債（20年）	420,000,000	418,143,600
	第174回利付国債（20年）	280,000,000	278,499,200
	第175回利付国債（20年）	340,000,000	343,988,200
	第176回利付国債（20年）	50,000,000	50,547,000
	国債証券合計	72,474,000,000	77,475,865,350
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	115,269,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,760,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	102,000,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,213,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	100,081,000
	平成29年度第6回北海道公募公債	100,000,000	99,987,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,538,000

第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,338,000	
第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,940,000	
第376回大阪府公募公債	110,000,000	112,080,100	
第444回大阪府公募公債	100,000,000	99,817,000	
第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,387,000	
平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,483,000	
平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,789,000	
平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,760,000	
平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,823,000	
平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,452,000	
平成24年度第5回愛知県公募公債	100,000,000	100,977,000	
平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,157,000	
平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,059,000	
平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,570,000	
平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	100,837,000	
第8回埼玉県公募公債	100,000,000	117,245,000	
第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,433,000	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,831,000	
平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,333,000	
第19回千葉県公募公債	100,000,000	111,812,000	
平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,199,000	
第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,136,000	
第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,807,000	
第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,996,000	
第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,438,000	
第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,917,000	
第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,308,000	
第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,090,000	
第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,817,000	
平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	102,106,000	
第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,083,000	
第26回横浜市公募公債	100,000,000	117,819,000	
平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,826,000	
平成29年度第2回福岡市公募公債	100,000,000	100,000,000	
平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	102,091,000	
平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,185,600	

	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,013,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,794,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,135,000	
	地方債証券合計	4,630,000,000	4,752,731,700	
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	101,677,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,096,000	
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,993,000	
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	98,935,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,692,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	133,624,000	
	第27回道路債券	100,000,000	106,815,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	174,382,500	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,251,500	
	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	129,289,810	
	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	101,647,000	
	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	101,951,000	
	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	105,365,910	
	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	134,939,140	
	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	100,569,000	
	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	100,782,000	
	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	100,980,000	
	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	100,519,000	
	第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	125,910,000	
	第13回公営企業債券	100,000,000	108,753,000	
	第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	129,124,710	
	第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,669,000	
	F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,778,000	

第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,922,200	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,458,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,219,270	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,491,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,368,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	114,706,000	
第10回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	117,487,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	112,555,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	79,730,000	79,413,471	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	85,152,000	85,076,214	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,994,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,722,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,458,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,619,000	84,654,203	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,565,000	84,369,730	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,791,000	85,474,415	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,134,000	84,934,114	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,447,000	88,122,965	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,538,000	89,713,784	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,597,000	93,013,890	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,465,000	95,527,052	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,141,000	98,557,117	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,791,000	
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	55,092,000	55,018,176	
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	56,796,000	56,758,514	
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	60,888,000	60,888,000	
第340回信金中金債	100,000,000	100,139,000	
第358回信金中金債（5年）	100,000,000	99,902,000	
第372回信金中金債	100,000,000	100,066,000	
第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,164,000	
第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,206,000	
第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,928,000	
第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,048,000	
特殊債券合計	5,648,955,000	5,889,889,685	

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	100,343,000	
	第3回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,104,000	
	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	99,927,000	
	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	98,482,000	
	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	99,742,000	
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,001,000	
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	100,264,000	
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,049,000	
	第12回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,923,000	
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,803,000	
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,524,000	
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,267,000	
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,923,000	
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,918,000	
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,118,000	
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	99,388,000	
	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	100,049,000	
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,746,000	
	第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,010,000	
	第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,933,000	
	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	100,505,000	
	第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,451,000	
	第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,994,000	
	第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,013,000	
	第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,952,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,569,000		
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通	100,000,000	107,800,000		

社債			
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,186,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	99,667,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,060,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,835,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,027,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	99,865,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,602,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,242,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,603,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	102,413,000	
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	101,336,000	
社債券合計	3,800,000,000	3,820,634,000	
合計		91,939,120,735	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

### 貸借対照表

（単位：円）

2021年 5月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	76,457,062
コール・ローン	3,115,002,954
国債証券	223,577,086,754
派生商品評価勘定	10,081,843
未収入金	2,313,638,891
未収利息	1,305,071,345

2021年 5月17日現在

前払費用	122,427,195
流動資産合計	230,519,766,044
資産合計	230,519,766,044
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,941,231,617
前受収益	40,526
未払金	1,856,219,411
未払解約金	3,036,925,000
未払利息	8,448
流動負債合計	6,834,425,002
負債合計	6,834,425,002
純資産の部	
元本等	
元本	217,733,587,117
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,951,753,925
元本等合計	223,685,341,042
純資産合計	223,685,341,042
負債純資産合計	230,519,766,044

## 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 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	154,189,110,823円
期中追加設定元本額	129,203,891,684円



期中一部解約元本額	65,659,415,390円
期末元本額	217,733,587,117円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	23,891,705,687円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	12,295,459,690円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,805,573,076円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,333,770,448円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	530,539,522円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	151,167,991円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	107,668,148円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	34,004,436円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	7,353,180円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,348,913円
リスクコントロール・オープン	281,546,491円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,953,454,150円
FWりそな円建債券アクティブファンド	486,164,417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)	120,115,356,902円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	971,793,342円
Smart-i 8資産バランス 安定型	746,891,294円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	480,022,041円
Smart-i 8資産バランス 成長型	183,219,623円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	9,666,768,488円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	10,734,644,098円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	6,343,298,735円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	4,196,125,807円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,731,789,228円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,484,554,133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)	7,272,725,740円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	11,969,747円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	2,435,963,906円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	474,707,884円
2. 計算日における受益権の総数	217,733,587,117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	1.0273円
(10,000口当たり純資産額)	(10,273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 5月17日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

### 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在

### 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

### 2. 時価の算定方法

#### 国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

#### デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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 5月17日現在

該当事項はありません。

## (重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

### 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		10,059,343,394
合計		10,059,343,394

(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 5月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,813,707,480	-	1,816,256,562	2,549,082
	米ドル	769,386,643	-	768,682,216	704,427
	カナダドル	52,243,364	-	52,141,897	101,467
	メキシコペソ	94,839,746	-	95,783,017	943,271
	ユーロ	707,699,471	-	709,677,479	1,978,008
	英ポンド	113,105,130	-	113,188,442	83,312
	イスラエルシケル	76,433,126	-	76,783,511	350,385
	売建	226,512,332,431	-	228,446,031,287	1,933,698,856
	米ドル	100,109,117,040	-	100,649,683,431	540,566,391
	カナダドル	4,629,455,048	-	4,756,532,773	127,077,725
	メキシコペソ	1,880,072,665	-	1,905,127,716	25,055,051
	ユーロ	93,134,385,677	-	93,992,372,669	857,986,992
	英ポンド	14,703,654,204	-	14,997,337,658	293,683,454
	スウェーデンクローナ	804,259,863	-	812,799,520	8,539,657
	ノルウェークローネ	601,760,342	-	608,622,400	6,862,058
	デンマーククローネ	1,143,432,589	-	1,154,577,560	11,144,971
	ポーランドズロチ	1,421,237,078	-	1,447,099,191	25,862,113

	オーストラリアドル	5,032,468,728	-	5,072,939,881	40,471,153
	シンガポールドル	964,530,367	-	964,543,649	13,282
	マレーシアリンギット	1,027,806,802	-	1,026,544,827	1,261,975
	イスラエルシケル	1,060,152,028	-	1,057,850,012	2,302,016
	合計	228,326,039,911	-	230,262,287,849	1,931,149,774

(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	2,190,000.00	2,225,265.35	
		US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,492,323.26	
		US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,533,287.58	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,795,899.97	
		US TREASURY N/B	2,990,000.00	3,045,869.34	
		US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,848,928.32	

US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,502,342.70	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,156,066.29	
US TREASURY N/B	1,370,000.00	1,401,360.12	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,935,550.71	
US TREASURY N/B	4,870,000.00	4,872,472.98	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,242,581.88	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,476,056.88	
US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,013,609.37	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,003,046.80	
US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,802,958.95	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,543,945.25	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,393,655.26	
US TREASURY N/B	1,710,000.00	1,743,732.31	
US TREASURY N/B	8,760,000.00	8,763,763.29	
US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,483,724.17	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,564,634.15	
US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,782,344.46	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,802,038.70	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,524,271.72	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,564,160.00	
US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,914,700.32	
US TREASURY N/B	5,080,000.00	5,194,894.86	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,301,236.30	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,201,015.55	
US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,634,450.95	
US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,583,779.63	
US TREASURY N/B	5,730,000.00	5,730,223.47	
US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,383,062.02	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,425,176.35	
US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,976,542.31	
US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,781,017.17	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,554,101.50	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,355,972.57	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,566,650.25	
US TREASURY N/B	11,280,000.00	11,277,795.88	

US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,523,105.25	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,194,544.74	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,453,546.87	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,895,741.37	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,506,972.35	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,697,534.02	
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,929,702.52	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,550,654.74	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,897,562.50	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,121,276.76	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,895,027.22	
US TREASURY N/B	3,450,000.00	3,456,064.41	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,240,542.71	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,335,596.06	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,390,648.28	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,149,587.72	
US TREASURY N/B	2,390,000.00	2,525,184.37	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,681,357.40	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,194,011.64	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,382,667.14	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,254,347.05	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,795,241.96	
US TREASURY N/B	1,960,000.00	2,014,321.00	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,041,694.26	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,930,995.88	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,916,964.72	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,823,891.37	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,003,417.50	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,535,753.44	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,392,848.53	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,090,675.50	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,020,537.34	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,867,748.03	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,450,128.03	
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,592,954.34	

US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,220,276.58
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,503,257.79
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,927,803.52
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,892,566.26
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,555,759.31
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,629,725.28
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,005,625.00
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,435,320.24
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,107,844.01
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,220,854.43
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,298,471.71
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,502,300.34
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,651,075.21
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,563,336.58
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,176,952.80
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,505,359.77
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,768,029.44
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,549,604.67
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,665,047.42
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,860,642.84
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,570,635.32
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,808,622.25
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,802,849.23
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,376,298.82
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,057,757.40
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,553,609.36
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,972,855.16
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,813,276.09
US TREASURY N/B	1,990,000.00	2,053,625.47
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,175,520.32
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,492,939.41
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,044,804.60
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,732,152.81
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,992,734.00
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,770,435.40

US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,614,307.53
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,192,631.51
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,696,689.93
US TREASURY N/B	3,920,000.00	3,865,793.45
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,305,541.34
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,580,976.33
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,460,102.52
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,643,576.12
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,604,232.19
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,058,291.08
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,912,402.00
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,674,566.13
US TREASURY N/B	4,870,000.00	4,779,923.99
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,423,308.58
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,900,292.50
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,952,393.31
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,886,322.62
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,709,148.22
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,846,458.91
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,505,718.40
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,064,161.24
US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,077,564.21
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,136,152.58
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,838,224.45
US TREASURY N/B	6,100,000.00	6,018,031.25
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,856,117.69
US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,951,319.91
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,689,990.00
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,632,142.05
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,872,072.08
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,838,744.09
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,732,691.26
US TREASURY N/B	5,130,000.00	5,289,310.09
US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,951,662.46
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,078,370.28



US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,611,595.95
US TREASURY N/B	4,910,000.00	5,186,378.99
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,641,441.21
US TREASURY N/B	890,000.00	927,755.40
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,333,222.90
US TREASURY N/B	4,530,000.00	4,844,445.42
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,005,996.00
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,733,171.84
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,042,925.26
US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,972,545.27
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,407,827.60
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,373,876.80
US TREASURY N/B	4,110,000.00	3,922,962.53
US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,927,768.52
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,609,968.48
US TREASURY N/B	4,370,000.00	4,156,194.25
US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,794,824.00
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,590,527.18
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,876,372.77
US TREASURY N/B	12,830,000.00	12,425,553.49
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,426,887.22
US TREASURY N/B	9,190,000.00	9,178,512.50
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,744,318.12
US TREASURY N/B	220,000.00	284,255.46
US TREASURY N/B	7,590,000.00	8,409,630.42
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,300,251.36
US TREASURY N/B	530,000.00	681,898.79
US TREASURY N/B	5,640,000.00	6,151,344.96
US TREASURY N/B	5,010,000.00	5,369,408.38
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,068,164.00
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,759,062.50
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,285,972.42
US TREASURY N/B	780,000.00	1,093,828.08
US TREASURY N/B	7,320,000.00	6,742,119.67
US TREASURY N/B	15,650,000.00	14,351,538.28

US TREASURY N/B	6,170,000.00	5,772,806.25	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,317,825.89	
US TREASURY N/B	8,210,000.00	7,836,059.95	
US TREASURY N/B	540,000.00	720,056.25	
US TREASURY N/B	130,000.00	184,010.93	
US TREASURY N/B	690,000.00	920,422.25	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,546,006.25	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,160,812.41	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,708,090.93	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,828,942.95	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,154,000.00	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,083,133.58	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,282,722.58	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	6,587,858.54	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,790,038.99	
US TREASURY N/B	6,040,000.00	4,974,034.22	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,624,220.28	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	5,508,999.68	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,550,058.56	
US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,583,185.74	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,532,805.22	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,353,353.83	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,193,521.78	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,539,377.26	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,205,317.33	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,775,556.16	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,011,451.80	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,570,400.00	
US TREASURY N/B	2,960,000.00	3,264,440.44	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,006,460.39	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,849,409.58	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,891,759.96	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,235,274.15	
US TREASURY N/B	2,310,000.00	2,650,634.67	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,146,718.68	

US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,482,984.20	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,810,937.50	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	2,852,034.96	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,182,275.32	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,697,064.68	
US TREASURY N/B	2,410,000.00	2,479,193.26	
US TREASURY N/B	3,250,000.00	3,186,396.20	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,447,289.81	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,317,319.01	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,325,345.51	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	3,699,241.28	
US TREASURY N/B	3,050,000.00	3,291,319.05	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,578,002.55	
US TREASURY N/B	3,940,000.00	4,557,702.56	
US TREASURY N/B	4,190,000.00	4,741,164.75	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	5,207,786.76	
US TREASURY N/B	4,480,000.00	5,077,187.13	
US TREASURY N/B	4,470,000.00	4,951,485.15	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	4,510,184.44	
US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,164,670.66	
US TREASURY N/B	4,560,000.00	4,211,320.05	
US TREASURY N/B	7,850,000.00	5,988,844.28	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	5,990,046.40	
US TREASURY N/B	7,120,000.00	5,990,256.07	
US TREASURY N/B	7,460,000.00	6,677,865.25	
	米ドル 小計	879,980,000.00	904,054,785.43 (98,948,796,265)
カナダドル	GOV OF CANADA	710,000.00	718,755.01
	GOV OF CANADA	1,080,000.00	1,108,595.16
	GOV OF CANADA	1,500,000.00	1,500,375.00
	GOV OF CANADA	2,110,000.00	2,130,819.37
	GOV OF CANADA	2,200,000.00	2,199,797.60
	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,249,122.50
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,857,117.92
	GOV OF CANADA	2,650,000.00	2,646,205.20

	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,197,971.19
	GOV OF CANADA	2,280,000.00	2,363,990.64
	GOV OF CANADA	840,000.00	881,612.76
	GOV OF CANADA	1,960,000.00	1,944,747.28
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,250,653.68
	GOV OF CANADA	840,000.00	865,292.40
	GOV OF CANADA	730,000.00	745,282.55
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,166,383.90
	GOV OF CANADA	3,120,000.00	3,077,387.04
	GOV OF CANADA	1,880,000.00	1,819,170.72
	GOV OF CANADA	1,150,000.00	1,180,809.65
	GOV OF CANADA	880,000.00	878,297.20
	GOV OF CANADA	920,000.00	914,215.04
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,052,063.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	467,133.80
	GOV OF CANADA	1,100,000.00	1,176,641.40
	GOV OF CANADA	3,600,000.00	3,527,607.60
	GOV OF CANADA	3,320,000.00	3,009,324.36
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,361,014.65
	GOV OF CANADA	470,000.00	672,746.72
	GOV OF CANADA	840,000.00	1,114,957.20
	GOV OF CANADA	1,160,000.00	1,468,419.64
	GOV OF CANADA	880,000.00	989,172.80
	GOV OF CANADA	3,630,000.00	3,480,400.44
	GOV OF CANADA	420,000.00	479,377.50
	カナダドル 小計	50,080,000.00	51,495,460.92 (4,649,525,166)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	29,350,000.00	29,870,742.37
	UNITED MEXICAN STATE	21,050,000.00	21,686,179.41
	UNITED MEXICAN STATE	25,280,000.00	26,912,582.40
	UNITED MEXICAN STATE	21,980,000.00	23,487,034.52
	UNITED MEXICAN STATE	24,140,000.00	27,427,143.80
	UNITED MEXICAN STATE	35,400,000.00	34,847,760.00
	UNITED MEXICAN STATE	43,910,000.00	46,430,732.58
	UNITED MEXICAN STATE	27,620,000.00	30,832,001.61
	UNITED MEXICAN STATE	21,446,000.00	22,817,664.71

	UNITED MEXICAN STATE	6,900,000.00	7,253,006.06
	UNITED MEXICAN STATE	6,300,000.00	7,837,380.81
	UNITED MEXICAN STATE	19,090,000.00	20,777,928.25
	UNITED MEXICAN STATE	18,100,000.00	18,136,558.38
	UNITED MEXICAN STATE	18,900,000.00	19,280,835.00
	メキシコペソ 小計	319,466,000.00	337,597,549.90 (1,854,862,218)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	695,975.40
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,061,521.00
	GOV OF AUSTRIA	590,000.00	597,167.91
	GOV OF AUSTRIA	1,050,000.00	1,063,886.25
	GOV OF AUSTRIA	1,050,000.00	1,110,447.45
	GOV OF AUSTRIA	930,000.00	945,949.50
	GOV OF AUSTRIA	900,000.00	968,445.90
	GOV OF AUSTRIA	550,000.00	560,423.05
	GOV OF AUSTRIA	1,020,000.00	1,095,267.84
	GOV OF AUSTRIA	840,000.00	1,056,707.40
	GOV OF AUSTRIA	1,430,000.00	1,515,721.35
	GOV OF AUSTRIA	920,000.00	964,037.64
	GOV OF AUSTRIA	880,000.00	1,237,948.80
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	968,187.22
	GOV OF AUSTRIA	1,060,000.00	1,107,228.30
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	907,490.22
	GOV OF AUSTRIA	1,690,000.00	1,669,026.08
	GOV OF AUSTRIA	830,000.00	1,053,841.87
	GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	2,114,620.50
	GOV OF AUSTRIA	290,000.00	259,197.36
	GOV OF AUSTRIA	740,000.00	1,151,879.00
	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	821,319.42
	GOV OF AUSTRIA	610,000.00	608,383.50
	GOV OF AUSTRIA	350,000.00	703,019.10
	GOV OF AUSTRIA	270,000.00	228,164.31
	GOV OF AUSTRIA	570,000.00	880,098.81
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	272,153.64
	GOV OF BELGIUM	1,320,000.00	1,409,130.36

GOV OF BELGIUM	1,220,000.00	1,294,389.98
GOV OF BELGIUM	880,000.00	897,556.00
GOV OF BELGIUM	1,420,000.00	1,560,869.24
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,833,913.45
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,863,757.23
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,154,348.55
GOV OF BELGIUM	1,740,000.00	1,862,010.54
GOV OF BELGIUM	1,260,000.00	1,340,982.72
GOV OF BELGIUM	1,010,000.00	1,023,352.20
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,467,659.66
GOV OF BELGIUM	1,230,000.00	1,312,562.52
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,654,722.30
GOV OF BELGIUM	800,000.00	801,087.10
GOV OF BELGIUM	2,540,000.00	2,749,651.60
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,588,008.21
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,332,711.60
GOV OF BELGIUM	700,000.00	931,879.90
GOV OF BELGIUM	1,840,000.00	2,968,072.72
GOV OF BELGIUM	600,000.00	677,537.40
GOV OF BELGIUM	780,000.00	937,802.58
GOV OF BELGIUM	640,000.00	599,297.28
GOV OF BELGIUM	1,580,000.00	2,597,902.36
GOV OF BELGIUM	900,000.00	1,456,266.60
GOV OF BELGIUM	1,020,000.00	1,167,160.59
GOV OF BELGIUM	920,000.00	1,076,045.80
GOV OF BELGIUM	580,000.00	779,174.90
GOV OF BELGIUM	650,000.00	869,052.60
GOV OF BELGIUM	450,000.00	352,473.88
GOV OF FINLAND	530,000.00	546,226.48
GOV OF FINLAND	510,000.00	531,159.90
GOV OF FINLAND	580,000.00	588,629.82
GOV OF FINLAND	510,000.00	549,155.76
GOV OF FINLAND	280,000.00	285,261.20
GOV OF FINLAND	520,000.00	617,849.44
GOV OF FINLAND	460,000.00	487,112.86

GOV OF FINLAND	610,000.00	636,935.77	
GOV OF FINLAND	550,000.00	576,167.62	
GOV OF FINLAND	470,000.00	569,157.31	
GOV OF FINLAND	510,000.00	533,951.13	
GOV OF FINLAND	1,240,000.00	1,295,090.72	
GOV OF FINLAND	360,000.00	357,652.08	
GOV OF FINLAND	490,000.00	521,088.54	
GOV OF FINLAND	390,000.00	430,491.36	
GOV OF FINLAND	580,000.00	555,446.86	
GOV OF FINLAND	320,000.00	302,000.00	
GOV OF FINLAND	380,000.00	538,594.52	
GOV OF FINLAND	350,000.00	412,802.95	
GOV OF FINLAND	350,000.00	292,376.00	
GOV OF FRANCE	2,670,000.00	2,687,795.55	
GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,667,321.15	
GOV OF FRANCE	1,620,000.00	1,638,085.68	
GOV OF FRANCE	4,700,000.00	4,753,836.60	
GOV OF FRANCE	5,160,000.00	5,407,882.27	
GOV OF FRANCE	3,830,000.00	4,286,095.55	
GOV OF FRANCE	1,420,000.00	1,441,457.33	
GOV OF FRANCE	4,220,000.00	4,287,038.47	
GOV OF FRANCE	3,030,000.00	3,288,122.67	
GOV OF FRANCE	3,820,000.00	4,125,504.50	
GOV OF FRANCE	4,610,000.00	4,690,753.81	
GOV OF FRANCE	4,260,000.00	4,423,371.00	
GOV OF FRANCE	2,270,000.00	2,924,509.10	
GOV OF FRANCE	3,850,000.00	4,094,036.10	
GOV OF FRANCE	3,820,000.00	3,881,605.14	
GOV OF FRANCE	4,590,000.00	5,471,573.76	
GOV OF FRANCE	3,280,000.00	3,417,792.80	
GOV OF FRANCE	4,310,000.00	4,434,813.29	
GOV OF FRANCE	3,450,000.00	3,705,300.00	
GOV OF FRANCE	5,320,000.00	6,334,258.00	
GOV OF FRANCE	4,380,000.00	4,644,149.04	
GOV OF FRANCE	5,830,000.00	6,180,931.02	

GOV OF FRANCE	3,440,000.00	4,953,512.62	
GOV OF FRANCE	3,660,000.00	3,802,428.90	
GOV OF FRANCE	4,460,000.00	4,431,964.44	
GOV OF FRANCE	4,440,000.00	5,398,449.48	
GOV OF FRANCE	4,960,000.00	4,879,206.56	
GOV OF FRANCE	5,770,000.00	6,513,124.07	
GOV OF FRANCE	980,000.00	952,749.14	
GOV OF FRANCE	3,100,000.00	5,015,955.00	
GOV OF FRANCE	3,120,000.00	3,442,299.12	
GOV OF FRANCE	2,540,000.00	4,025,701.88	
GOV OF FRANCE	4,470,000.00	4,922,703.72	
GOV OF FRANCE	2,360,000.00	3,683,025.44	
GOV OF FRANCE	2,800,000.00	3,326,869.55	
GOV OF FRANCE	1,330,000.00	1,270,743.18	
GOV OF FRANCE	3,720,000.00	6,336,008.16	
GOV OF FRANCE	1,090,000.00	1,012,032.30	
GOV OF FRANCE	2,410,000.00	3,660,765.90	
GOV OF FRANCE	2,710,000.00	3,385,536.29	
GOV OF FRANCE	2,910,000.00	3,272,335.74	
GOV OF FRANCE	3,120,000.00	2,866,409.52	
GOV OF FRANCE	1,720,000.00	3,161,883.74	
GOV OF FRANCE	1,450,000.00	2,777,048.70	
GOV OF FRANCE	1,180,000.00	1,426,266.00	
GOV OF FRANCE	620,000.00	454,441.40	
GOV OF GERMANY	1,440,000.00	1,450,004.40	
GOV OF GERMANY	2,290,000.00	2,352,842.18	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,077,291.64	
GOV OF GERMANY	1,050,000.00	1,059,138.15	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,815,930.26	
GOV OF GERMANY	1,180,000.00	1,192,319.20	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	1,993,786.56	
GOV OF GERMANY	1,100,000.00	1,113,261.48	
GOV OF GERMANY	2,460,000.00	2,492,171.88	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,411,479.45	
GOV OF GERMANY	2,000,000.00	2,121,656.39	



GOV OF GERMANY	2,780,000.00	2,826,131.32	
GOV OF GERMANY	3,520,000.00	3,756,434.88	
GOV OF GERMANY	1,710,000.00	1,742,633.64	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,152,174.66	
GOV OF GERMANY	2,210,000.00	2,329,676.35	
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,819,673.96	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,762,426.25	
GOV OF GERMANY	1,760,000.00	1,801,463.84	
GOV OF GERMANY	2,480,000.00	2,649,133.52	
GOV OF GERMANY	2,420,000.00	2,480,642.78	
GOV OF GERMANY	350,000.00	359,228.69	
GOV OF GERMANY	3,410,000.00	3,581,806.03	
GOV OF GERMANY	1,590,000.00	1,630,662.66	
GOV OF GERMANY	2,990,000.00	3,070,185.82	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,833,404.96	
GOV OF GERMANY	1,010,000.00	1,448,011.34	
GOV OF GERMANY	2,780,000.00	2,943,375.04	
GOV OF GERMANY	3,500,000.00	3,589,673.50	
GOV OF GERMANY	1,300,000.00	1,830,088.00	
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,319,468.29	
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,563,950.04	
GOV OF GERMANY	2,570,000.00	2,681,956.91	
GOV OF GERMANY	1,550,000.00	1,616,887.15	
GOV OF GERMANY	2,450,000.00	2,501,614.15	
GOV OF GERMANY	740,000.00	1,163,798.00	
GOV OF GERMANY	3,310,000.00	3,372,913.17	
GOV OF GERMANY	2,640,000.00	2,681,191.92	
GOV OF GERMANY	700,000.00	714,429.10	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,222,908.23	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,823,203.79	
GOV OF GERMANY	2,240,000.00	3,647,282.24	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	2,892,066.24	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	4,059,865.70	
GOV OF GERMANY	1,810,000.00	3,134,371.57	
GOV OF GERMANY	1,920,000.00	3,571,983.36	

GOV OF GERMANY	1,770,000.00	2,869,881.54
GOV OF GERMANY	3,050,000.00	4,561,479.35
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,338,618.26
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	3,364,776.72
GOV OF GERMANY	2,100,000.00	1,847,416.20
GOV OF IRELAND	510,000.00	514,254.93
GOV OF IRELAND	630,000.00	682,052.49
GOV OF IRELAND	700,000.00	777,903.00
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,284,898.65
GOV OF IRELAND	1,040,000.00	1,107,982.51
GOV OF IRELAND	710,000.00	726,492.59
GOV OF IRELAND	720,000.00	769,178.88
GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,364,993.28
GOV OF IRELAND	830,000.00	998,562.21
GOV OF IRELAND	1,320,000.00	1,319,868.00
GOV OF IRELAND	530,000.00	588,932.82
GOV OF IRELAND	650,000.00	630,063.20
GOV OF IRELAND	420,000.00	464,926.56
GOV OF IRELAND	390,000.00	383,624.67
GOV OF IRELAND	490,000.00	572,082.35
GOV OF IRELAND	350,000.00	334,283.63
GOV OF IRELAND	880,000.00	1,097,974.24
GOV OF IRELAND	540,000.00	606,962.70
GOV OF ITALY	1,380,000.00	1,402,015.96
GOV OF ITALY	1,900,000.00	1,928,776.45
GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,795,474.11
GOV OF ITALY	1,600,000.00	1,637,808.96
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,257,857.60
GOV OF ITALY	1,220,000.00	1,225,124.61
GOV OF ITALY	1,490,000.00	1,498,336.55
GOV OF ITALY	1,370,000.00	1,399,679.81
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,727,180.00
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,120,443.28
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,566,180.00
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,219,450.00

GOV OF ITALY	1,640,000.00	1,657,500.44	
GOV OF ITALY	1,700,000.00	1,805,672.00	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,641,896.35	
GOV OF ITALY	5,440,000.00	5,454,405.12	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,233,201.21	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,479,940.00	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,604,236.88	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,920,981.51	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,616,074.46	
GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,205,611.24	
GOV OF ITALY	2,470,000.00	2,495,033.45	
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,371,586.00	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,620,375.06	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,825,042.74	
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,849,136.45	
GOV OF ITALY	1,440,000.00	1,587,178.80	
GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,214,518.24	
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,335,490.85	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,196,235.51	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	1,914,966.00	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,656,727.04	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,312,259.80	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,749,730.14	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,884,591.00	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,901,887.16	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,222,814.60	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	2,586,161.84	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	2,378,720.08	
GOV OF ITALY	1,550,000.00	1,510,391.61	
GOV OF ITALY	1,870,000.00	2,406,624.55	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	2,937,018.60	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	2,040,250.92	
GOV OF ITALY	2,750,000.00	3,740,338.25	
GOV OF ITALY	2,490,000.00	3,036,828.90	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,415,744.00	

GOV OF ITALY	1,910,000.00	1,909,006.80	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	2,023,538.04	
GOV OF ITALY	2,730,000.00	2,696,257.20	
GOV OF ITALY	3,100,000.00	4,560,382.10	
GOV OF ITALY	950,000.00	906,930.32	
GOV OF ITALY	800,000.00	842,283.20	
GOV OF ITALY	2,830,000.00	4,229,208.60	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,914,448.22	
GOV OF ITALY	2,180,000.00	3,139,690.50	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	1,950,497.35	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,207,204.90	
GOV OF ITALY	1,410,000.00	1,555,746.62	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,458,688.66	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	1,458,960.15	
GOV OF ITALY	1,560,000.00	1,871,541.51	
GOV OF ITALY	2,160,000.00	3,297,864.67	
GOV OF ITALY	1,190,000.00	1,455,729.85	
GOV OF ITALY	2,220,000.00	3,413,289.96	
GOV OF ITALY	1,060,000.00	1,064,214.56	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	2,482,335.03	
GOV OF ITALY	910,000.00	844,470.90	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	1,913,626.80	
GOV OF ITALY	1,790,000.00	2,054,453.16	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	2,005,366.44	
GOV OF ITALY	1,170,000.00	1,630,570.50	
GOV OF ITALY	1,420,000.00	1,545,750.94	
GOV OF ITALY	920,000.00	844,947.32	
GOV OF ITALY	860,000.00	964,331.33	
GOV OF ITALY	1,000,000.00	921,119.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,950,000.00	2,015,956.80	
GOV OF NETHERLANDS	820,000.00	880,930.92	
GOV OF NETHERLANDS	1,930,000.00	2,031,997.60	
GOV OF NETHERLANDS	1,410,000.00	1,434,449.40	
GOV OF NETHERLANDS	1,480,000.00	1,603,236.04	
GOV OF NETHERLANDS	1,780,000.00	1,837,234.12	

GOV OF NETHERLANDS	1,510,000.00	1,582,211.22	
GOV OF NETHERLANDS	1,910,000.00	1,947,476.11	
GOV OF NETHERLANDS	1,460,000.00	1,556,485.56	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,555,806.56	
GOV OF NETHERLANDS	1,360,000.00	1,455,994.24	
GOV OF NETHERLANDS	1,820,000.00	1,877,699.46	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,296,248.76	
GOV OF NETHERLANDS	530,000.00	528,021.51	
GOV OF NETHERLANDS	1,290,000.00	1,651,630.86	
GOV OF NETHERLANDS	1,490,000.00	2,353,785.78	
GOV OF NETHERLANDS	680,000.00	641,993.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,232,527.20	
GOV OF NETHERLANDS	1,530,000.00	2,567,517.48	
GOV OF NETHERLANDS	1,520,000.00	2,376,903.04	
GOV OF NETHERLANDS	920,000.00	782,771.88	
GOV OF SPAIN	1,970,000.00	1,988,147.64	
GOV OF SPAIN	1,560,000.00	1,582,740.12	
GOV OF SPAIN	2,020,000.00	2,225,492.58	
GOV OF SPAIN	2,240,000.00	2,261,568.96	
GOV OF SPAIN	1,980,000.00	2,016,649.80	
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,230,284.54	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,759,657.90	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,811,733.00	
GOV OF SPAIN	1,590,000.00	1,621,067.01	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,446,819.18	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,353,677.40	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,094,214.20	
GOV OF SPAIN	2,050,000.00	2,473,304.50	
GOV OF SPAIN	2,230,000.00	2,464,538.02	
GOV OF SPAIN	2,150,000.00	2,163,434.06	
GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,128,687.51	
GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,611,891.31	
GOV OF SPAIN	2,660,000.00	2,857,334.76	
GOV OF SPAIN	1,950,000.00	2,121,748.20	
GOV OF SPAIN	2,580,000.00	2,694,913.20	

	GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,618,076.99	
	GOV OF SPAIN	2,150,000.00	2,330,494.65	
	GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,244,338.37	
	GOV OF SPAIN	1,610,000.00	2,194,019.45	
	GOV OF SPAIN	2,140,000.00	3,074,223.42	
	GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,100,062.91	
	GOV OF SPAIN	2,630,000.00	2,675,122.91	
	GOV OF SPAIN	2,920,000.00	2,931,191.19	
	GOV OF SPAIN	2,030,000.00	2,298,700.95	
	GOV OF SPAIN	2,470,000.00	2,635,114.56	
	GOV OF SPAIN	180,000.00	171,487.80	
	GOV OF SPAIN	2,650,000.00	4,104,110.65	
	GOV OF SPAIN	1,930,000.00	2,280,491.86	
	GOV OF SPAIN	1,940,000.00	2,172,012.73	
	GOV OF SPAIN	1,990,000.00	2,911,934.76	
	GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,104,954.50	
	GOV OF SPAIN	1,770,000.00	2,902,022.97	
	GOV OF SPAIN	1,280,000.00	1,264,765.44	
	GOV OF SPAIN	2,230,000.00	3,603,947.14	
	GOV OF SPAIN	1,290,000.00	2,274,600.24	
	GOV OF SPAIN	1,720,000.00	2,256,699.16	
	GOV OF SPAIN	1,300,000.00	1,654,507.40	
	GOV OF SPAIN	1,740,000.00	1,513,685.16	
	GOV OF SPAIN	1,390,000.00	2,063,049.12	
	GOV OF SPAIN	490,000.00	413,095.97	
	ユーロ 小計	602,080,000.00	689,085,585.09 (91,489,893,132)	
英ポンド	UK TREASURY	2,270,000.00	2,282,825.50	
	UK TREASURY	1,770,000.00	1,809,417.90	
	UK TREASURY	3,760,000.00	3,762,820.00	
	UK TREASURY	2,330,000.00	2,363,660.81	
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,595,703.90	
	UK TREASURY	1,940,000.00	1,936,915.40	
	UK TREASURY	2,170,000.00	2,223,290.86	
	UK TREASURY	1,190,000.00	1,290,448.85	

UK TREASURY	880,000.00	1,038,635.04
UK TREASURY	1,850,000.00	1,876,693.65
UK TREASURY	1,250,000.00	1,342,137.50
UK TREASURY	1,910,000.00	1,886,640.70
UK TREASURY	1,470,000.00	1,550,990.53
UK TREASURY	1,610,000.00	1,679,149.50
UK TREASURY	1,310,000.00	1,620,734.62
UK TREASURY	2,220,000.00	2,145,674.40
UK TREASURY	1,520,000.00	1,625,884.72
UK TREASURY	950,000.00	1,320,310.00
UK TREASURY	1,450,000.00	1,460,036.90
UK TREASURY	2,640,000.00	2,513,702.40
UK TREASURY	1,430,000.00	1,937,968.03
UK TREASURY	2,050,000.00	1,903,425.00
UK TREASURY	1,750,000.00	2,344,156.50
UK TREASURY	1,250,000.00	1,770,933.75
UK TREASURY	1,210,000.00	1,113,502.50
UK TREASURY	1,690,000.00	2,387,524.17
UK TREASURY	2,330,000.00	2,490,462.44
UK TREASURY	1,310,000.00	2,029,081.00
UK TREASURY	1,280,000.00	1,896,243.20
UK TREASURY	1,470,000.00	2,208,770.84
UK TREASURY	2,950,000.00	2,879,554.00
UK TREASURY	1,620,000.00	2,567,127.81
UK TREASURY	2,010,000.00	2,737,209.96
UK TREASURY	1,810,000.00	2,579,139.22
UK TREASURY	840,000.00	743,727.60
UK TREASURY	1,640,000.00	2,640,285.84
UK TREASURY	1,690,000.00	1,723,315.81
UK TREASURY	1,500,000.00	1,618,269.29
UK TREASURY	1,260,000.00	2,106,210.96
UK TREASURY	1,910,000.00	1,550,347.00
UK TREASURY	1,160,000.00	1,853,056.38
UK TREASURY	1,330,000.00	1,414,146.17
UK TREASURY	1,570,000.00	2,821,519.22

	UK TREASURY	1,890,000.00	2,105,849.34
	UK TREASURY	1,140,000.00	2,065,885.20
	UK TREASURY	900,000.00	673,650.00
	UK TREASURY	1,470,000.00	2,066,162.61
	UK TREASURY	1,380,000.00	2,472,753.00
	UK TREASURY	740,000.00	856,970.61
	英債券 小計	80,590,000.00	94,882,920.63 (14,633,792,848)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,855,000.00	11,288,711.52
	GOV OF SWEDEN	8,400,000.00	8,772,937.32
	GOV OF SWEDEN	6,380,000.00	7,054,480.20
	GOV OF SWEDEN	9,900,000.00	10,418,364.00
	GOV OF SWEDEN	5,160,000.00	5,355,331.80
	GOV OF SWEDEN	5,130,000.00	5,307,267.15
	GOV OF SWEDEN	3,200,000.00	3,096,184.32
	GOV OF SWEDEN	2,820,000.00	3,344,238.00
	GOV OF SWEDEN	4,400,000.00	6,401,623.80
	スウェーデンクローナ 小計	56,245,000.00	61,039,138.11 (801,443,883)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	8,740,000.00	9,004,385.00
	GOV OF NORWAY	5,470,000.00	5,821,381.86
	GOV OF NORWAY	4,040,000.00	4,168,956.80
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,454,867.00
	GOV OF NORWAY	7,630,000.00	7,876,525.30
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,491,604.90
	GOV OF NORWAY	5,420,000.00	5,573,494.40
	GOV OF NORWAY	4,170,000.00	4,139,996.85
	GOV OF NORWAY	1,900,000.00	1,854,305.00
	ノルウェークローネ 小計	44,080,000.00	45,385,517.11 (602,719,667)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	6,350,000.00	6,425,143.36
	GOV OF DENMARK	6,270,000.00	6,591,588.30
	GOV OF DENMARK	5,900,000.00	6,472,915.96
	GOV OF DENMARK	7,000,000.00	7,319,795.00
	GOV OF DENMARK	9,570,000.00	9,987,395.55
	GOV OF DENMARK	3,300,000.00	3,249,956.49



	GOV OF DENMARK	12,130,000.00	21,098,579.92
	GOV OF DENMARK	2,650,000.00	2,386,139.50
	デンマーククローネ 小計	53,170,000.00	63,531,514.08 (1,134,672,841)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	2,730,000.00	2,727,158.87
	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,573,552.00
	GOV OF POLAND	3,920,000.00	4,076,016.00
	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,515,498.00
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,081,641.11
	GOV OF POLAND	3,010,000.00	3,174,089.24
	GOV OF POLAND	1,900,000.00	1,891,204.52
	GOV OF POLAND	3,860,000.00	4,213,305.80
	GOV OF POLAND	4,300,000.00	4,557,707.16
	GOV OF POLAND	5,090,000.00	5,385,597.67
	GOV OF POLAND	3,120,000.00	3,357,432.00
	GOV OF POLAND	740,000.00	964,738.00
	GOV OF POLAND	4,790,000.00	5,153,082.00
	GOV OF POLAND	2,860,000.00	2,702,177.46
		ポーランドズロチ 小計	45,760,000.00
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	2,040,000.00	2,174,815.64
	GOV OF AUSTRALIA	2,230,000.00	2,303,461.32
	GOV OF AUSTRALIA	2,010,000.00	2,219,815.45
	GOV OF AUSTRALIA	1,330,000.00	1,433,660.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,720,000.00	2,714,944.60
	GOV OF AUSTRALIA	2,380,000.00	2,638,167.88
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	2,113,892.90
	GOV OF AUSTRALIA	1,700,000.00	1,990,209.04
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,659,931.12
	GOV OF AUSTRALIA	1,720,000.00	2,096,322.75
	GOV OF AUSTRALIA	2,730,000.00	3,013,256.06
	GOV OF AUSTRALIA	2,340,000.00	2,504,142.34
	GOV OF AUSTRALIA	1,360,000.00	1,500,889.46
	GOV OF AUSTRALIA	2,390,000.00	2,725,262.03
	GOV OF AUSTRALIA	2,060,000.00	2,267,631.30

	GOV OF AUSTRALIA	3,310,000.00	3,567,127.75
	GOV OF AUSTRALIA	3,400,000.00	3,194,188.81
	GOV OF AUSTRALIA	2,720,000.00	2,661,333.68
	GOV OF AUSTRALIA	2,470,000.00	2,283,093.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,470,000.00	2,326,566.10
	GOV OF AUSTRALIA	1,400,000.00	1,382,061.94
	GOV OF AUSTRALIA	1,300,000.00	1,668,073.03
	GOV OF AUSTRALIA	810,000.00	875,289.96
	GOV OF AUSTRALIA	1,190,000.00	1,432,934.93
	GOV OF AUSTRALIA	910,000.00	1,026,930.45
	GOV OF AUSTRALIA	1,150,000.00	1,198,613.37
	GOV OF AUSTRALIA	1,270,000.00	1,352,512.53
	GOV OF AUSTRALIA	1,400,000.00	1,122,153.90
	オーストラリアドル 小計	55,670,000.00	58,447,283.06 (4,965,681,168)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	660,000.00	683,364.00
	GOV OF SINGAPORE	1,000,000.00	1,023,195.00
	GOV OF SINGAPORE	650,000.00	681,525.00
	GOV OF SINGAPORE	290,000.00	301,455.00
	GOV OF SINGAPORE	1,090,000.00	1,175,238.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	576,234.00
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	296,361.00
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	518,322.00
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	713,790.00
	GOV OF SINGAPORE	420,000.00	457,380.00
	GOV OF SINGAPORE	630,000.00	700,245.00
	GOV OF SINGAPORE	840,000.00	936,142.20
	GOV OF SINGAPORE	570,000.00	672,885.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	567,051.30
	GOV OF SINGAPORE	390,000.00	416,894.40
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	710,520.00
	GOV OF SINGAPORE	610,000.00	710,040.00
	GOV OF SINGAPORE	600,000.00	597,342.00
	シンガポールドル 小計	10,870,000.00	11,737,983.90 (962,749,439)
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	824,775.69

	GOV OF MALAYSIA	1,000,000.00	1,024,744.20	
	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,666,725.09	
	GOV OF MALAYSIA	610,000.00	629,506.03	
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	859,939.84	
	GOV OF MALAYSIA	760,000.00	785,635.40	
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	877,832.56	
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,330,970.38	
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	769,977.28	
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,197,618.69	
	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	879,180.23	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,266,561.38	
	GOV OF MALAYSIA	1,010,000.00	1,076,177.32	
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,855,288.99	
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,428,705.27	
	GOV OF MALAYSIA	1,310,000.00	1,373,366.40	
	GOV OF MALAYSIA	2,000,000.00	2,104,459.40	
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,236,447.13	
	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,769,680.77	
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,856,881.31	
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,417,203.69	
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,189,702.25	
	GOV OF MALAYSIA	1,540,000.00	1,534,116.27	
	GOV OF MALAYSIA	600,000.00	624,102.72	
	GOV OF MALAYSIA	1,290,000.00	1,390,408.69	
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	961,158.43	
	GOV OF MALAYSIA	1,270,000.00	1,188,898.94	
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	807,211.90	
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	981,201.52	
	GOV OF MALAYSIA	930,000.00	998,753.22	
	GOV OF MALAYSIA	1,500,000.00	1,403,947.19	
	マレーシアリングット 小計	38,830,000.00	40,311,178.18	(1,066,750,677)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	2,110,000.00	2,140,173.00	
	GOV OF ISRAEL	1,120,000.00	1,146,096.00	
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	1,741,456.50	

	GOV OF ISRAEL	910,000.00	910,000.00	
	GOV OF ISRAEL	1,820,000.00	1,891,435.00	
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,617,072.50	
	GOV OF ISRAEL	3,390,000.00	3,395,424.00	
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,959,876.00	
	GOV OF ISRAEL	1,610,000.00	2,143,554.00	
	GOV OF ISRAEL	1,800,000.00	1,930,230.00	
	GOV OF ISRAEL	1,540,000.00	1,692,537.00	
	GOV OF ISRAEL	1,880,000.00	1,840,990.00	
	GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	2,016,364.50	
	GOV OF ISRAEL	2,000,000.00	3,153,900.00	
	GOV OF ISRAEL	2,180,000.00	2,744,947.00	
	イスラエルシェケル 小計	28,310,000.00	31,324,055.50 (1,048,187,471)	
	合計		223,577,086,754 (223,577,086,754)	

(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 241銘柄	100.0%	44.3%
カナダドル	国債証券 33銘柄	100.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券 333銘柄	100.0%	40.9%
英ポンド	国債証券 49銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 28銘柄	100.0%	2.2%
シンガポールドル	国債証券 18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 15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 M国内株式マザーファンド

#### 貸借対照表

（単位：円）	
2021年 5月17日現在	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,364,878,916
株式	48,772,214,410
派生商品評価勘定	518,900
未収入金	65,000
未収配当金	459,641,684
前払金	28,495,000
差入委託証拠金	33,000,000
流動資産合計	50,658,813,910
<b>資産合計</b>	
50,658,813,910	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,035,900
未払金	1,067,797,055
未払解約金	102,546,000
未払利息	3,702
流動負債合計	1,201,382,657
<b>負債合計</b>	
1,201,382,657	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	36,383,089,773
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	13,074,341,480
元本等合計	49,457,431,253
<b>純資産合計</b>	
49,457,431,253	
<b>負債純資産合計</b>	
50,658,813,910	

#### 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 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	18,838,355,085円
期中追加設定元本額	48,488,118,479円
期中一部解約元本額	30,943,383,791円
期末元本額	36,383,089,773円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,687,018,798円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,772,065,548円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,719,283,939円
DCりそな グローバルバランス	66,467,021円
つみたてバランスファンド	3,018,641,391円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	297,147,708円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	157,445,714円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	100,605,266円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	22,369,303円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	15,174,787円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	8,029,136円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	12,057,838円
リスクコントロール・オープン	10,325,078円
FWりそな国内株式アクティブファンド	490,458,690円
FWりそな国内株式インデックスファンド	18,207,284,532円
Smart-i TOPIXインデックス	1,381,301,284円
Smart-i 8資産バランス 安定型	54,624,098円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	132,692,626円
Smart-i 8資産バランス 成長型	150,030,024円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	345,160,058円

りそな・リスクコントロールファンド2019-09	399,140,580円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	235,688,947円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	155,846,434円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	312,119,107円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	53,294,976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)	4,354,768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)	738,778,425円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	964,422,959円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	344,617,410円
2. 計算日における受益権の総数	36,383,089,773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	1.3594円
(10,000口当たり純資産額)	(13,594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 5月17日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

#### 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、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 5月17日現在

該当事項はありません。

#### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

#### （その他の注記）

##### 1 有価証券に関する注記

##### 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		23,577,550
合計		23,577,550

（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 5月17日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引			



	買建	780,917,000	-	750,400,000	30,517,000
	合計	780,917,000	-	750,400,000	30,517,000

## (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	2,942.00	2,353,600	
日本水産	23,800	532.00	12,661,600	
マルハニチロ	4,000	2,561.00	10,244,000	
雪国まいたけ	2,100	1,806.00	3,792,600	
カネコ種苗	800	1,541.00	1,232,800	
サカタのタネ	3,100	3,790.00	11,749,000	
ホクト	2,200	1,982.00	4,360,400	
ホクリヨウ	400	697.00	278,800	
住石ホールディングス	4,400	127.00	558,800	
日鉄鉱業	600	6,200.00	3,720,000	
三井松島ホールディングス	1,100	928.00	1,020,800	
I N P E X	94,400	799.00	75,425,600	
石油資源開発	3,400	2,101.00	7,143,400	
K & O エナジーグループ	1,200	1,400.00	1,680,000	
ヒノキヤグループ	600	2,452.00	1,471,200	
ショーボンドホールディングス	3,700	4,625.00	17,112,500	
ミライト・ホールディングス	8,900	1,800.00	16,020,000	
タマホーム	1,600	2,334.00	3,734,400	
サンヨーホームズ	300	752.00	225,600	
日本アクア	1,000	520.00	520,000	

ファーストコーポレーション	800	802.00	641,600	
ベステラ	500	1,515.00	757,500	
Robot Home	4,800	209.00	1,003,200	
キャンディル	400	523.00	209,200	
スペースバリューホールディングス	3,100	724.00	2,244,400	
ダイセキ環境ソリューション	500	883.00	441,500	
第一カッター興業	600	1,335.00	801,000	
安藤・間	16,500	858.00	14,157,000	
東急建設	7,500	681.00	5,107,500	
コムシスホールディングス	9,100	3,200.00	29,120,000	
ピーアールホールディングス	3,400	514.00	1,747,600	
高松コンストラクショングループ	1,600	2,082.00	3,331,200	
東建コーポレーション	800	9,430.00	7,544,000	
ソネック	300	925.00	277,500	
ヤマウラ	1,100	891.00	980,100	
オリエンタル白石	8,600	285.00	2,451,000	
大成建設	18,400	3,875.00	71,300,000	
大林組	59,300	948.00	56,216,400	
清水建設	55,500	889.00	49,339,500	
飛鳥建設	1,700	1,082.00	1,839,400	
長谷工コーポレーション	19,400	1,538.00	29,837,200	
松井建設	2,300	757.00	1,741,100	
銭高組	300	4,260.00	1,278,000	
鹿島建設	43,400	1,448.00	62,843,200	
不動テトラ	1,500	1,780.00	2,670,000	
大末建設	700	981.00	686,700	
鉄建建設	1,200	1,857.00	2,228,400	
西松建設	4,200	3,450.00	14,490,000	
三井住友建設	14,300	481.00	6,878,300	
大豊建設	1,300	4,160.00	5,408,000	
前田建設工業	14,800	981.00	14,518,800	
佐田建設	1,400	425.00	595,000	
ナカノフード建設	1,400	381.00	533,400	
奥村組	3,300	2,914.00	9,616,200	
東鉄工業	2,500	2,544.00	6,360,000	
イチケン	400	1,903.00	761,200	

富士ピー・エス	800	555.00	444,000
浅沼組	700	4,455.00	3,118,500
戸田建設	24,600	773.00	19,015,800
熊谷組	2,700	2,976.00	8,035,200
北野建設	400	2,411.00	964,400
植木組	500	1,507.00	753,500
矢作建設工業	2,600	728.00	1,892,800
ピーエス三菱	2,000	616.00	1,232,000
日本ハウスホールディングス	4,000	329.00	1,316,000
大東建託	6,500	11,600.00	75,400,000
新日本建設	2,500	862.00	2,155,000
N I P P O	4,900	2,905.00	14,234,500
東亜道路工業	400	4,495.00	1,798,000
前田道路	3,700	2,198.00	8,132,600
日本道路	600	7,510.00	4,506,000
東亜建設工業	1,600	2,458.00	3,932,800
日本国土開発	5,800	605.00	3,509,000
若築建設	1,100	1,334.00	1,467,400
東洋建設	6,600	571.00	3,768,600
五洋建設	25,200	784.00	19,756,800
世紀東急工業	2,800	868.00	2,430,400
福田組	700	5,030.00	3,521,000
住友林業	13,900	2,235.00	31,066,500
日本基礎技術	1,800	502.00	903,600
巴コーポレーション	2,600	372.00	967,200
大和ハウス工業	54,700	3,242.00	177,337,400
ライト工業	3,400	1,806.00	6,140,400
積水ハウス	64,300	2,284.50	146,893,350
日特建設	1,500	781.00	1,171,500
北陸電気工事	1,000	1,213.00	1,213,000
ユアテック	3,400	744.00	2,529,600
日本リーテック	1,200	1,703.00	2,043,600
四電工	300	3,250.00	975,000
中電工	2,700	2,316.00	6,253,200
関電工	9,600	912.00	8,755,200
きんでん	12,000	1,847.00	22,164,000

東京エネシス	2,000	927.00	1,854,000	
トーエネック	600	3,795.00	2,277,000	
住友電設	1,700	2,356.00	4,005,200	
日本電設工業	3,200	1,769.00	5,660,800	
協和エクシオ	9,000	2,702.00	24,318,000	
新日本空調	1,600	2,153.00	3,444,800	
九電工	4,200	3,610.00	15,162,000	
三機工業	4,200	1,404.00	5,896,800	
日揮ホールディングス	19,800	1,043.00	20,651,400	
中外炉工業	600	2,009.00	1,205,400	
ヤマト	1,900	693.00	1,316,700	
太平電業	1,300	2,616.00	3,400,800	
高砂熱学工業	5,400	1,736.00	9,374,400	
三晃金属工業	200	2,556.00	511,200	
朝日工業社	400	2,921.00	1,168,400	
明星工業	3,800	746.00	2,834,800	
大気社	2,900	2,909.00	8,436,100	
ダイダン	1,300	2,722.00	3,538,600	
日比谷総合設備	1,900	1,884.00	3,579,600	
フィル・カンパニー	300	2,832.00	849,600	
東洋エンジニアリング	2,500	731.00	1,827,500	
レイズネクスト	3,200	1,212.00	3,878,400	
ニッポン	5,600	1,596.00	8,937,600	
日清製粉グループ本社	21,400	1,820.00	38,948,000	
日東富士製粉	100	7,160.00	716,000	
昭和産業	1,600	2,990.00	4,784,000	
鳥越製粉	1,700	800.00	1,360,000	
中部飼料	2,300	1,401.00	3,222,300	
フィード・ワン	2,500	814.00	2,035,000	
東洋精糖	300	1,186.00	355,800	
日本甜菜製糖	1,000	1,657.00	1,657,000	
D M三井製糖ホールディングス	1,500	1,851.00	2,776,500	
塩水港精糖	2,200	223.00	490,600	
日新製糖	900	1,730.00	1,557,000	
森永製菓	4,500	3,505.00	15,772,500	
中村屋	500	3,775.00	1,887,500	

江崎グリコ	5,200	4,350.00	22,620,000	
名糖産業	800	1,528.00	1,222,400	
井村屋グループ	1,100	2,380.00	2,618,000	
不二家	1,200	2,150.00	2,580,000	
山崎製パン	14,200	1,704.00	24,196,800	
第一屋製パン	400	953.00	381,200	
モロゾフ	300	5,230.00	1,569,000	
亀田製菓	1,100	4,590.00	5,049,000	
寿スピリッツ	1,800	6,160.00	11,088,000	
カルビー	8,600	2,610.00	22,446,000	
森永乳業	3,500	6,200.00	21,700,000	
六甲バター	1,300	1,511.00	1,964,300	
ヤクルト本社	13,000	5,920.00	76,960,000	
明治ホールディングス	12,500	6,750.00	84,375,000	
雪印メグミルク	4,600	2,279.00	10,483,400	
プリマハム	2,700	3,220.00	8,694,000	
日本ハム	7,200	4,585.00	33,012,000	
林兼産業	600	620.00	372,000	
丸大食品	1,900	1,705.00	3,239,500	
S Foods	1,700	3,275.00	5,567,500	
柿安本店	700	2,509.00	1,756,300	
伊藤ハム米久ホールディングス	12,200	724.00	8,832,800	
サッポロホールディングス	6,500	2,205.00	14,332,500	
アサヒグループホールディングス	41,400	5,033.00	208,366,200	
キリンホールディングス	80,400	2,142.50	172,257,000	
宝ホールディングス	14,100	1,418.00	19,993,800	
オエノンホールディングス	5,400	387.00	2,089,800	
養命酒製造	600	1,846.00	1,107,600	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14,500	1,856.00	26,912,000	
サントリー食品インターナショナル	12,700	4,090.00	51,943,000	
ダイドーグループホールディングス	1,100	5,160.00	5,676,000	
伊藤園	5,800	6,310.00	36,598,000	
キーコーヒー	1,900	2,081.00	3,953,900	
ユニカフェ	600	1,002.00	601,200	
ジャパンフーズ	300	1,233.00	369,900	

日清オイリオグループ	2,400	3,025.00	7,260,000
不二製油グループ本社	4,600	2,841.00	13,068,600
かどや製油	200	4,035.00	807,000
J - オイルミルズ	1,800	1,910.00	3,438,000
キッコーマン	13,700	6,800.00	93,160,000
味の素	45,100	2,387.50	107,676,250
ブルドックソース	900	2,241.00	2,016,900
キューピー	10,600	2,631.00	27,888,600
ハウス食品グループ本社	7,100	3,280.00	23,288,000
カゴメ	7,800	3,055.00	23,829,000
焼津水産化学工業	900	981.00	882,900
アリアケジャパン	1,700	6,420.00	10,914,000
ピエトロ	200	1,616.00	323,200
エバラ食品工業	400	2,511.00	1,004,400
やまみ	200	2,128.00	425,600
ニチレイ	9,000	2,860.00	25,740,000
東洋水産	9,800	4,390.00	43,022,000
イトアンドホールディングス	700	1,830.00	1,281,000
大冷	200	1,931.00	386,200
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,100	748.00	822,800
日清食品ホールディングス	7,400	7,980.00	59,052,000
永谷園ホールディングス	900	2,243.00	2,018,700
一正蒲鉾	700	1,011.00	707,700
フジッコ	2,100	1,948.00	4,090,800
ロック・フィールド	2,000	1,556.00	3,112,000
日本たばこ産業	101,700	2,171.50	220,841,550
ケンコーマヨネーズ	1,200	1,743.00	2,091,600
わらべや日洋ホールディングス	1,200	1,945.00	2,334,000
なとり	1,100	1,933.00	2,126,300
イフジ産業	300	932.00	279,600
ピクルスコーポレーション	500	3,280.00	1,640,000
ファーマフーズ	1,800	3,125.00	5,625,000
北の達人コーポレーション	6,600	478.00	3,154,800
ユーグレナ	9,700	871.00	8,448,700
ミヨシ油脂	700	1,232.00	862,400
理研ビタミン	1,800	1,427.00	2,568,600

片倉工業	2,500	1,446.00	3,615,000	
ゲンゼ	1,400	4,205.00	5,887,000	
東洋紡	7,300	1,388.00	10,132,400	
ユニチカ	5,400	372.00	2,008,800	
富士紡ホールディングス	900	3,870.00	3,483,000	
倉敷紡績	1,700	1,845.00	3,136,500	
シキボウ	1,000	933.00	933,000	
日本毛織	6,100	981.00	5,984,100	
ダイトウボウ	3,000	103.00	309,000	
トーア紡コーポレーション	700	458.00	320,600	
ダイドーリミテッド	2,400	175.00	420,000	
帝国繊維	2,100	2,042.00	4,288,200	
帝人	17,400	1,826.00	31,772,400	
東レ	134,000	684.50	91,723,000	
サカイオーベックス	400	2,935.00	1,174,000	
住江織物	400	1,973.00	789,200	
日本フェルト	1,000	435.00	435,000	
イチカワ	200	1,340.00	268,000	
日東製網	200	1,530.00	306,000	
アツギ	1,400	621.00	869,400	
ダイニック	700	784.00	548,800	
セーレン	4,600	1,973.00	9,075,800	
ソトー	700	799.00	559,300	
東海染工	200	1,119.00	223,800	
小松マテーレ	3,000	916.00	2,748,000	
ワコールホールディングス	4,600	2,507.00	11,532,200	
ホギメディカル	2,500	3,300.00	8,250,000	
クラウディアホールディングス	400	281.00	112,400	
T S Iホールディングス	5,600	311.00	1,741,600	
マツオカコーポレーション	600	1,869.00	1,121,400	
ワールド	2,400	1,435.00	3,444,000	
三陽商会	1,000	792.00	792,000	
ナイガイ	700	326.00	228,200	
オンワードホールディングス	11,100	302.00	3,352,200	
ルックホールディングス	600	1,399.00	839,400	
キムラタン	9,900	23.00	227,700	

ゴールドウイン	3,100	6,050.00	18,755,000	
デサント	3,200	1,875.00	6,000,000	
キング	1,000	503.00	503,000	
ヤマトインターナショナル	1,600	329.00	526,400	
特種東海製紙	1,100	4,680.00	5,148,000	
王子ホールディングス	83,300	704.00	58,643,200	
日本製紙	8,200	1,408.00	11,545,600	
三菱製紙	2,600	359.00	933,400	
北越コーポレーション	13,200	614.00	8,104,800	
中越パルプ工業	700	1,262.00	883,400	
巴川製紙所	600	797.00	478,200	
大王製紙	8,900	1,861.00	16,562,900	
阿波製紙	500	422.00	211,000	
レンゴー	19,100	949.00	18,125,900	
トーモク	1,100	1,977.00	2,174,700	
ザ・パック	1,400	2,774.00	3,883,600	
クラレ	29,200	1,151.00	33,609,200	
旭化成	122,700	1,226.00	150,430,200	
共和レザー	1,000	689.00	689,000	
昭和電工	14,100	3,610.00	50,901,000	
住友化学	145,700	580.00	84,506,000	
住友精化	900	3,565.00	3,208,500	
日産化学	10,200	5,550.00	56,610,000	
ラサ工業	600	1,897.00	1,138,200	
クレハ	1,600	6,650.00	10,640,000	
多木化学	700	5,890.00	4,123,000	
テイカ	1,400	1,229.00	1,720,600	
石原産業	3,300	1,006.00	3,319,800	
片倉コープアグリ	500	1,207.00	603,500	
日本曹達	2,600	3,465.00	9,009,000	
東ソー	28,600	2,051.00	58,658,600	
トクヤマ	5,500	2,299.00	12,644,500	
セントラル硝子	3,500	2,190.00	7,665,000	
東亜合成	11,300	1,183.00	13,367,900	
大阪ソーダ	1,900	2,435.00	4,626,500	
関東電化工業	4,400	898.00	3,951,200	



デンカ	6,800	4,175.00	28,390,000
信越化学工業	34,200	18,105.00	619,191,000
日本カーバイド工業	700	1,313.00	919,100
堺化学工業	1,300	1,862.00	2,420,600
第一稀元素化学工業	1,900	1,500.00	2,850,000
エア・ウォーター	18,900	1,855.00	35,059,500
日本酸素ホールディングス	15,200	2,224.00	33,804,800
日本化学工業	500	2,789.00	1,394,500
東邦アセチレン	300	1,245.00	373,500
日本パーカライズン	9,300	1,126.00	10,471,800
高压ガス工業	2,900	662.00	1,919,800
チタン工業	200	1,814.00	362,800
四国化成工業	2,500	1,193.00	2,982,500
戸田工業	400	2,268.00	907,200
ステラ ケミファ	1,000	2,937.00	2,937,000
保土谷化学工業	500	3,945.00	1,972,500
日本触媒	3,400	5,600.00	19,040,000
大日精化工業	1,500	2,364.00	3,546,000
カネカ	4,800	4,560.00	21,888,000
三菱瓦斯化学	18,500	2,476.00	45,806,000
三井化学	16,000	3,620.00	57,920,000
J S R	18,600	3,285.00	61,101,000
東京応化工業	3,200	6,750.00	21,600,000
大阪有機化学工業	1,700	3,745.00	6,366,500
三菱ケミカルホールディングス	123,700	855.70	105,850,090
K Hネオケム	3,100	2,906.00	9,008,600
ダイセル	24,900	864.00	21,513,600
住友ベークライト	2,900	4,335.00	12,571,500
積水化学工業	39,100	1,932.00	75,541,200
日本ゼオン	16,700	1,661.00	27,738,700
アイカ工業	5,200	4,145.00	21,554,000
宇部興産	9,300	2,390.00	22,227,000
積水樹脂	3,100	2,099.00	6,506,900
タキロンシーアイ	4,000	620.00	2,480,000
旭有機材	1,000	1,340.00	1,340,000
ニチバン	1,000	1,693.00	1,693,000

リケンテクノス	4,500	527.00	2,371,500	
大倉工業	900	2,287.00	2,058,300	
積水化成成品工業	2,500	573.00	1,432,500	
群栄化学工業	400	2,498.00	999,200	
タイガースポリマー	1,000	449.00	449,000	
ミライアル	600	1,262.00	757,200	
ダイキアクシス	700	838.00	586,600	
ダイキョーニシカワ	3,900	736.00	2,870,400	
竹本容器	700	971.00	679,700	
森六ホールディングス	1,000	2,191.00	2,191,000	
恵和	400	2,168.00	867,200	
日本化薬	11,500	1,022.00	11,753,000	
カーリットホールディングス	1,800	706.00	1,270,800	
日本精化	1,300	1,350.00	1,755,000	
扶桑化学工業	1,500	3,895.00	5,842,500	
トリケミカル研究所	1,700	3,275.00	5,567,500	
A D E K A	8,500	1,934.00	16,439,000	
日油	7,000	5,570.00	38,990,000	
新日本理化	3,000	262.00	786,000	
ハリマ化成グループ	1,400	904.00	1,265,600	
花王	45,300	6,765.00	306,454,500	
第一工業製薬	600	3,540.00	2,124,000	
石原ケミカル	500	2,200.00	1,100,000	
日華化学	600	1,179.00	707,400	
ニイタカ	400	2,729.00	1,091,600	
三洋化成工業	1,100	5,350.00	5,885,000	
有機合成薬品工業	1,400	293.00	410,200	
大日本塗料	2,100	855.00	1,795,500	
日本ペイントホールディングス	76,400	1,690.00	129,116,000	
関西ペイント	20,800	2,869.00	59,675,200	
神東塗料	1,400	194.00	271,600	
中国塗料	4,500	876.00	3,942,000	
日本特殊塗料	1,400	1,016.00	1,422,400	
藤倉化成	2,500	552.00	1,380,000	
太陽ホールディングス	1,400	5,010.00	7,014,000	
D I C	7,800	2,896.00	22,588,800	

サカイクス	4,000	1,048.00	4,192,000
東洋インキSCホールディングス	3,900	2,048.00	7,987,200
T & K TOKA	1,300	788.00	1,024,400
富士フイルムホールディングス	33,200	7,143.00	237,147,600
資生堂	37,600	7,697.00	289,407,200
ライオン	24,600	2,065.00	50,799,000
高砂香料工業	1,200	2,700.00	3,240,000
マングラム	4,000	1,933.00	7,732,000
ミルボン	2,500	6,030.00	15,075,000
ファンケル	6,900	3,455.00	23,839,500
コーセー	3,600	15,860.00	57,096,000
コタ	1,200	1,473.00	1,767,600
シーボン	200	1,954.00	390,800
ポーラ・オルビスホールディングス	8,100	2,808.00	22,744,800
ノエビアホールディングス	1,600	4,950.00	7,920,000
アジュバンコスメジャパン	400	1,033.00	413,200
新日本製薬	500	2,157.00	1,078,500
エステー	1,200	1,800.00	2,160,000
アグロ カネショウ	700	1,399.00	979,300
コニシ	3,100	1,546.00	4,792,600
長谷川香料	3,300	2,119.00	6,992,700
星光PMC	1,100	770.00	847,000
小林製薬	5,300	9,720.00	51,516,000
荒川化学工業	1,600	1,190.00	1,904,000
メック	1,300	2,753.00	3,578,900
日本高純度化学	500	2,660.00	1,330,000
タカラバイオ	4,900	2,919.00	14,303,100
JCU	2,100	3,745.00	7,864,500
新田ゼラチン	1,200	636.00	763,200
OATアグリオ	400	1,469.00	587,600
デクセリアルズ	5,300	1,941.00	10,287,300
アース製薬	1,400	6,550.00	9,170,000
北興化学工業	1,800	899.00	1,618,200
大成ラミック	600	2,742.00	1,645,200
クミアイ化学工業	7,800	836.00	6,520,800
日本農薬	3,400	568.00	1,931,200

アキレス	1,300	1,435.00	1,865,500	
有沢製作所	2,600	940.00	2,444,000	
日東電工	11,400	8,530.00	97,242,000	
レック	2,200	1,100.00	2,420,000	
三光合成	2,000	414.00	828,000	
きもと	2,900	254.00	736,600	
藤森工業	1,700	4,260.00	7,242,000	
前澤化成工業	1,200	1,188.00	1,425,600	
未来工業	700	1,717.00	1,201,900	
ウェーブロックホールディングス	700	694.00	485,800	
J S P	1,100	1,659.00	1,824,900	
エフピコ	3,500	4,445.00	15,557,500	
天馬	1,400	2,350.00	3,290,000	
信越ポリマー	2,900	1,053.00	3,053,700	
東リ	4,700	246.00	1,156,200	
ニフコ	6,900	3,655.00	25,219,500	
バルカー	1,500	2,056.00	3,084,000	
ユニ・チャーム	40,100	4,265.00	171,026,500	
ショーエイコーポレーション	400	930.00	372,000	
協和キリン	19,000	3,335.00	63,365,000	
武田薬品工業	157,200	3,768.00	592,329,600	
アステラス製薬	163,900	1,688.50	276,745,150	
大日本住友製薬	14,000	2,028.00	28,392,000	
塩野義製薬	23,800	5,771.00	137,349,800	
わかもと製薬	2,200	313.00	688,600	
日本新薬	5,400	7,160.00	38,664,000	
バイオフェルミン製薬	300	3,160.00	948,000	
中外製薬	59,100	4,078.00	241,009,800	
科研製薬	3,200	4,505.00	14,416,000	
エーザイ	20,900	6,883.00	143,854,700	
ロート製薬	9,000	2,821.00	25,389,000	
小野薬品工業	43,400	2,485.50	107,870,700	
久光製薬	5,500	6,280.00	34,540,000	
持田製薬	2,600	3,705.00	9,633,000	
参天製薬	32,900	1,439.00	47,343,100	
扶桑薬品工業	600	2,302.00	1,381,200	

日本ケミファ	200	2,301.00	460,200
ツムラ	6,300	3,430.00	21,609,000
日医工	5,400	911.00	4,919,400
キッセイ薬品工業	3,300	2,132.00	7,035,600
生化学工業	3,300	1,067.00	3,521,100
栄研化学	3,300	2,076.00	6,850,800
日水製薬	700	961.00	672,700
鳥居薬品	1,200	2,551.00	3,061,200
J C R ファーマ	5,300	3,320.00	17,596,000
東和薬品	2,700	2,316.00	6,253,200
富士製薬工業	1,200	1,135.00	1,362,000
ゼリア新薬工業	3,400	2,009.00	6,830,600
第一三共	162,200	2,633.00	427,072,600
キョーリン製薬ホールディングス	4,200	1,729.00	7,261,800
大幸薬品	2,300	1,107.00	2,546,100
ダイト	1,200	3,350.00	4,020,000
大塚ホールディングス	39,300	4,415.00	173,509,500
大正製薬ホールディングス	4,500	6,350.00	28,575,000
ペプチドリーム	9,700	4,855.00	47,093,500
あすか製薬ホールディングス	2,200	1,095.00	2,409,000
サワイグループホールディングス	4,100	4,860.00	19,926,000
日本コークス工業	15,900	108.00	1,717,200
ニチレキ	2,200	1,301.00	2,862,200
ユシロ化学工業	1,100	1,159.00	1,274,900
ビーピー・カストロール	700	1,412.00	988,400
富士石油	4,500	229.00	1,030,500
MORESCO	700	1,069.00	748,300
出光興産	21,000	2,695.00	56,595,000
E N E O S ホールディングス	284,300	462.00	131,346,600
コスモエネルギーホールディングス	6,000	2,416.00	14,496,000
横浜ゴム	10,900	2,200.00	23,980,000
TOYO TIRE	9,900	2,145.00	21,235,500
ブリヂストン	50,300	4,657.00	234,247,100
住友ゴム工業	17,000	1,423.00	24,191,000
藤倉コンポジット	1,700	473.00	804,100
オカモト	1,100	4,050.00	4,455,000

フコク	800	930.00	744,000	
ニッタ	2,000	2,677.00	5,354,000	
住友理工	3,700	665.00	2,460,500	
三ツ星ベルト	2,300	1,742.00	4,006,600	
バンドー化学	3,300	813.00	2,682,900	
日東紡績	2,800	3,575.00	10,010,000	
A G C	17,300	4,940.00	85,462,000	
日本板硝子	9,600	620.00	5,952,000	
石塚硝子	300	1,861.00	558,300	
日本山村硝子	800	907.00	725,600	
日本電気硝子	7,000	2,660.00	18,620,000	
オハラ	700	1,510.00	1,057,000	
住友大阪セメント	3,400	3,310.00	11,254,000	
太平洋セメント	11,200	2,591.00	29,019,200	
日本ヒューム	1,700	723.00	1,229,100	
日本コンクリート工業	4,100	382.00	1,566,200	
三谷セキサン	900	3,955.00	3,559,500	
アジアパイルホールディングス	2,900	490.00	1,421,000	
東海カーボン	18,500	1,740.00	32,190,000	
日本カーボン	1,000	4,375.00	4,375,000	
東洋炭素	1,100	2,347.00	2,581,700	
ノリタケカンパニーリミテド	1,000	4,065.00	4,065,000	
T O T O	13,500	5,650.00	76,275,000	
日本碍子	20,800	1,979.00	41,163,200	
日本特殊陶業	14,400	1,630.00	23,472,000	
ダントーホールディングス	1,400	295.00	413,000	
M A R U W A	700	10,620.00	7,434,000	
品川リフラクトリーズ	400	3,575.00	1,430,000	
黒崎播磨	300	4,490.00	1,347,000	
ヨータイ	1,400	1,171.00	1,639,400	
イソライト工業	800	634.00	507,200	
東京窯業	2,400	334.00	801,600	
ニッカトー	900	692.00	622,800	
フジミインコーポレーテッド	1,500	4,250.00	6,375,000	
クニミネ工業	600	1,156.00	693,600	
エーアンドエーマテリアル	400	1,041.00	416,400	

ニチアス	4,800	2,819.00	13,531,200	
ニチハ	2,600	3,135.00	8,151,000	
日本製鉄	89,200	2,159.00	192,582,800	
神戸製鋼所	34,200	758.00	25,923,600	
中山製鋼所	2,600	433.00	1,125,800	
合同製鐵	1,000	1,737.00	1,737,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	54,100	1,533.00	82,935,300	
東京製鐵	7,300	1,142.00	8,336,600	
共英製鋼	2,100	1,506.00	3,162,600	
大和工業	4,000	3,405.00	13,620,000	
東京鐵鋼	700	1,604.00	1,122,800	
大阪製鐵	1,000	1,264.00	1,264,000	
淀川製鋼所	2,500	2,397.00	5,992,500	
丸一鋼管	6,100	2,814.00	17,165,400	
モリ工業	600	2,531.00	1,518,600	
大同特殊鋼	3,100	5,650.00	17,515,000	
日本高周波鋼業	700	405.00	283,500	
日本冶金工業	1,500	2,197.00	3,295,500	
山陽特殊製鋼	2,200	1,609.00	3,539,800	
愛知製鋼	1,100	3,220.00	3,542,000	
日立金属	17,100	2,123.00	36,303,300	
日本金属	500	993.00	496,500	
大平洋金属	1,300	1,906.00	2,477,800	
新日本電工	12,000	320.00	3,840,000	
栗本鐵工所	800	1,703.00	1,362,400	
虹技	300	1,211.00	363,300	
日本鑄鉄管	200	1,325.00	265,000	
三菱製鋼	1,400	856.00	1,198,400	
日亜鋼業	2,700	300.00	810,000	
日本精線	300	4,080.00	1,224,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	924.00	739,200	
シンニッタン	2,200	255.00	561,000	
新家工業	500	1,589.00	794,500	
大紀アルミニウム工業所	2,800	1,090.00	3,052,000	
日本輕金属ホールディングス	5,100	2,164.00	11,036,400	
三井金属鋳業	5,000	3,280.00	16,400,000	

東邦亜鉛	1,000	2,037.00	2,037,000	
三菱マテリアル	12,300	2,279.00	28,031,700	
住友金属鉱山	23,900	4,694.00	112,186,600	
DOWAホールディングス	4,700	4,615.00	21,690,500	
古河機械金属	3,100	1,295.00	4,014,500	
エス・サイエンス	8,200	38.00	311,600	
大阪チタニウムテクノロジーズ	1,900	818.00	1,554,200	
東邦チタニウム	3,300	934.00	3,082,200	
UACJ	2,800	2,441.00	6,834,800	
CKサンエツ	400	3,720.00	1,488,000	
古河電気工業	5,800	2,939.00	17,046,200	
住友電気工業	65,200	1,599.50	104,287,400	
フジクラ	22,600	474.00	10,712,400	
昭和電線ホールディングス	1,800	1,582.00	2,847,600	
東京特殊電線	200	2,525.00	505,000	
タツタ電線	3,300	559.00	1,844,700	
カナレ電気	300	1,791.00	537,300	
平河ヒューテック	1,000	1,301.00	1,301,000	
リョービ	2,300	1,610.00	3,703,000	
アーレスティ	2,300	469.00	1,078,700	
アサヒホールディングス	7,000	2,259.00	15,813,000	
稲葉製作所	1,100	1,458.00	1,603,800	
宮地エンジニアリンググループ	600	2,209.00	1,325,400	
トーカロ	4,800	1,389.00	6,667,200	
アルファC o	700	1,179.00	825,300	
SUMCO	23,900	2,449.00	58,531,100	
川田テクノロジーズ	400	3,840.00	1,536,000	
RS Technologies	600	5,180.00	3,108,000	
ジェイテックコーポレーション	200	2,546.00	509,200	
信和	1,000	784.00	784,000	
東洋製罐グループホールディングス	11,900	1,303.00	15,505,700	
ホッカンホールディングス	900	1,397.00	1,257,300	
コロナ	1,000	929.00	929,000	
横河ブリッジホールディングス	3,200	2,072.00	6,630,400	
駒井ハルテック	400	1,742.00	696,800	
高田機工	200	2,687.00	537,400	



三和ホールディングス	17,600	1,341.00	23,601,600	
文化シャッター	5,500	1,068.00	5,874,000	
三協立山	2,400	812.00	1,948,800	
アルインコ	1,200	1,011.00	1,213,200	
東洋シャッター	400	630.00	252,000	
L I X I L	25,700	2,961.00	76,097,700	
日本フィルコン	1,300	498.00	647,400	
ノーリツ	3,900	1,705.00	6,649,500	
長府製作所	1,900	2,072.00	3,936,800	
リンナイ	3,600	10,640.00	38,304,000	
ダイニチ工業	900	789.00	710,100	
日東精工	2,300	545.00	1,253,500	
三洋工業	200	1,877.00	375,400	
岡部	3,800	694.00	2,637,200	
ジーテクト	2,300	1,514.00	3,482,200	
東プレ	3,500	1,588.00	5,558,000	
高周波熱錬	3,600	549.00	1,976,400	
東京製綱	1,300	1,226.00	1,593,800	
サンコール	1,600	460.00	736,000	
モリテック スチール	1,500	429.00	643,500	
パイオラックス	2,800	1,484.00	4,155,200	
エイチワン	1,800	761.00	1,369,800	
日本発條	18,600	838.00	15,586,800	
中央発條	900	1,053.00	947,700	
アドバネクス	300	1,397.00	419,100	
立川ブラインド工業	800	1,309.00	1,047,200	
三益半導体工業	1,500	2,503.00	3,754,500	
日本ドライケミカル	500	1,696.00	848,000	
日本製鋼所	5,700	2,444.00	13,930,800	
三浦工業	8,100	5,280.00	42,768,000	
タクマ	6,300	2,005.00	12,631,500	
ツガミ	3,900	1,584.00	6,177,600	
オークマ	2,200	5,540.00	12,188,000	
芝浦機械	1,900	2,466.00	4,685,400	
アマダ	27,400	1,101.00	30,167,400	
アイダエンジニアリング	4,900	892.00	4,370,800	

滝澤鉄工所	500	1,117.00	558,500	
F U J I	7,500	2,626.00	19,695,000	
牧野フライス製作所	2,200	4,200.00	9,240,000	
オーエスジー	9,200	1,781.00	16,385,200	
ダイジェット工業	200	1,336.00	267,200	
旭ダイヤモンド工業	4,900	525.00	2,572,500	
D M G 森精機	11,800	1,767.00	20,850,600	
ソディック	3,900	1,055.00	4,114,500	
ディスコ	2,500	31,300.00	78,250,000	
日東工器	900	1,904.00	1,713,600	
日進工具	1,500	1,430.00	2,145,000	
パンチ工業	1,600	573.00	916,800	
富士ダイス	900	641.00	576,900	
豊和工業	1,000	805.00	805,000	
O K K	700	419.00	293,300	
石川製作所	500	1,688.00	844,000	
東洋機械金属	1,300	515.00	669,500	
津田駒工業	400	910.00	364,000	
エンシュウ	400	889.00	355,600	
島精機製作所	2,700	2,152.00	5,810,400	
オプトラン	2,300	2,664.00	6,127,200	
N C ホールディングス	600	780.00	468,000	
イワキポンプ	1,200	970.00	1,164,000	
フリー	1,800	1,031.00	1,855,800	
ヤマシンフィルタ	3,800	788.00	2,994,400	
日阪製作所	2,300	837.00	1,925,100	
やまびこ	3,600	1,265.00	4,554,000	
平田機工	900	6,140.00	5,526,000	
ペガサスミシン製造	1,900	488.00	927,200	
マルマエ	800	1,533.00	1,226,400	
タツモ	800	1,562.00	1,249,600	
ナプテスコ	11,000	4,770.00	52,470,000	
三井海洋開発	2,000	2,107.00	4,214,000	
レオン自動機	1,800	1,258.00	2,264,400	
S M C	5,500	61,290.00	337,095,000	
ホソカワミクロン	700	5,750.00	4,025,000	

ユニオンツール	700	3,585.00	2,509,500	
オイレス工業	2,600	1,594.00	4,144,400	
日精エー・エス・ビー機械	600	5,160.00	3,096,000	
サトーホールディングス	2,500	2,546.00	6,365,000	
技研製作所	1,600	4,555.00	7,288,000	
日本エアテック	600	1,167.00	700,200	
カワタ	500	871.00	435,500	
日精樹脂工業	1,400	1,122.00	1,570,800	
オカダアイオン	600	1,195.00	717,000	
ワイエイシイホールディングス	700	914.00	639,800	
小松製作所	85,600	3,251.00	278,285,600	
住友重機械工業	10,800	3,230.00	34,884,000	
日立建機	8,800	3,525.00	31,020,000	
日工	2,800	697.00	1,951,600	
巴工業	700	2,083.00	1,458,100	
井関農機	1,900	1,488.00	2,827,200	
T O W A	1,800	1,823.00	3,281,400	
丸山製作所	400	1,612.00	644,800	
北川鉄工所	800	1,600.00	1,280,000	
ローツェ	800	8,790.00	7,032,000	
タカキタ	700	634.00	443,800	
クボタ	99,300	2,558.50	254,059,050	
荏原実業	500	5,400.00	2,700,000	
三菱化工機	600	2,505.00	1,503,000	
月島機械	3,500	1,203.00	4,210,500	
帝国電機製作所	1,300	1,296.00	1,684,800	
東京機械製作所	800	571.00	456,800	
新東工業	4,500	748.00	3,366,000	
澁谷工業	1,700	3,555.00	6,043,500	
アイチ コーポレーション	3,200	866.00	2,771,200	
小森コーポレーション	4,800	790.00	3,792,000	
鶴見製作所	1,500	1,810.00	2,715,000	
住友精密工業	300	2,160.00	648,000	
日本ギア工業	700	319.00	223,300	
酒井重工業	300	2,044.00	613,200	
荏原製作所	7,800	5,010.00	39,078,000	

石井鐵工所	300	2,951.00	885,300
西島製作所	1,900	869.00	1,651,100
北越工業	1,900	1,098.00	2,086,200
ダイキン工業	24,100	20,970.00	505,377,000
オルガノ	600	6,200.00	3,720,000
トーヨーカネツ	700	2,417.00	1,691,900
栗田工業	10,200	4,690.00	47,838,000
椿本チエイン	2,700	3,040.00	8,208,000
大同工業	900	971.00	873,900
木村化工機	1,600	833.00	1,332,800
アネスト岩田	3,200	992.00	3,174,400
ダイフク	10,400	9,380.00	97,552,000
サムコ	500	3,020.00	1,510,000
加藤製作所	1,000	981.00	981,000
油研工業	300	1,740.00	522,000
タダノ	9,100	1,088.00	9,900,800
フジテック	6,500	2,319.00	15,073,500
C K D	4,400	2,200.00	9,680,000
キトー	1,600	1,787.00	2,859,200
平和	5,300	1,885.00	9,990,500
理想科学工業	1,400	1,491.00	2,087,400
S A N K Y O	4,500	2,686.00	12,087,000
日本金銭機械	2,100	557.00	1,169,700
マースグループホールディングス	1,200	1,580.00	1,896,000
フクシマガリレイ	1,300	4,505.00	5,856,500
オーイズミ	800	374.00	299,200
ダイコク電機	900	891.00	801,900
竹内製作所	3,200	2,850.00	9,120,000
アマノ	4,900	2,875.00	14,087,500
J U K I	2,600	814.00	2,116,400
サンデンホールディングス	2,600	340.00	884,000
蛇の目マシン工業	1,700	756.00	1,285,200
マックス	2,500	1,622.00	4,055,000
グローリー	4,900	2,196.00	10,760,400
新晃工業	1,800	2,011.00	3,619,800
大和冷機工業	3,000	1,081.00	3,243,000

セガサミーホールディングス	17,200	1,387.00	23,856,400	
日本ピストンリング	700	1,164.00	814,800	
リケン	900	2,515.00	2,263,500	
T P R	2,500	1,516.00	3,790,000	
ツバキ・ナカシマ	3,600	1,556.00	5,601,600	
ホシザキ	5,900	9,850.00	58,115,000	
大豊工業	1,500	922.00	1,383,000	
日本精工	38,800	1,004.00	38,955,200	
N T N	43,700	311.00	13,590,700	
ジェイテクト	18,100	1,062.00	19,222,200	
不二越	1,800	4,110.00	7,398,000	
日本トムソン	5,200	622.00	3,234,400	
T H K	11,800	3,400.00	40,120,000	
ユーシン精機	1,300	831.00	1,080,300	
前澤給装工業	1,300	1,106.00	1,437,800	
イーグル工業	2,300	1,115.00	2,564,500	
前澤工業	1,100	642.00	706,200	
日本ピラー工業	1,900	1,978.00	3,758,200	
キッツ	5,800	729.00	4,228,200	
マキタ	24,600	4,910.00	120,786,000	
日立造船	15,000	713.00	10,695,000	
三菱重工業	29,700	3,229.00	95,901,300	
I H I	12,700	2,365.00	30,035,500	
スター精密	2,900	1,695.00	4,915,500	
日清紡ホールディングス	11,600	896.00	10,393,600	
イビデン	9,100	4,435.00	40,358,500	
コニカミノルタ	38,300	559.00	21,409,700	
ブラザー工業	23,100	2,153.00	49,734,300	
ミネベアミツミ	32,600	2,709.00	88,313,400	
日立製作所	90,900	5,384.00	489,405,600	
東芝	37,400	4,475.00	167,365,000	
三菱電機	189,000	1,639.00	309,771,000	
富士電機	11,400	4,805.00	54,777,000	
東洋電機製造	700	1,229.00	860,300	
安川電機	20,300	4,725.00	95,917,500	
シンフォニアテクノロジー	2,400	1,254.00	3,009,600	

明電舎	3,200	2,345.00	7,504,000	
オリジン	500	1,321.00	660,500	
山洋電気	900	7,020.00	6,318,000	
デンヨー	1,600	2,020.00	3,232,000	
東芝テック	2,000	4,360.00	8,720,000	
芝浦メカトロニクス	300	5,800.00	1,740,000	
マブチモーター	5,200	4,225.00	21,970,000	
日本電産	45,500	11,850.00	539,175,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	909.00	999,900	
トレックス・セミコンダクター	1,000	1,804.00	1,804,000	
東光高岳	1,000	1,379.00	1,379,000	
ダブル・スコープ	4,500	642.00	2,889,000	
宮越ホールディングス	700	840.00	588,000	
ダイヘン	2,100	4,780.00	10,038,000	
ヤーマン	3,100	1,435.00	4,448,500	
JVCケンウッド	16,300	221.00	3,602,300	
ミマキエンジニアリング	1,700	637.00	1,082,900	
I - P E X	900	2,121.00	1,908,900	
日新電機	4,400	1,227.00	5,398,800	
大崎電気工業	3,800	594.00	2,257,200	
オムロン	15,700	8,110.00	127,327,000	
日東工業	2,800	1,852.00	5,185,600	
I D E C	2,500	1,947.00	4,867,500	
正興電機製作所	600	1,592.00	955,200	
不二電機工業	300	1,286.00	385,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	6,800	2,877.00	19,563,600	
サクサホールディングス	400	1,502.00	600,800	
メルコホールディングス	700	4,520.00	3,164,000	
テクノメディカ	400	1,620.00	648,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	500	2,500.00	1,250,000	
日本電気	24,000	5,150.00	123,600,000	
富士通	17,000	16,825.00	286,025,000	
沖電気工業	7,700	951.00	7,322,700	
岩崎通信機	800	921.00	736,800	
電気興業	900	2,316.00	2,084,400	

サンケン電気	2,200	5,170.00	11,374,000	
ナカヨ	400	1,495.00	598,000	
アイホン	1,100	1,978.00	2,175,800	
ルネサスエレクトロニクス	81,300	1,168.00	94,958,400	
セイコーエプソン	23,400	1,856.00	43,430,400	
ワコム	13,700	677.00	9,274,900	
アルバック	3,500	4,765.00	16,677,500	
アクセル	800	902.00	721,600	
E I Z O	1,600	4,475.00	7,160,000	
ジャパンディスプレイ	64,300	41.00	2,636,300	
日本信号	4,400	943.00	4,149,200	
京三製作所	4,100	418.00	1,713,800	
能美防災	2,500	2,091.00	5,227,500	
ホーチキ	1,400	1,237.00	1,731,800	
星和電機	900	553.00	497,700	
エレコム	4,300	2,091.00	8,991,300	
パナソニック	201,500	1,209.00	243,613,500	
シャープ	25,100	1,828.00	45,882,800	
アンリツ	11,400	2,070.00	23,598,000	
富士通ゼネラル	5,800	2,655.00	15,399,000	
ソニーグループ	118,400	10,330.00	1,223,072,000	
T D K	9,100	13,440.00	122,304,000	
帝国通信工業	800	1,164.00	931,200	
タムラ製作所	6,800	528.00	3,590,400	
アルプスアルパイン	15,400	1,124.00	17,309,600	
池上通信機	600	837.00	502,200	
日本電波工業	1,800	689.00	1,240,200	
鈴木	800	1,020.00	816,000	
日本トリム	400	3,685.00	1,474,000	
ローランド ディー . ジー .	1,100	2,009.00	2,209,900	
フォスター電機	1,900	1,152.00	2,188,800	
S M K	500	2,581.00	1,290,500	
ヨコオ	1,500	2,196.00	3,294,000	
ティアック	1,100	114.00	125,400	
ホシデン	5,200	1,000.00	5,200,000	
ヒロセ電機	2,900	15,050.00	43,645,000	

日本航空電子工業	4,300	1,876.00	8,066,800	
TOA	2,200	910.00	2,002,000	
マクセルホールディングス	3,800	1,241.00	4,715,800	
古野電気	2,400	1,044.00	2,505,600	
ユニデンホールディングス	500	2,570.00	1,285,000	
スミダコーポレーション	1,600	989.00	1,582,400	
アイコム	800	2,560.00	2,048,000	
リオン	800	2,551.00	2,040,800	
本多通信工業	1,500	479.00	718,500	
船井電機	1,800	918.00	1,652,400	
横河電機	18,900	1,780.00	33,642,000	
新電元工業	700	3,380.00	2,366,000	
アズビル	12,800	4,250.00	54,400,000	
東亜ディーケーケー	900	842.00	757,800	
日本光電工業	7,800	3,135.00	24,453,000	
チノー	600	1,400.00	840,000	
共和電業	2,000	383.00	766,000	
日本電子材料	700	1,867.00	1,306,900	
堀場製作所	3,700	6,980.00	25,826,000	
アドバンテスト	14,100	9,080.00	128,028,000	
小野測器	800	520.00	416,000	
エスベック	1,700	1,915.00	3,255,500	
キーエンス	18,600	52,070.00	968,502,000	
日置電機	900	5,200.00	4,680,000	
シスメックス	14,700	10,550.00	155,085,000	
日本マイクロニクス	3,300	1,415.00	4,669,500	
メガチップス	1,900	3,565.00	6,773,500	
OBARA GROUP	1,100	3,600.00	3,960,000	
澤藤電機	200	2,205.00	441,000	
原田工業	800	903.00	722,400	
コーセル	2,300	1,001.00	2,302,300	
イリソ電子工業	1,600	5,140.00	8,224,000	
オブテックスグループ	3,100	1,920.00	5,952,000	
千代田インテグレ	800	1,792.00	1,433,600	
アイ・オー・データ機器	700	1,067.00	746,900	
レーザーテック	8,300	17,250.00	143,175,000	



スタンレー電気	13,200	3,010.00	39,732,000	
岩崎電気	700	1,489.00	1,042,300	
ウシオ電機	9,700	1,425.00	13,822,500	
岡谷電機産業	1,300	353.00	458,900	
ヘリオス テクノ ホールディング	1,700	338.00	574,600	
エノモト	500	1,678.00	839,000	
日本セラミック	1,900	2,727.00	5,181,300	
遠藤照明	1,000	725.00	725,000	
古河電池	1,300	1,553.00	2,018,900	
双信電機	900	475.00	427,500	
山一電機	1,200	1,568.00	1,881,600	
図研	1,200	3,135.00	3,762,000	
日本電子	3,400	5,260.00	17,884,000	
カシオ計算機	15,200	1,765.00	26,828,000	
ファナック	16,600	24,575.00	407,945,000	
日本シイエムケイ	4,100	473.00	1,939,300	
エンプラス	900	4,060.00	3,654,000	
大真空	600	2,505.00	1,503,000	
ローム	7,900	9,970.00	78,763,000	
浜松ホトニクス	13,600	6,470.00	87,992,000	
三井ハイテック	1,900	3,965.00	7,533,500	
新光電気工業	6,300	3,085.00	19,435,500	
京セラ	28,800	6,612.00	190,425,600	
太陽誘電	8,400	4,615.00	38,766,000	
村田製作所	55,500	8,164.00	453,102,000	
双葉電子工業	3,200	845.00	2,704,000	
北陸電気工業	700	988.00	691,600	
ニチコン	5,900	1,070.00	6,313,000	
日本ケミコン	1,900	2,135.00	4,056,500	
K O A	2,600	1,565.00	4,069,000	
市光工業	2,800	734.00	2,055,200	
小糸製作所	11,300	6,750.00	76,275,000	
ミツバ	3,500	831.00	2,908,500	
S C R E E Nホールディングス	3,300	9,430.00	31,119,000	
キヤノン電子	1,700	1,721.00	2,925,700	
キヤノン	93,900	2,516.50	236,299,350	

リコー	48,100	1,222.00	58,778,200
象印マホービン	5,100	1,685.00	8,593,500
MUTOHホールディングス	200	1,604.00	320,800
東京エレクトロン	11,100	44,700.00	496,170,000
トヨタ紡織	5,500	2,021.00	11,115,500
芦森工業	400	1,062.00	424,800
ユニプレス	3,100	1,005.00	3,115,500
豊田自動織機	15,300	9,120.00	139,536,000
モリタホールディングス	3,000	1,596.00	4,788,000
三櫻工業	2,600	1,034.00	2,688,400
デンソー	41,600	7,162.00	297,939,200
東海理化電機製作所	5,000	1,724.00	8,620,000
三井E & Sホールディングス	7,300	488.00	3,562,400
川崎重工業	14,700	2,529.00	37,176,300
名村造船所	5,700	168.00	957,600
サノヤスホールディングス	2,200	147.00	323,400
日本車輛製造	700	2,225.00	1,557,500
三菱ロジスネクスト	2,500	1,048.00	2,620,000
近畿車輛	300	1,226.00	367,800
日産自動車	222,900	537.80	119,875,620
いすゞ自動車	50,200	1,351.00	67,820,200
トヨタ自動車	191,500	8,648.00	1,656,092,000
日野自動車	23,600	966.00	22,797,600
三菱自動車工業	70,000	308.00	21,560,000
エフテック	1,300	710.00	923,000
レシップホールディングス	700	556.00	389,200
GMB	300	895.00	268,500
ファルテック	300	781.00	234,300
武蔵精密工業	4,200	2,057.00	8,639,400
日産車体	2,800	710.00	1,988,000
新明和工業	5,300	974.00	5,162,200
極東開発工業	3,300	1,649.00	5,441,700
トピー工業	1,600	1,359.00	2,174,400
ティラド	600	1,974.00	1,184,400
曙ブレーキ工業	10,300	191.00	1,967,300
タチエス	2,900	1,093.00	3,169,700

N O K	9,100	1,340.00	12,194,000
フタバ産業	4,700	511.00	2,401,700
K Y B	2,100	3,640.00	7,644,000
大同メタル工業	3,900	568.00	2,215,200
プレス工業	9,400	323.00	3,036,200
ミクニ	2,400	292.00	700,800
太平洋工業	4,000	1,204.00	4,816,000
河西工業	2,600	438.00	1,138,800
アイシン	13,800	4,280.00	59,064,000
マツダ	59,300	873.00	51,768,900
今仙電機製作所	1,700	711.00	1,208,700
本田技研工業	148,800	3,238.00	481,814,400
スズキ	37,500	4,361.00	163,537,500
S U B A R U	54,200	2,051.50	111,191,300
安永	900	1,105.00	994,500
ヤマハ発動機	26,700	2,972.00	79,352,400
T B K	2,200	415.00	913,000
エクセディ	2,600	1,536.00	3,993,600
豊田合成	6,100	2,677.00	16,329,700
愛三工業	3,000	761.00	2,283,000
盟和産業	300	908.00	272,400
日本プラスト	1,600	652.00	1,043,200
ヨロズ	1,600	1,193.00	1,908,800
エフ・シー・シー	3,100	1,692.00	5,245,200
シマノ	7,100	23,425.00	166,317,500
テイ・エス テック	8,800	1,484.00	13,059,200
ジャムコ	1,100	828.00	910,800
テルモ	57,900	3,936.00	227,894,400
クリエートメディック	600	1,002.00	601,200
日機装	6,100	1,163.00	7,094,300
日本エム・ディ・エム	1,100	2,213.00	2,434,300
島津製作所	24,300	3,835.00	93,190,500
J M S	1,600	864.00	1,382,400
クボテック	500	330.00	165,000
長野計器	1,400	1,105.00	1,547,000
ブイ・テクノロジー	900	5,100.00	4,590,000

東京計器	1,200	1,017.00	1,220,400
愛知時計電機	200	4,250.00	850,000
インターアクション	900	2,087.00	1,878,300
オーバル	1,700	269.00	457,300
東京精密	3,200	4,960.00	15,872,000
マニー	7,500	2,430.00	18,225,000
ニコン	28,900	1,097.00	31,703,300
トプコン	9,500	1,606.00	15,257,000
オリンパス	104,600	2,083.50	217,934,100
理研計器	1,700	2,786.00	4,736,200
タムロン	1,500	2,385.00	3,577,500
H O Y A	37,200	13,300.00	494,760,000
シード	800	702.00	561,600
ノーリツ鋼機	1,700	2,329.00	3,959,300
エー・アンド・デイ	1,600	1,004.00	1,606,400
朝日インテック	19,900	2,862.00	56,953,800
シチズン時計	24,000	410.00	9,840,000
リズム	600	745.00	447,000
大研医器	1,500	555.00	832,500
メニコン	2,900	6,710.00	19,459,000
シンシア	200	700.00	140,000
松風	900	1,871.00	1,683,900
セイコーホールディングス	2,700	2,101.00	5,672,700
ニプロ	14,100	1,314.00	18,527,400
中本パックス	500	1,557.00	778,500
スノーピーク	1,100	3,315.00	3,646,500
パラマウントベッドホールディングス	3,600	2,085.00	7,506,000
トランザクション	1,000	1,380.00	1,380,000
粧美堂	600	418.00	250,800
ニホンフラッシュ	1,600	1,260.00	2,016,000
前田工織	2,100	3,460.00	7,266,000
永大産業	2,500	305.00	762,500
アートネイチャー	1,800	675.00	1,215,000
バンダイナムコホールディングス	15,600	7,664.00	119,558,400
アイフィスジャパン	500	709.00	354,500
共立印刷	3,100	133.00	412,300

S H O E I	1,800	3,925.00	7,065,000	
フランスベッドホールディングス	2,400	934.00	2,241,600	
パイロットコーポレーション	3,200	3,565.00	11,408,000	
萩原工業	1,000	1,438.00	1,438,000	
トッパン・フォームズ	3,400	1,083.00	3,682,200	
フジシールインターナショナル	3,900	2,495.00	9,730,500	
タカラトミー	8,500	941.00	7,998,500	
廣濟堂	1,300	1,011.00	1,314,300	
エステールホールディングス	500	621.00	310,500	
タカノ	600	622.00	373,200	
プロネクサス	1,500	1,068.00	1,602,000	
ホクシン	1,100	193.00	212,300	
ウッドワン	600	1,323.00	793,800	
大建工業	1,300	2,024.00	2,631,200	
凸版印刷	28,700	1,830.00	52,521,000	
大日本印刷	22,800	2,284.00	52,075,200	
共同印刷	600	2,863.00	1,717,800	
N I S S H A	3,900	1,494.00	5,826,600	
光村印刷	200	1,722.00	344,400	
T A K A R A & C O M P A N Y	900	1,845.00	1,660,500	
アシックス	16,700	2,397.00	40,029,900	
ツツミ	500	2,320.00	1,160,000	
ローランド	1,500	5,350.00	8,025,000	
小松ウオール工業	600	1,959.00	1,175,400	
ヤマハ	11,200	6,180.00	69,216,000	
河合楽器製作所	500	3,760.00	1,880,000	
クリナップ	1,800	529.00	952,200	
ピジョン	12,100	3,450.00	41,745,000	
オリバー	400	2,848.00	1,139,200	
兼松サステック	100	1,753.00	175,300	
キングジム	1,600	946.00	1,513,600	
リンテック	4,000	2,448.00	9,792,000	
イトーキ	3,700	359.00	1,328,300	
任天堂	10,800	62,710.00	677,268,000	
三菱鉛筆	3,100	1,473.00	4,566,300	
タカラスタANDARD	3,900	1,592.00	6,208,800	

コクヨ	9,100	1,731.00	15,752,100	
ナカバヤシ	1,900	597.00	1,134,300	
グロープライド	900	3,975.00	3,577,500	
オカムラ	6,500	1,350.00	8,775,000	
美津濃	1,900	2,233.00	4,242,700	
東京電力ホールディングス	160,300	347.00	55,624,100	
中部電力	57,800	1,367.50	79,041,500	
関西電力	71,600	1,085.50	77,721,800	
中国電力	27,300	1,085.00	29,620,500	
北陸電力	17,300	667.00	11,539,100	
東北電力	44,300	954.00	42,262,200	
四国電力	15,700	790.00	12,403,000	
九州電力	41,700	898.00	37,446,600	
北海道電力	17,700	517.00	9,150,900	
沖縄電力	3,700	1,437.00	5,316,900	
電源開発	15,000	1,656.00	24,840,000	
エフオン	1,100	991.00	1,090,100	
イーレックス	2,800	1,942.00	5,437,600	
レノバ	3,200	3,390.00	10,848,000	
東京瓦斯	36,300	2,323.50	84,343,050	
大阪瓦斯	34,200	2,218.00	75,855,600	
東邦瓦斯	9,300	6,600.00	61,380,000	
北海道瓦斯	1,000	1,561.00	1,561,000	
広島ガス	3,900	375.00	1,462,500	
西部ガスホールディングス	2,100	2,529.00	5,310,900	
静岡ガス	5,400	1,036.00	5,594,400	
メタウォーター	2,100	1,888.00	3,964,800	
SBSホールディングス	1,400	2,900.00	4,060,000	
東武鉄道	19,700	2,887.00	56,873,900	
相鉄ホールディングス	6,500	2,136.00	13,884,000	
東急	47,700	1,457.00	69,498,900	
京浜急行電鉄	24,300	1,432.00	34,797,600	
小田急電鉄	30,300	2,920.00	88,476,000	
京王電鉄	10,600	7,010.00	74,306,000	
京成電鉄	14,200	3,205.00	45,511,000	
富士急行	2,600	5,060.00	13,156,000	

新京成電鉄	500	2,135.00	1,067,500	
東日本旅客鉄道	33,300	7,543.00	251,181,900	
西日本旅客鉄道	16,800	6,091.00	102,328,800	
東海旅客鉄道	15,700	15,855.00	248,923,500	
西武ホールディングス	22,800	1,165.00	26,562,000	
鴻池運輸	3,000	1,139.00	3,417,000	
西日本鉄道	5,200	2,691.00	13,993,200	
ハマキョウレックス	1,500	3,115.00	4,672,500	
サカイ引越センター	900	5,540.00	4,986,000	
近鉄グループホールディングス	17,900	3,950.00	70,705,000	
阪急阪神ホールディングス	23,900	3,430.00	81,977,000	
南海電気鉄道	8,500	2,361.00	20,068,500	
京阪ホールディングス	8,000	3,415.00	27,320,000	
神戸電鉄	400	3,545.00	1,418,000	
名古屋鉄道	14,700	2,093.00	30,767,100	
山陽電気鉄道	1,300	1,879.00	2,442,700	
アルプス物流	1,200	918.00	1,101,600	
日本通運	6,200	8,640.00	53,568,000	
ヤマトホールディングス	25,100	2,988.00	74,998,800	
山九	4,600	4,835.00	22,241,000	
丸運	1,000	260.00	260,000	
丸全昭和運輸	1,500	3,320.00	4,980,000	
センコーグループホールディングス	9,900	1,018.00	10,078,200	
トナミホールディングス	400	5,100.00	2,040,000	
ニッコンホールディングス	6,000	2,384.00	14,304,000	
日本石油輸送	200	2,605.00	521,000	
福山通運	2,300	4,310.00	9,913,000	
セイノーホールディングス	13,400	1,551.00	20,783,400	
エスライン	500	902.00	451,000	
神奈川中央交通	400	3,665.00	1,466,000	
日立物流	3,900	3,445.00	13,435,500	
丸和運輸機関	3,800	1,592.00	6,049,600	
C & F ロジホールディングス	1,800	1,634.00	2,941,200	
九州旅客鉄道	13,800	2,484.00	34,279,200	
S Gホールディングス	33,800	2,416.00	81,660,800	
日本郵船	15,000	4,275.00	64,125,000	

商船三井	10,600	4,315.00	45,739,000
川崎汽船	5,500	2,702.00	14,861,000
N S ユナイテッド海運	800	2,184.00	1,747,200
明治海運	1,900	437.00	830,300
飯野海運	8,300	470.00	3,901,000
共栄タンカー	300	851.00	255,300
乾汽船	1,200	1,162.00	1,394,400
日本航空	43,600	2,268.00	98,884,800
A N A ホールディングス	48,300	2,486.00	120,073,800
パスコ	300	1,381.00	414,300
トランコム	500	8,680.00	4,340,000
日新	1,400	1,450.00	2,030,000
三菱倉庫	6,200	3,340.00	20,708,000
三井倉庫ホールディングス	1,900	2,433.00	4,622,700
住友倉庫	6,300	1,511.00	9,519,300
澁澤倉庫	1,000	2,120.00	2,120,000
東陽倉庫	3,000	320.00	960,000
日本トランスシティ	3,900	525.00	2,047,500
ケイヒン	300	1,395.00	418,500
中央倉庫	1,100	1,089.00	1,197,900
川西倉庫	300	1,147.00	344,100
安田倉庫	1,500	940.00	1,410,000
ファイズホールディングス	300	831.00	249,300
東洋埠頭	500	1,496.00	748,000
宇徳	1,300	498.00	647,400
上組	9,800	2,194.00	21,501,200
サンリツ	500	722.00	361,000
キムラユニティー	500	1,266.00	633,000
キューソー流通システム	400	1,621.00	648,400
近鉄エクスプレス	3,400	2,658.00	9,037,200
東海運	1,000	310.00	310,000
エーアイティー	1,100	999.00	1,098,900
内外トランスライン	600	1,784.00	1,070,400
日本コンセプト	600	1,622.00	973,200
N E C ネットズエスアイ	6,100	1,760.00	10,736,000
クロスキャット	500	1,001.00	500,500



システナ	6,600	1,864.00	12,302,400	
デジタルアーツ	1,100	8,240.00	9,064,000	
日鉄ソリューションズ	2,700	3,070.00	8,289,000	
キューブシステム	1,000	1,020.00	1,020,000	
エイジア	300	2,160.00	648,000	
コア	800	1,425.00	1,140,000	
ラクーンホールディングス	1,300	2,871.00	3,732,300	
ソリトンシステムズ	900	1,718.00	1,546,200	
ソフトクリエイティブホールディングス	700	2,281.00	1,596,700	
T I S	18,500	2,555.00	47,267,500	
J N S ホールディングス	900	517.00	465,300	
電算システム	700	3,120.00	2,184,000	
グリー	11,400	567.00	6,463,800	
G M O ペパボ	200	5,200.00	1,040,000	
コーエーテクモホールディングス	4,900	4,700.00	23,030,000	
三菱総合研究所	800	4,010.00	3,208,000	
ボルテージ	500	509.00	254,500	
電算	200	2,347.00	469,400	
A G S	900	815.00	733,500	
ファインデックス	1,600	1,081.00	1,729,600	
ブレインパッド	500	5,040.00	2,520,000	
K L a b	3,400	667.00	2,267,800	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,500	1,039.00	2,597,500	
イーブクイニシアティブジャパン	300	2,430.00	729,000	
ネクソン	46,900	2,673.00	125,363,700	
アイスタイル	5,700	482.00	2,747,400	
エムアップホールディングス	500	2,458.00	1,229,000	
エイチーム	1,300	1,611.00	2,094,300	
エニグモ	1,800	1,209.00	2,176,200	
テクノスジャパン	1,400	590.00	826,000	
e n i s h	1,000	491.00	491,000	
コロブラ	6,100	776.00	4,733,600	
オルトプラス	1,400	445.00	623,000	
ブロードリーフ	9,200	529.00	4,866,800	
クロス・マーケティンググループ	800	606.00	484,800	

デジタルハーツホールディングス	800	1,445.00	1,156,000	
システム情報	1,400	907.00	1,269,800	
メディアドゥ	700	4,995.00	3,496,500	
じげん	4,600	392.00	1,803,200	
ブイキューブ	1,000	2,632.00	2,632,000	
エンカレッジ・テクノロジー	300	617.00	185,100	
サイバーリンクス	600	1,441.00	864,600	
ディー・エル・イー	1,500	284.00	426,000	
フィックスターズ	2,000	855.00	1,710,000	
CARTA HOLDINGS	700	1,598.00	1,118,600	
オブティム	1,300	2,341.00	3,043,300	
セレス	600	3,525.00	2,115,000	
SHIFT	900	14,070.00	12,663,000	
ティーガイア	2,000	1,922.00	3,844,000	
セック	300	2,669.00	800,700	
日本アジアグループ	1,800	933.00	1,679,400	
テクマトリックス	2,900	1,844.00	5,347,600	
プロシップ	500	1,330.00	665,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	4,500	2,036.00	9,162,000	
GMOペイメントゲートウェイ	3,500	12,350.00	43,225,000	
ザッパラス	700	486.00	340,200	
システムリサーチ	500	2,075.00	1,037,500	
インターネットイニシアティブ	4,900	2,606.00	12,769,400	
さくらインターネット	2,000	603.00	1,206,000	
ヴィンクス	500	917.00	458,500	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	4,910.00	1,964,000	
SRAホールディングス	1,000	2,546.00	2,546,000	
システムインテグレータ	500	617.00	308,500	
朝日ネット	1,500	696.00	1,044,000	
eBASE	2,200	913.00	2,008,600	
アバント	2,000	1,442.00	2,884,000	
アドソル日進	700	2,433.00	1,703,100	
ODKソリューションズ	400	820.00	328,000	
フリービット	1,100	871.00	958,100	
コムチュア	1,700	2,315.00	3,935,500	
サイバーコム	300	1,485.00	445,500	

アステリア	1,300	738.00	959,400
アイル	1,000	1,529.00	1,529,000
マークラインズ	800	2,787.00	2,229,600
メディカル・データ・ビジョン	2,100	1,906.00	4,002,600
g u m i	2,600	1,126.00	2,927,600
ショーケース	400	692.00	276,800
モバイルファクトリー	400	1,273.00	509,200
テラスカイ	600	2,523.00	1,513,800
デジタル・インフォメーション・テクノロ ジー	800	1,949.00	1,559,200
P C Iホールディングス	700	1,424.00	996,800
パイプドHD	400	1,491.00	596,400
アイビーシー	300	982.00	294,600
ネオジャパン	300	1,640.00	492,000
P R T I M E S	400	2,943.00	1,177,200
ラクス	5,600	2,016.00	11,289,600
ランドコンピュータ	300	1,029.00	308,700
ダブルスタンダード	200	4,325.00	865,000
オープンドア	1,100	2,018.00	2,219,800
マイネット	600	850.00	510,000
アカツキ	700	3,625.00	2,537,500
ベネフィットジャパン	100	1,914.00	191,400
U b i c o mホールディングス	500	2,953.00	1,476,500
カナミックネットワーク	2,000	592.00	1,184,000
ノムラシステムコーポレーション	800	291.00	232,800
チェンジ	3,400	2,982.00	10,138,800
シンクロ・フード	1,100	372.00	409,200
オークネット	1,000	1,366.00	1,366,000
キャピタル・アセット・プランニング	400	1,108.00	443,200
セグエグループ	500	1,188.00	594,000
エイトレッド	400	2,294.00	917,600
A O I T Y O H o l d i n g s	1,900	710.00	1,349,000
マクロミル	3,800	845.00	3,211,000
ビーグリー	400	1,381.00	552,400
オロ	600	3,350.00	2,010,000
ユーザーローカル	300	4,120.00	1,236,000

テモナ	400	833.00	333,200
ニーズウェル	400	604.00	241,600
サインポスト	400	829.00	331,600
ソルクシーズ	700	921.00	644,700
フェイス	600	823.00	493,800
プロトコーポレーション	2,200	1,181.00	2,598,200
ハイマックス	500	995.00	497,500
野村総合研究所	32,200	3,180.00	102,396,000
サイバネットシステム	1,300	814.00	1,058,200
C Eホールディングス	1,000	513.00	513,000
日本システム技術	300	1,500.00	450,000
インテージホールディングス	2,300	1,416.00	3,256,800
東邦システムサイエンス	500	928.00	464,000
ソースネクスト	8,800	294.00	2,587,200
インフォコム	1,700	2,740.00	4,658,000
HEROZ	500	2,498.00	1,249,000
ラクスル	2,000	4,630.00	9,260,000
I P S	400	2,580.00	1,032,000
F I G	2,000	281.00	562,000
システムサポート	500	1,339.00	669,500
イーソル	1,000	1,175.00	1,175,000
アルテリア・ネットワークス	2,100	1,583.00	3,324,300
E d u L a b	200	5,560.00	1,112,000
東海ソフト	300	1,319.00	395,700
ウイングアーク1 s t	1,000	2,182.00	2,182,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,972.00	788,800
サーバーワークス	200	3,900.00	780,000
東名	200	1,063.00	212,600
ヴィッツ	200	1,894.00	378,800
トピラシステムズ	200	1,240.00	248,000
S a n s a n	1,600	7,750.00	12,400,000
L i n k - U	300	1,012.00	303,600
ギフトィ	1,100	3,490.00	3,839,000
ベース	200	5,100.00	1,020,000
フォーカスシステムズ	1,200	868.00	1,041,600

クレスコ	1,200	1,618.00	1,941,600	
フジ・メディア・ホールディングス	19,200	1,219.00	23,404,800	
オービック	5,800	20,270.00	117,566,000	
ジャストシステム	2,600	5,710.00	14,846,000	
TDCソフト	1,600	1,037.00	1,659,200	
Zホールディングス	254,800	470.90	119,985,320	
トレンドマイクロ	9,900	5,340.00	52,866,000	
IDホールディングス	700	1,318.00	922,600	
日本オラクル	3,800	10,250.00	38,950,000	
アルファシステムズ	500	3,600.00	1,800,000	
フューチャー	2,200	1,869.00	4,111,800	
CAC Holdings	1,200	1,408.00	1,689,600	
SBテクノロジー	700	2,889.00	2,022,300	
トーセ	500	802.00	401,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,900	6,110.00	11,609,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	8,400	3,485.00	29,274,000	
アイティフォー	2,400	754.00	1,809,600	
東計電算	300	4,470.00	1,341,000	
エクスネット	300	1,006.00	301,800	
大塚商会	10,000	5,760.00	57,600,000	
サイボウズ	2,200	2,229.00	4,903,800	
電通国際情報サービス	2,300	3,705.00	8,521,500	
ACCESS	2,300	883.00	2,030,900	
デジタルガレージ	3,100	4,315.00	13,376,500	
EMシステムズ	3,100	834.00	2,585,400	
ウェザーニューズ	600	5,220.00	3,132,000	
CIJ	1,300	827.00	1,075,100	
ビジネスエンジニアリング	200	3,275.00	655,000	
日本エンタープライズ	1,800	213.00	383,400	
WOWOW	900	2,445.00	2,200,500	
スカラ	1,700	707.00	1,201,900	
インテリジェント ウェイブ	1,100	654.00	719,400	
IMAGICA GROUP	1,600	487.00	779,200	
ネットワンシステムズ	7,600	3,350.00	25,460,000	
システムソフト	3,800	158.00	600,400	
アルゴグラフィックス	1,400	2,991.00	4,187,400	

マーベラス	2,900	785.00	2,276,500
エイベックス	3,200	1,459.00	4,668,800
日本ユニシス	6,400	3,120.00	19,968,000
兼松エレクトロニクス	1,000	3,675.00	3,675,000
都築電気	800	1,817.00	1,453,600
TBSホールディングス	12,300	1,866.00	22,951,800
日本テレビホールディングス	15,500	1,285.00	19,917,500
朝日放送グループホールディングス	1,800	704.00	1,267,200
テレビ朝日ホールディングス	5,700	1,869.00	10,653,300
スカパーJ S A Tホールディングス	12,200	433.00	5,282,600
テレビ東京ホールディングス	1,300	2,165.00	2,814,500
日本BS放送	600	1,088.00	652,800
ビジョン	2,300	985.00	2,265,500
スマートパリュー	500	831.00	415,500
USEN-NEXT HOLDINGS	1,800	1,959.00	3,526,200
ワイヤレスゲート	800	400.00	320,000
コネクシオ	1,100	1,450.00	1,595,000
日本通信	16,300	215.00	3,504,500
クロップス	300	890.00	267,000
日本電信電話	216,900	2,851.00	618,381,900
KDDI	148,700	3,532.00	525,208,400
ソフトバンク	168,500	1,428.50	240,702,250
光通信	2,200	21,850.00	48,070,000
エムティーアイ	1,800	674.00	1,213,200
GMOインターネット	6,600	2,902.00	19,153,200
ファイバーゲート	600	1,183.00	709,800
アйдママーケティングコミュニケーション	500	403.00	201,500
KADOKAWA	4,800	3,650.00	17,520,000
学研ホールディングス	2,600	1,354.00	3,520,400
ゼンリン	3,400	1,115.00	3,791,000
昭文社ホールディングス	700	463.00	324,100
インプレスホールディングス	1,500	210.00	315,000
アイネット	1,000	1,439.00	1,439,000
松竹	1,200	12,450.00	14,940,000
東宝	10,900	4,280.00	46,652,000
東映	600	23,510.00	14,106,000

エヌ・ティ・ティ・データ	49,400	1,656.00	81,806,400	
ピー・シー・エー	300	4,115.00	1,234,500	
ビジネスブレイン太田昭和	600	1,720.00	1,032,000	
D T S	3,800	2,545.00	9,671,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,900	5,650.00	44,635,000	
シーイーシー	2,000	1,335.00	2,670,000	
カブコン	15,900	3,335.00	53,026,500	
アイ・エス・ピー	900	1,300.00	1,170,000	
ジャステック	1,200	1,269.00	1,522,800	
S C S K	4,300	5,840.00	25,112,000	
日本システムウエア	600	2,267.00	1,360,200	
アイネス	1,800	1,330.00	2,394,000	
T K C	3,100	3,455.00	10,710,500	
富士ソフト	2,000	5,350.00	10,700,000	
N S D	6,000	1,778.00	10,668,000	
コナミホールディングス	6,700	6,240.00	41,808,000	
福井コンピュータホールディングス	900	4,070.00	3,663,000	
J B C Cホールディングス	1,300	1,340.00	1,742,000	
ミロク情報サービス	1,800	1,630.00	2,934,000	
ソフトバンクグループ	147,100	8,431.00	1,240,200,100	
ハウスイ	100	952.00	95,200	
高千穂交易	700	1,131.00	791,700	
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,707.00	512,100	
伊藤忠食品	400	5,100.00	2,040,000	
エレマテック	1,500	1,207.00	1,810,500	
J A L U X	500	1,598.00	799,000	
あらた	1,500	4,220.00	6,330,000	
トーメンデバイス	200	3,955.00	791,000	
東京エレクトロン デバイス	600	5,990.00	3,594,000	
フィールズ	1,600	445.00	712,000	
双日	102,800	330.00	33,924,000	
アルフレッサ ホールディングス	19,300	1,738.00	33,543,400	
横浜冷凍	5,200	893.00	4,643,600	
神栄	300	1,201.00	360,300	
ラサ商事	1,000	897.00	897,000	
アルコニックス	2,000	1,587.00	3,174,000	

神戸物産	12,800	2,843.00	36,390,400
ハイパー	400	536.00	214,400
あい ホールディングス	2,700	2,193.00	5,921,100
ディーブイエックス	600	978.00	586,800
ダイワボウホールディングス	8,500	1,760.00	14,960,000
マクニカ・富士エレホールディングス	4,400	2,418.00	10,639,200
ラクト・ジャパン	800	2,832.00	2,265,600
グリムス	600	1,881.00	1,128,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,200	701.00	2,243,200
八洲電機	1,400	961.00	1,345,400
メディアスホールディングス	1,100	942.00	1,036,200
レスターホールディングス	1,900	1,813.00	3,444,700
ジューテックホールディングス	400	1,003.00	401,200
大光	700	700.00	490,000
OCHIホールディングス	500	1,257.00	628,500
TOKAIホールディングス	9,000	902.00	8,118,000
黒谷	500	932.00	466,000
Cominix	300	718.00	215,400
三洋貿易	1,900	1,222.00	2,321,800
ピューティガレージ	300	3,390.00	1,017,000
ウイン・パートナーズ	1,300	1,001.00	1,301,300
ミタチ産業	500	657.00	328,500
シップヘルスケアホールディングス	6,600	2,708.00	17,872,800
明治電機工業	600	1,379.00	827,400
デリカフーズホールディングス	700	623.00	436,100
スターティアホールディングス	400	1,052.00	420,800
コメダホールディングス	4,100	2,042.00	8,372,200
ピーバンドットコム	300	831.00	249,300
アセンテック	500	1,267.00	633,500
富士興産	600	1,273.00	763,800
協栄産業	200	1,370.00	274,000
小野建	1,700	1,332.00	2,264,400
南陽	400	1,785.00	714,000
佐島電機	1,200	775.00	930,000
エコートレーディング	400	601.00	240,400
伯東	1,100	1,518.00	1,669,800



コンドーテック	1,400	1,012.00	1,416,800	
中山福	1,100	455.00	500,500	
ナガイレーベン	2,500	2,581.00	6,452,500	
三菱食品	2,000	2,945.00	5,890,000	
松田産業	1,400	2,417.00	3,383,800	
第一興商	3,700	4,235.00	15,669,500	
メディバルホールディングス	18,700	2,079.00	38,877,300	
S P K	800	1,341.00	1,072,800	
萩原電気ホールディングス	700	2,437.00	1,705,900	
アズワン	1,300	12,490.00	16,237,000	
スズデン	600	1,395.00	837,000	
尾家産業	500	1,198.00	599,000	
シモジマ	1,100	1,138.00	1,251,800	
ドウシシャ	1,800	1,739.00	3,130,200	
小津産業	400	2,113.00	845,200	
高速	1,000	1,458.00	1,458,000	
たけびし	700	1,458.00	1,020,600	
リックス	400	1,513.00	605,200	
丸文	1,600	558.00	892,800	
ハビネット	1,600	1,486.00	2,377,600	
橋本総業ホールディングス	400	2,679.00	1,071,600	
日本ライフライン	6,000	1,461.00	8,766,000	
タカショー	1,200	744.00	892,800	
マルカ	600	2,146.00	1,287,600	
I D O M	6,300	590.00	3,717,000	
進和	1,100	2,062.00	2,268,200	
エスケイジャパン	400	434.00	173,600	
ダイトロン	800	1,954.00	1,563,200	
シークス	2,400	1,446.00	3,470,400	
田中商事	600	676.00	405,600	
オーハシテクニカ	1,000	1,462.00	1,462,000	
白銅	700	1,811.00	1,267,700	
ダイコー通産	200	1,655.00	331,000	
伊藤忠商事	130,200	3,293.00	428,748,600	
丸紅	183,600	922.00	169,279,200	
高島	300	1,726.00	517,800	

長瀬産業	10,200	1,637.00	16,697,400
蝶理	1,200	1,662.00	1,994,400
豊田通商	18,700	4,880.00	91,256,000
三共生興	2,800	503.00	1,408,400
兼松	7,400	1,439.00	10,648,600
ツカモトコーポレーション	300	1,336.00	400,800
三井物産	151,100	2,396.50	362,111,150
日本紙パルプ商事	1,000	3,585.00	3,585,000
カメイ	2,400	1,153.00	2,767,200
東都水産	200	4,395.00	879,000
OUGホールディングス	300	2,761.00	828,300
スターゼン	1,400	2,166.00	3,032,400
山善	7,300	982.00	7,168,600
椿本興業	300	3,445.00	1,033,500
住友商事	117,500	1,507.00	177,072,500
内田洋行	800	4,785.00	3,828,000
三菱商事	113,300	2,933.50	332,365,550
第一実業	800	4,400.00	3,520,000
キヤノンマーケティングジャパン	4,600	2,598.00	11,950,800
西華産業	1,000	1,731.00	1,731,000
佐藤商事	1,500	1,117.00	1,675,500
菱洋エレクトロ	1,400	2,616.00	3,662,400
東京産業	1,700	602.00	1,023,400
ユアサ商事	1,900	3,000.00	5,700,000
神鋼商事	400	2,467.00	986,800
トルク	1,100	242.00	266,200
阪和興業	3,700	3,255.00	12,043,500
正栄食品工業	1,200	4,020.00	4,824,000
カナデン	1,500	1,123.00	1,684,500
菱電商事	1,300	1,611.00	2,094,300
フルサト工業	900	1,640.00	1,476,000
岩谷産業	4,500	6,810.00	30,645,000
ナイス	700	1,885.00	1,319,500
昭光通商	500	792.00	396,000
ニチモウ	300	2,087.00	626,100
極東貿易	500	2,025.00	1,012,500

イワキ	2,500	689.00	1,722,500
三愛石油	4,600	1,168.00	5,372,800
稲畑産業	4,500	1,684.00	7,578,000
G S Iクレオス	900	958.00	862,200
明和産業	1,700	471.00	800,700
クワザワホールディングス	700	576.00	403,200
ヤマエ久野	1,400	1,075.00	1,505,000
ワキタ	3,700	1,129.00	4,177,300
東邦ホールディングス	6,000	1,782.00	10,692,000
サンゲツ	5,000	1,557.00	7,785,000
ミツウロコグループホールディングス	2,700	1,267.00	3,420,900
シナネンホールディングス	700	2,870.00	2,009,000
伊藤忠エネクス	4,100	1,070.00	4,387,000
サンリオ	5,200	1,708.00	8,881,600
サンワテクノス	1,200	1,219.00	1,462,800
リョーサン	2,100	2,014.00	4,229,400
新光商事	2,500	740.00	1,850,000
トーホー	800	1,690.00	1,352,000
三信電気	1,000	2,126.00	2,126,000
東陽テクニカ	1,900	1,083.00	2,057,700
モスフードサービス	2,600	3,165.00	8,229,000
加賀電子	1,700	2,683.00	4,561,100
ソーダニッカ	1,800	605.00	1,089,000
立花エレテック	1,400	1,475.00	2,065,000
フォーバル	700	820.00	574,000
P A L T A C	3,000	5,660.00	16,980,000
三谷産業	2,400	389.00	933,600
太平洋興発	700	659.00	461,300
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	2,820.00	1,128,000
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	2,168.00	433,600
コア商事ホールディングス	1,400	692.00	968,800
国際紙バルブ商事	3,900	248.00	967,200
ヤマタネ	800	1,489.00	1,191,200
丸紅建材リース	200	1,790.00	358,000
日鉄物産	1,300	4,290.00	5,577,000
泉州電業	500	3,240.00	1,620,000

トラスコ中山	4,300	2,874.00	12,358,200	
オートバックスセブン	6,900	1,521.00	10,494,900	
モリト	1,400	618.00	865,200	
加藤産業	2,700	3,270.00	8,829,000	
北恵	500	873.00	436,500	
イノテック	1,000	1,304.00	1,304,000	
イエローハット	3,500	2,006.00	7,021,000	
J Kホールディングス	1,700	809.00	1,375,300	
日伝	1,500	2,053.00	3,079,500	
北沢産業	1,200	252.00	302,400	
杉本商事	900	2,219.00	1,997,100	
因幡電機産業	5,000	2,520.00	12,600,000	
東テク	600	2,718.00	1,630,800	
ミスミグループ本社	23,300	3,455.00	80,501,500	
アルテック	1,300	306.00	397,800	
タキヒヨー	600	1,844.00	1,106,400	
蔵王産業	400	1,426.00	570,400	
スズケン	7,900	3,570.00	28,203,000	
ジェコス	1,300	886.00	1,151,800	
グローセル	2,000	411.00	822,000	
ローソン	4,700	4,915.00	23,100,500	
サンエー	1,400	4,285.00	5,999,000	
カワチ薬品	1,300	2,317.00	3,012,100	
エービーシー・マート	2,900	5,930.00	17,197,000	
ハードオフコーポレーション	800	772.00	617,600	
アスクル	1,600	3,650.00	5,840,000	
ゲオホールディングス	2,500	1,171.00	2,927,500	
アダストリア	2,600	1,808.00	4,700,800	
ジーフット	1,100	407.00	447,700	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	397.00	119,100	
くら寿司	2,200	3,915.00	8,613,000	
キャンドウ	900	2,106.00	1,895,400	
アイケイ	500	762.00	381,000	
パルグループホールディングス	1,600	1,561.00	2,497,600	
エディオン	7,900	1,131.00	8,934,900	
サーラコーポレーション	3,800	610.00	2,318,000	

ワッツ	900	900.00	810,000
ハローズ	700	2,900.00	2,030,000
フジオフードグループ本社	1,600	1,397.00	2,235,200
あみやき亭	400	2,819.00	1,127,600
ひらまつ	3,300	160.00	528,000
大黒天物産	600	8,540.00	5,124,000
ハニーズホールディングス	1,500	1,040.00	1,560,000
ファーマライズホールディングス	500	781.00	390,500
アルペン	1,400	2,508.00	3,511,200
ハブ	600	636.00	381,600
クオールホールディングス	2,500	1,480.00	3,700,000
ジンスホールディングス	1,300	7,710.00	10,023,000
ビックカメラ	11,000	1,125.00	12,375,000
D C Mホールディングス	11,500	1,043.00	11,994,500
ペッパーフードサービス	2,500	283.00	707,500
MonotaRO	26,500	2,389.00	63,308,500
東京一番フーズ	500	576.00	288,000
D Dホールディングス	900	522.00	469,800
きちりホールディングス	500	577.00	288,500
アークランドサービスホールディングス	1,600	2,177.00	3,483,200
J . フロント リテイリング	22,200	1,038.00	23,043,600
ドトール・日レスホールディングス	2,900	1,602.00	4,645,800
マツモトキヨシホールディングス	7,700	4,250.00	32,725,000
ブロンコピリー	1,000	2,355.00	2,355,000
Z O Z O	11,000	3,470.00	38,170,000
トレジャー・ファクトリー	500	1,129.00	564,500
物語コーポレーション	1,000	6,390.00	6,390,000
ココカラファイン	1,700	7,200.00	12,240,000
三越伊勢丹ホールディングス	32,600	769.00	25,069,400
H a m e e	500	1,465.00	732,500
マーケットエンタープライズ	100	1,129.00	112,900
ウエルシアホールディングス	9,800	3,390.00	33,222,000
クリエイトSDホールディングス	2,700	3,345.00	9,031,500
丸善C H Iホールディングス	2,200	394.00	866,800
ミサワ	400	687.00	274,800
ティーライフ	300	1,347.00	404,100

エー・ピーホールディングス	300	425.00	127,500	
チムニー	600	1,296.00	777,600	
シュッピン	1,300	934.00	1,214,200	
オイシックス・ラ・大地	2,500	3,270.00	8,175,000	
ネクステージ	3,300	1,640.00	5,412,000	
ジョイフル本田	5,500	1,350.00	7,425,000	
鳥貴族ホールディングス	700	1,666.00	1,166,200	
ホットランド	1,400	1,352.00	1,892,800	
すかいらくホールディングス	20,900	1,618.00	33,816,200	
SFPホールディングス	900	1,289.00	1,160,100	
綿半ホールディングス	1,400	1,256.00	1,758,400	
ヨシックス	400	1,921.00	768,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,400	1,109.00	5,988,600	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	1,344.00	1,344,000	
B E E N O S	900	3,090.00	2,781,000	
あさひ	1,400	1,443.00	2,020,200	
日本調剤	1,100	1,752.00	1,927,200	
コスモス薬品	1,900	15,260.00	28,994,000	
トーエル	900	783.00	704,700	
オンリー	300	442.00	132,600	
セブン&アイ・ホールディングス	72,800	4,790.00	348,712,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	10,000	787.00	7,870,000	
ツルハホールディングス	4,100	12,870.00	52,767,000	
サンマルクホールディングス	1,500	1,606.00	2,409,000	
フェリシモ	400	1,343.00	537,200	
トリドールホールディングス	4,600	1,650.00	7,590,000	
T O K Y O B A S E	1,700	684.00	1,162,800	
ウイルプラスホールディングス	300	1,200.00	360,000	
J Mホールディングス	1,400	2,081.00	2,913,400	
サツドラホールディングス	300	2,141.00	642,300	
アレンザホールディングス	1,400	1,209.00	1,692,600	
串カツ田中ホールディングス	500	1,682.00	841,000	
パロックジャパンリミテッド	1,300	754.00	980,200	
クスリのアオキホールディングス	1,900	7,760.00	14,744,000	
力の源ホールディングス	800	601.00	480,800	

FOOD & LIFE COMPANIES	10,900	4,640.00	50,576,000	
メディカルシステムネットワーク	1,600	695.00	1,112,000	
はるやまホールディングス	900	645.00	580,500	
ノジマ	3,300	3,240.00	10,692,000	
カッパ・クリエイト	2,600	1,468.00	3,816,800	
ライトオン	1,400	684.00	957,600	
良品計画	21,400	2,204.00	47,165,600	
三城ホールディングス	2,300	270.00	621,000	
アドヴァン	1,900	968.00	1,839,200	
アルビス	600	2,300.00	1,380,000	
コナカ	2,200	336.00	739,200	
ハウス オブ ローゼ	200	1,643.00	328,600	
G - 7ホールディングス	1,100	3,005.00	3,305,500	
イオン北海道	2,500	1,062.00	2,655,000	
コジマ	3,200	871.00	2,787,200	
ヒマラヤ	700	987.00	690,900	
コーナン商事	2,600	3,045.00	7,917,000	
エコス	700	1,837.00	1,285,900	
ワタミ	2,400	937.00	2,248,800	
マルシェ	500	482.00	241,000	
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	37,200	2,157.00	80,240,400	
西松屋チェーン	4,100	1,721.00	7,056,100	
ゼンショーホールディングス	10,000	2,840.00	28,400,000	
幸楽苑ホールディングス	1,200	1,559.00	1,870,800	
ハークスレイ	400	901.00	360,400	
サイゼリヤ	2,800	2,408.00	6,742,400	
V Tホールディングス	7,000	421.00	2,947,000	
魚力	600	1,902.00	1,141,200	
ポブラ	500	297.00	148,500	
フジ・コーポレーション	1,000	1,247.00	1,247,000	
ユナイテッドアローズ	2,100	1,822.00	3,826,200	
ハイデイ日高	2,700	1,732.00	4,676,400	
京都きもの友禅	1,200	261.00	313,200	
コロワイド	6,200	1,865.00	11,563,000	
ピーシーデポコーポレーション	2,200	444.00	976,800	

壱番屋	1,300	4,790.00	6,227,000	
トップカルチャー	700	338.00	236,600	
P L A N T	500	721.00	360,500	
スギホールディングス	3,700	8,610.00	31,857,000	
薬王堂ホールディングス	800	2,347.00	1,877,600	
ヴィア・ホールディングス	2,200	201.00	442,200	
スクロール	2,700	949.00	2,562,300	
ヨンドシーホールディングス	1,700	1,876.00	3,189,200	
木曽路	2,400	2,318.00	5,563,200	
S R Sホールディングス	2,400	818.00	1,963,200	
千趣会	3,400	390.00	1,326,000	
タカキュー	1,300	137.00	178,100	
リテールパートナーズ	2,300	1,158.00	2,663,400	
ケーヨー	3,400	706.00	2,400,400	
上新電機	2,100	2,661.00	5,588,100	
日本瓦斯	9,200	1,963.00	18,059,600	
ロイヤルホールディングス	3,200	2,023.00	6,473,600	
東天紅	100	999.00	99,900	
いなげや	2,100	1,561.00	3,278,100	
チヨダ	2,000	868.00	1,736,000	
ライフコーポレーション	1,900	3,475.00	6,602,500	
リンガーハット	2,300	2,219.00	5,103,700	
MrMaxHD	2,600	625.00	1,625,000	
テンアライド	1,700	325.00	552,500	
AOKIホールディングス	3,700	636.00	2,353,200	
オークワ	2,900	1,142.00	3,311,800	
コメリ	2,900	2,767.00	8,024,300	
青山商事	4,100	925.00	3,792,500	
しまむら	2,200	10,570.00	23,254,000	
はせがわ	1,000	276.00	276,000	
高島屋	13,600	1,210.00	16,456,000	
松屋	4,100	935.00	3,833,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,800	855.00	7,524,000	
近鉄百貨店	700	3,110.00	2,177,000	
丸井グループ	15,700	1,995.00	31,321,500	
アクシアル リテイリング	1,500	4,110.00	6,165,000	



井筒屋	900	242.00	217,800	
イオン	71,600	2,998.00	214,656,800	
イズミ	3,800	4,200.00	15,960,000	
平和堂	3,400	2,292.00	7,792,800	
フジ	2,200	2,086.00	4,589,200	
ヤオコー	2,100	6,770.00	14,217,000	
ゼビオホールディングス	2,200	945.00	2,079,000	
ケーズホールディングス	15,800	1,391.00	21,977,800	
Olympicグループ	1,000	771.00	771,000	
日産東京販売ホールディングス	2,700	235.00	634,500	
シルバーライフ	400	2,513.00	1,005,200	
一家ダイニングプロジェクト	400	555.00	222,000	
Genky DrugStores	800	3,315.00	2,652,000	
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,164.00	465,600	
ブックオフグループホールディングス	1,100	1,006.00	1,106,600	
ギフト	200	2,185.00	437,000	
アインホールディングス	2,700	6,590.00	17,793,000	
元気寿司	500	2,528.00	1,264,000	
ヤマダホールディングス	62,400	553.00	34,507,200	
アークランドサカモト	2,900	1,472.00	4,268,800	
ニトリホールディングス	7,400	19,315.00	142,931,000	
グルメ杵屋	1,300	950.00	1,235,000	
愛眼	1,400	223.00	312,200	
ケーユーホールディングス	1,000	930.00	930,000	
吉野家ホールディングス	6,100	2,087.00	12,730,700	
松屋フーズホールディングス	900	3,435.00	3,091,500	
サガミホールディングス	2,600	1,016.00	2,641,600	
関西スーパーマーケット	1,400	1,003.00	1,404,200	
王将フードサービス	1,200	5,690.00	6,828,000	
プレナス	2,100	2,004.00	4,208,400	
ミニストップ	1,400	1,399.00	1,958,600	
アークス	3,600	2,419.00	8,708,400	
パローホールディングス	3,800	2,335.00	8,873,000	
藤久	400	804.00	321,600	
ベルク	900	5,760.00	5,184,000	
大庄	1,000	995.00	995,000	

ファーストリテイリング	2,500	86,090.00	215,225,000	
サンドラッグ	7,000	3,565.00	24,955,000	
サクスパー ホールディングス	1,600	588.00	940,800	
ヤマザワ	400	1,703.00	681,200	
やまや	400	2,280.00	912,000	
ベルーナ	4,000	1,165.00	4,660,000	
島根銀行	600	640.00	384,000	
じもとホールディングス	1,300	688.00	894,400	
めぶきフィナンシャルグループ	96,900	253.00	24,515,700	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,300	1,383.00	3,180,900	
九州フィナンシャルグループ	38,100	422.00	16,078,200	
ゆうちょ銀行	52,800	961.00	50,740,800	
富山第一銀行	4,400	279.00	1,227,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	113,600	423.00	48,052,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	12,200	727.00	8,869,400	
三十三フィナンシャルグループ	1,600	1,306.00	2,089,600	
第四北越フィナンシャルグループ	3,000	2,399.00	7,197,000	
ひろぎんホールディングス	27,500	613.00	16,857,500	
新生銀行	15,200	1,660.00	25,232,000	
あおぞら銀行	11,100	2,521.00	27,983,100	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,275,100	612.50	780,998,750	
りそなホールディングス	214,200	472.30	101,166,660	
三井住友トラスト・ホールディングス	35,200	3,872.00	136,294,400	
三井住友フィナンシャルグループ	129,000	3,958.00	510,582,000	
千葉銀行	62,200	722.00	44,908,400	
群馬銀行	38,400	373.00	14,323,200	
武蔵野銀行	2,800	1,705.00	4,774,000	
千葉興業銀行	4,700	275.00	1,292,500	
筑波銀行	7,700	176.00	1,355,200	
七十七銀行	5,800	1,392.00	8,073,600	
青森銀行	1,400	2,308.00	3,231,200	
秋田銀行	1,100	1,399.00	1,538,900	
山形銀行	2,100	910.00	1,911,000	
岩手銀行	1,200	1,948.00	2,337,600	
東邦銀行	16,600	214.00	3,552,400	
東北銀行	900	1,063.00	956,700	

みちのく銀行	1,200	1,045.00	1,254,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	16,800	2,026.00	34,036,800	
静岡銀行	45,400	909.00	41,268,600	
十六銀行	2,300	2,042.00	4,696,600	
スルガ銀行	16,300	400.00	6,520,000	
八十二銀行	42,000	385.00	16,170,000	
山梨中央銀行	2,200	839.00	1,845,800	
大垣共立銀行	3,700	1,999.00	7,396,300	
福井銀行	1,600	1,654.00	2,646,400	
北國銀行	1,700	2,396.00	4,073,200	
清水銀行	800	1,627.00	1,301,600	
富山銀行	400	2,625.00	1,050,000	
滋賀銀行	3,700	2,149.00	7,951,300	
南都銀行	2,700	1,883.00	5,084,100	
百五銀行	16,800	327.00	5,493,600	
京都銀行	6,700	5,150.00	34,505,000	
紀陽銀行	6,600	1,522.00	10,045,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	12,400	923.00	11,445,200	
山陰合同銀行	11,700	557.00	6,516,900	
中国銀行	16,000	905.00	14,480,000	
鳥取銀行	600	1,133.00	679,800	
伊予銀行	24,700	609.00	15,042,300	
百十四銀行	2,000	1,546.00	3,092,000	
四国銀行	2,600	708.00	1,840,800	
阿波銀行	2,900	2,208.00	6,403,200	
大分銀行	1,100	1,759.00	1,934,900	
宮崎銀行	1,200	2,133.00	2,559,600	
佐賀銀行	1,100	1,382.00	1,520,200	
沖縄銀行	1,700	2,656.00	4,515,200	
琉球銀行	4,000	715.00	2,860,000	
セブン銀行	62,300	238.00	14,827,400	
みずほフィナンシャルグループ	253,300	1,660.00	420,478,000	
高知銀行	700	825.00	577,500	
山口フィナンシャルグループ	23,300	662.00	15,424,600	
長野銀行	600	1,163.00	697,800	
名古屋銀行	1,500	2,800.00	4,200,000	

北洋銀行	28,100	267.00	7,502,700
愛知銀行	600	2,881.00	1,728,600
中京銀行	700	1,614.00	1,129,800
大光銀行	600	1,385.00	831,000
愛媛銀行	2,600	854.00	2,220,400
トマト銀行	700	1,034.00	723,800
京葉銀行	7,900	420.00	3,318,000
栃木銀行	9,000	180.00	1,620,000
北日本銀行	600	1,849.00	1,109,400
東和銀行	3,300	586.00	1,933,800
福島銀行	2,100	229.00	480,900
大東銀行	900	608.00	547,200
トモニホールディングス	14,400	305.00	4,392,000
フィデアホールディングス	18,000	125.00	2,250,000
池田泉州ホールディングス	21,400	170.00	3,638,000
F P G	6,300	710.00	4,473,000
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,300	1,489.00	1,935,700
マーキュリアインベストメント	700	776.00	543,200
S B Iホールディングス	23,000	2,740.00	63,020,000
日本アジア投資	1,500	227.00	340,500
ジャフコ グループ	2,900	7,500.00	21,750,000
大和証券グループ本社	139,600	614.60	85,798,160
野村ホールディングス	284,600	581.60	165,523,360
岡三証券グループ	15,900	446.00	7,091,400
丸三証券	5,500	635.00	3,492,500
東洋証券	6,100	163.00	994,300
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,900	404.00	8,039,600
光世証券	400	675.00	270,000
水戸証券	5,000	295.00	1,475,000
いちよし証券	3,700	609.00	2,253,300
松井証券	9,100	847.00	7,707,700
マネックスグループ	16,700	758.00	12,658,600
極東証券	2,500	798.00	1,995,000
岩井コスモホールディングス	1,900	1,695.00	3,220,500
藍澤証券	3,300	1,022.00	3,372,600
マネーパートナーズグループ	2,000	241.00	482,000

スパークス・グループ	8,600	266.00	2,287,600	
小林洋行	500	272.00	136,000	
かんぽ生命保険	23,100	2,298.00	53,083,800	
S O M P Oホールディングス	32,900	4,351.00	143,147,900	
アニコム ホールディングス	5,200	919.00	4,778,800	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	45,300	3,322.00	150,486,600	
第一生命ホールディングス	98,500	2,043.00	201,235,500	
東京海上ホールディングス	61,400	5,445.00	334,323,000	
T & Dホールディングス	55,700	1,406.00	78,314,200	
アドバンスクリエイト	900	905.00	814,500	
全国保証	4,800	4,575.00	21,960,000	
ジェイリース	600	1,048.00	628,800	
イントラスト	500	676.00	338,000	
日本モーゲージサービス	900	988.00	889,200	
C a s a	500	896.00	448,000	
アルヒ	2,800	1,718.00	4,810,400	
プレミアグループ	900	2,554.00	2,298,600	
クレディセゾン	10,900	1,331.00	14,507,900	
芙蓉総合リース	2,000	7,650.00	15,300,000	
みずほリース	2,900	3,420.00	9,918,000	
東京センチュリー	4,300	6,470.00	27,821,000	
日本証券金融	7,900	842.00	6,651,800	
アイフル	31,300	335.00	10,485,500	
リコーリース	1,500	3,475.00	5,212,500	
イオンフィナンシャルサービス	11,400	1,287.00	14,671,800	
アコム	37,500	455.00	17,062,500	
ジャックス	2,100	2,425.00	5,092,500	
オリエントコーポレーション	50,400	145.00	7,308,000	
オリックス	113,200	1,828.00	206,929,600	
三菱HCキャピタル	64,500	640.00	41,280,000	
九州リースサービス	900	673.00	605,700	
日本取引所グループ	50,400	2,496.50	125,823,600	
イー・ギャランティ	2,100	2,118.00	4,447,800	
アサックス	1,000	692.00	692,000	
N E Cキャピタルソリューション	800	1,963.00	1,570,400	

いちご	20,700	348.00	7,203,600	
日本駐車場開発	20,400	153.00	3,121,200	
スター・マイカ・ホールディングス	1,000	1,023.00	1,023,000	
S R Eホールディングス	300	4,915.00	1,474,500	
A Dワークスグループ	3,700	161.00	595,700	
ヒューリック	39,500	1,197.00	47,281,500	
三栄建築設計	700	1,949.00	1,364,300	
野村不動産ホールディングス	11,300	2,834.00	32,024,200	
三重交通グループホールディングス	3,800	480.00	1,824,000	
サムティ	2,600	2,023.00	5,259,800	
ディア・ライフ	2,500	440.00	1,100,000	
コーセーアールイー	500	612.00	306,000	
日本商業開発	1,200	1,729.00	2,074,800	
プレサンスコーポレーション	3,100	1,702.00	5,276,200	
T H E グローバル社	1,100	242.00	266,200	
ハウスコム	300	1,181.00	354,300	
日本管理センター	1,000	1,263.00	1,263,000	
サンセイランディック	500	872.00	436,000	
エストラスト	200	676.00	135,200	
フージャースホールディングス	3,000	714.00	2,142,000	
オープンハウス	5,900	4,585.00	27,051,500	
東急不動産ホールディングス	50,700	638.00	32,346,600	
飯田グループホールディングス	15,500	2,829.00	43,849,500	
イーランド	300	973.00	291,900	
ムゲンエステート	1,100	486.00	534,600	
ビーロッド	900	641.00	576,900	
ファーストブラザーズ	300	975.00	292,500	
ハウスドゥ	900	997.00	897,300	
シーアールイー	500	1,391.00	695,500	
プロパティエージェント	300	2,439.00	731,700	
ケイアイスター不動産	600	4,335.00	2,601,000	
アグレ都市デザイン	300	992.00	297,600	
グッドコムアセット	900	1,308.00	1,177,200	
ジェイ・エス・ビー	300	3,440.00	1,032,000	
テンポイノベーション	500	866.00	433,000	
グローバル・リンク・マネジメント	300	860.00	258,000	

フェイスネットワーク	200	1,299.00	259,800	
パーク24	10,000	2,143.00	21,430,000	
バラカ	500	1,635.00	817,500	
三井不動産	85,000	2,468.50	209,822,500	
三菱地所	122,500	1,805.50	221,173,750	
平和不動産	3,200	4,150.00	13,280,000	
東京建物	18,400	1,659.00	30,525,600	
ダイビル	4,700	1,272.00	5,978,400	
京阪神ビルディング	3,200	1,362.00	4,358,400	
住友不動産	41,900	3,603.00	150,965,700	
テーオーシー	3,700	732.00	2,708,400	
東京楽天地	300	4,065.00	1,219,500	
レオパレス21	15,400	140.00	2,156,000	
スターツコーポレーション	2,200	2,729.00	6,003,800	
フジ住宅	2,200	621.00	1,366,200	
空港施設	1,900	599.00	1,138,100	
明和地所	900	637.00	573,300	
ゴールドクレスト	1,700	1,676.00	2,849,200	
エスリード	700	1,672.00	1,170,400	
日神グループホールディングス	2,800	478.00	1,338,400	
日本エスコン	3,400	747.00	2,539,800	
タカラレーベン	7,800	351.00	2,737,800	
A V A N T I A	1,000	885.00	885,000	
イオンモール	9,300	1,694.00	15,754,200	
毎日コムネット	600	772.00	463,200	
ファースト住建	800	1,218.00	974,400	
ランド	101,000	12.00	1,212,000	
カチタス	4,600	2,921.00	13,436,600	
トーセイ	2,600	1,080.00	2,808,000	
穴吹興産	400	2,083.00	833,200	
サンフロンティア不動産	2,300	938.00	2,157,400	
エフ・ジェー・ネクスト	1,800	1,006.00	1,810,800	
インテリックス	400	812.00	324,800	
ランドビジネス	800	350.00	280,000	
サンネクスタグループ	600	983.00	589,800	
グランディハウス	1,300	433.00	562,900	

日本空港ビルデング	6,500	4,530.00	29,445,000	
明豊ファシリティワークス	800	755.00	604,000	
日本工営	1,100	3,240.00	3,564,000	
L I F U L L	6,000	369.00	2,214,000	
ミクシィ	4,600	2,657.00	12,222,200	
ジェイエシーリクルートメント	1,200	1,777.00	2,132,400	
日本M&Aセンター	29,600	2,626.00	77,729,600	
メンバーズ	500	2,640.00	1,320,000	
中広	200	348.00	69,600	
UTグループ	2,600	3,000.00	7,800,000	
アイティメディア	600	1,580.00	948,000	
タケエイ	2,000	1,262.00	2,524,000	
E・Jホールディングス	900	1,080.00	972,000	
夢真ビーネックスグループ	4,800	1,233.00	5,918,400	
コシダカホールディングス	4,800	559.00	2,683,200	
アルトナー	400	780.00	312,000	
パソナグループ	2,000	1,839.00	3,678,000	
C D S	400	1,516.00	606,400	
リンクアンドモチベーション	3,300	547.00	1,805,100	
G C A	2,400	866.00	2,078,400	
エス・エム・エス	6,100	2,853.00	17,403,300	
サニーサイドアップグループ	600	746.00	447,600	
パーソルホールディングス	18,100	1,989.00	36,000,900	
リニカル	1,000	745.00	745,000	
クックパッド	5,600	250.00	1,400,000	
エスクリ	600	391.00	234,600	
アイ・ケイ・ケイ	900	646.00	581,400	
学情	600	1,377.00	826,200	
スタジオアリス	900	2,285.00	2,056,500	
シミックホールディングス	1,000	1,533.00	1,533,000	
エプコ	400	969.00	387,600	
N J S	400	2,070.00	828,000	
総合警備保障	7,200	5,050.00	36,360,000	
カカコム	13,300	2,950.00	39,235,000	
アイロムグループ	600	2,058.00	1,234,800	
セントケア・ホールディング	1,300	1,076.00	1,398,800	



サイネックス	300	660.00	198,000	
ルネサンス	1,100	1,088.00	1,196,800	
ディップ	2,800	2,802.00	7,845,600	
デジタルホールディングス	1,300	1,891.00	2,458,300	
新日本科学	2,200	772.00	1,698,400	
ツクイホールディングス	800	921.00	736,800	
キャリアデザインセンター	500	1,094.00	547,000	
ベネフィット・ワン	6,600	2,688.00	17,740,800	
エムスリー	31,900	6,957.00	221,928,300	
ツカダ・グローバルホールディング	1,400	329.00	460,600	
プラス	200	501.00	100,200	
アウトソーシング	10,300	1,835.00	18,900,500	
ウェルネット	1,800	503.00	905,400	
ワールドホールディングス	600	2,674.00	1,604,400	
ディー・エヌ・エー	7,600	2,005.00	15,238,000	
博報堂DYホールディングス	25,100	1,784.00	44,778,400	
ぐるなび	3,100	554.00	1,717,400	
タカミヤ	2,200	515.00	1,133,000	
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	694.00	971,600	
ファンコミュニケーションズ	5,000	377.00	1,885,000	
ライク	500	2,279.00	1,139,500	
ビジネス・ブレークスルー	800	444.00	355,200	
エスプール	4,600	881.00	4,052,600	
WDBホールディングス	800	2,456.00	1,964,800	
手間いらず	200	5,510.00	1,102,000	
ティア	1,100	481.00	529,100	
C D G	200	1,581.00	316,200	
アドウェイズ	2,900	917.00	2,659,300	
バリューコマース	1,200	3,005.00	3,606,000	
インフォマート	18,300	863.00	15,792,900	
J Pホールディングス	5,100	286.00	1,458,600	
エコナックホールディングス	3,100	86.00	266,600	
E P Sホールディングス	2,700	1,324.00	3,574,800	
レグス	400	2,520.00	1,008,000	
プレステージ・インターナショナル	6,800	704.00	4,787,200	
アミューズ	1,000	2,173.00	2,173,000	

ドリームインキュベータ	600	983.00	589,800
クイック	1,100	1,259.00	1,384,900
T A C	900	235.00	211,500
電通グループ	20,300	3,470.00	70,441,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	800	784.00	627,200
ぴあ	500	2,946.00	1,473,000
イオンファンタジー	700	1,908.00	1,335,600
シーティーエス	2,000	877.00	1,754,000
ネクシィーズグループ	600	840.00	504,000
H . U . グループホールディングス	5,100	3,215.00	16,396,500
アルプス技研	1,600	1,964.00	3,142,400
サニックス	2,900	325.00	942,500
ダイオーズ	400	994.00	397,600
日本空調サービス	1,900	746.00	1,417,400
オリエンタルランド	19,200	15,280.00	293,376,000
ダスキン	4,200	2,643.00	11,100,600
明光ネットワークジャパン	2,200	573.00	1,260,600
ファルコホールディングス	900	1,695.00	1,525,500
秀英予備校	400	396.00	158,400
田谷	300	537.00	161,100
ラウンドワン	6,200	1,310.00	8,122,000
リゾートトラスト	8,300	1,668.00	13,844,400
ビー・エム・エル	2,300	3,480.00	8,004,000
ワタベウェディング	200	199.00	39,800
りらいあコミュニケーションズ	2,700	1,246.00	3,364,200
リソー教育	9,100	284.00	2,584,400
早稲田アカデミー	800	896.00	716,800
ユー・エス・エス	20,200	1,870.00	37,774,000
東京個別指導学院	1,600	568.00	908,800
サイバーエージェント	44,500	2,054.00	91,403,000
楽天グループ	84,200	1,328.00	111,817,600
クリーク・アンド・リバー社	900	1,446.00	1,301,400
モーニングスター	2,600	427.00	1,110,200
テー・オー・ダブリュー	3,100	318.00	985,800
山田コンサルティンググループ	1,100	1,164.00	1,280,400
セントラルスポーツ	700	2,411.00	1,687,700

フルキャストホールディングス	1,500	1,919.00	2,878,500	
エン・ジャパン	3,200	3,520.00	11,264,000	
リソルホールディングス	200	3,970.00	794,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,600	7,980.00	28,728,000	
アトラグループ	400	324.00	129,600	
インターワークス	500	380.00	190,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	700	12,560.00	8,792,000	
K e e P e r 技研	1,200	2,111.00	2,533,200	
ファーストロジック	300	734.00	220,200	
三機サービス	300	1,063.00	318,900	
G u n o s y	1,100	921.00	1,013,100	
デザインワン・ジャパン	500	224.00	112,000	
イー・ガーディアン	800	2,533.00	2,026,400	
リブセンス	1,000	224.00	224,000	
ジャパンマテリアル	5,600	1,153.00	6,456,800	
ベクトル	2,300	881.00	2,026,300	
ウチヤマホールディングス	900	356.00	320,400	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,300	1,195.00	1,553,500	
キャリアリンク	600	2,113.00	1,267,800	
I B J	1,500	918.00	1,377,000	
アサンテ	700	1,850.00	1,295,000	
N・フィールド	200	1,198.00	239,600	
バリューHR	700	1,659.00	1,161,300	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	4,365.00	6,547,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,487.00	1,040,900	
E R Iホールディングス	500	575.00	287,500	
アビスト	300	2,878.00	863,400	
シグマクシス	1,000	1,999.00	1,999,000	
ウィルグループ	1,300	934.00	1,214,200	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,600	232.00	603,200	
メドピア	1,400	4,565.00	6,391,000	
レアジョブ	300	1,727.00	518,100	
リクルートホールディングス	129,400	4,787.00	619,437,800	
エラン	2,500	1,286.00	3,215,000	
土木管理総合試験所	900	370.00	333,000	
ネットマーケティング	900	526.00	473,400	

日本郵政	136,600	925.50	126,423,300	
ベルシステム24ホールディングス	3,000	1,568.00	4,704,000	
鎌倉新書	1,800	1,193.00	2,147,400	
S MN	400	787.00	314,800	
一蔵	200	402.00	80,400	
グローバルキッズCOMPANY	300	964.00	289,200	
エアトリ	1,100	2,229.00	2,451,900	
アトラエ	1,300	1,559.00	2,026,700	
ストライク	700	4,035.00	2,824,500	
ソラスト	4,400	1,259.00	5,539,600	
セラク	600	2,034.00	1,220,400	
インソース	1,800	2,284.00	4,111,200	
ベйкаレント・コンサルティング	1,200	32,150.00	38,580,000	
Orchestra Holdings	400	2,597.00	1,038,800	
アイモバイル	600	1,245.00	747,000	
キャリアインデックス	700	548.00	383,600	
MS - Japan	700	1,100.00	770,000	
船場	400	826.00	330,400	
グレイステクノロジー	1,800	1,963.00	3,533,400	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,200	2,174.00	11,304,800	
フルテック	300	1,348.00	404,400	
グリーンズ	700	505.00	353,500	
ツナググループ・ホールディングス	400	286.00	114,400	
GameWith	500	642.00	321,000	
ソウルドアウト	400	1,532.00	612,800	
MS&Consulting	300	573.00	171,900	
ウェルビー	700	1,402.00	981,400	
エル・ティー・エス	200	3,360.00	672,000	
ミダック	400	5,080.00	2,032,000	
日総工産	1,400	695.00	973,000	
キュービーネットホールディングス	800	1,663.00	1,330,400	
RPAホールディングス	2,100	683.00	1,434,300	
スプリックス	500	1,085.00	542,500	
マネジメントソリューションズ	900	1,718.00	1,546,200	
プロレド・パートナーズ	300	2,893.00	867,900	

and factory	400	679.00	271,600	
テノ・ホールディングス	200	1,194.00	238,800	
フロンティア・マネジメント	400	1,330.00	532,000	
ピアラ	100	1,130.00	113,000	
コプロ・ホールディングス	200	1,250.00	250,000	
ギークス	300	1,730.00	519,000	
カーブスホールディングス	5,000	813.00	4,065,000	
フォーラムエンジニアリング	1,300	896.00	1,164,800	
ダイレクトマーケティングミックス	900	3,275.00	2,947,500	
ポピンズホールディングス	500	4,260.00	2,130,000	
LITALICO	700	5,650.00	3,955,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	900	731.00	657,900	
リログループ	9,900	2,107.00	20,859,300	
東祥	1,100	1,669.00	1,835,900	
エイチ・アイ・エス	2,800	2,263.00	6,336,400	
ラックランド	500	2,489.00	1,244,500	
共立メンテナンス	3,000	3,385.00	10,155,000	
イチネンホールディングス	1,900	1,233.00	2,342,700	
建設技術研究所	1,200	2,425.00	2,910,000	
スペース	1,200	867.00	1,040,400	
長大	700	1,840.00	1,288,000	
燦ホールディングス	800	1,204.00	963,200	
スバル興業	100	8,040.00	804,000	
東京テアトル	700	1,235.00	864,500	
タナベ経営	300	1,435.00	430,500	
ナガワ	600	8,250.00	4,950,000	
東京都競馬	1,200	5,190.00	6,228,000	
常磐興産	700	1,400.00	980,000	
カナモト	3,200	2,591.00	8,291,200	
西尾レントオール	1,700	3,075.00	5,227,500	
アゴラ ホスピタリティィー グループ	9,400	24.00	225,600	
トランス・コスモス	1,700	2,906.00	4,940,200	
乃村工藝社	7,700	836.00	6,437,200	
藤田観光	700	1,958.00	1,370,600	
KNT-CTホールディングス	1,000	1,107.00	1,107,000	
日本管財	1,900	2,298.00	4,366,200	

トーカイ	1,700	2,472.00	4,202,400	
白洋舎	200	2,307.00	461,400	
セコム	17,800	8,599.00	153,062,200	
セントラル警備保障	900	2,808.00	2,527,200	
丹青社	3,400	824.00	2,801,600	
メイテック	2,200	5,700.00	12,540,000	
応用地質	2,000	1,290.00	2,580,000	
船井総研ホールディングス	3,700	2,317.00	8,572,900	
進学会ホールディングス	700	416.00	291,200	
オオバ	1,300	818.00	1,063,400	
いであ	400	1,799.00	719,600	
学究社	500	1,310.00	655,000	
ベネッセホールディングス	6,600	2,495.00	16,467,000	
イオンディライト	2,200	3,405.00	7,491,000	
ナック	900	911.00	819,900	
ダイセキ	3,000	3,935.00	11,805,000	
ステップ	700	1,570.00	1,099,000	
合 計	20,067,200		48,772,214,410	

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年 5月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	9,609,277,894
コール・ローン	1,136,624,708
株式	76,199,161,360
投資証券	1,725,870,856
派生商品評価勘定	551,048,876
未収入金	2,950,176
未収配当金	88,345,557
差入委託証拠金	4,293,163,008
流動資産合計	93,606,442,435
資産合計	93,606,442,435
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,845,882
未払解約金	813,616,000
未払利息	3,082
流動負債合計	821,464,964
負債合計	821,464,964
純資産の部	
元本等	
元本	51,474,683,615
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	41,310,293,856
元本等合計	92,784,977,471
純資産合計	92,784,977,471
負債純資産合計	93,606,442,435

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

4.収益及び費用の計上基準	<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。 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 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	34,421,211,224円
期中追加設定元本額	57,928,784,902円
期中一部解約元本額	40,875,312,511円
期末元本額	51,474,683,615円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,349,804,364円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	4,582,613,635円
りそなラップ型ファンド(成長型)	4,939,104,432円
DCりそな グローバルバランス	23,622,328円
つみたてバランスファンド	1,562,926,112円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,406,910,200円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	749,384,960円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	463,757,949円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	103,137,138円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	70,084,991円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	37,087,929円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	55,148,020円
リスクコントロール・オープン	51,194,980円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	126,508,737円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	96,155,969円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	20,973,770,765円
Smart-i 先進国株式インデックス	5,166,516,179円
Smart-i 8資産バランス 安定型	252,319,410円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	610,290,076円
Smart-i 8資産バランス 成長型	689,844,963円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,610,611,547円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	1,814,542,553円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,071,903,525円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	709,053,504円



りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,457,631,716円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	247,891,965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)	4,395,962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)	228,616,345円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	736,583,120円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	283,270,241円
2. 計算日における受益権の総数	51,474,683,615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	1.8025円
(10,000口当たり純資産額)	(18,025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 5月17日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

#### 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

2021年 5月17日現在

該当事項はありません。

## ( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		5,149,495,261
投資証券		183,561,918
合計		5,333,057,179

(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 5月17日現在 )

( 単位 : 円 )

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引 買建	13,549,771,392	-	14,093,222,344	543,450,952

合計	13,549,771,392	-	14,093,222,344	543,450,952
----	----------------	---	----------------	-------------

## (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 5月17日現在)

(単位: 円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	823,169,037	-	822,419,434	749,603
	米ドル	679,860,139	-	678,802,698	1,057,441
	カナダドル	24,514,822	-	24,468,319	46,503
	ユーロ	43,040,985	-	43,150,770	109,785
	英ポンド	21,122,728	-	21,129,331	6,603
	スイスフラン	17,251,048	-	17,347,601	96,553
	スウェーデンクローナ	7,509,251	-	7,576,010	66,759
	デンマーククローネ	3,917,760	-	3,929,200	11,440
	オーストラリアドル	16,775,728	-	16,821,961	46,233
	香港ドル	3,443,816	-	3,437,960	5,856
	イスラエルシケル	5,732,760	-	5,755,584	22,824
	売建	1,240,776,748	-	1,240,275,103	501,645
	米ドル	942,918,300	-	942,242,439	675,861
	カナダドル	31,675,319	-	31,691,180	15,861
	ユーロ	136,832,772	-	136,888,945	56,173
	英ポンド	43,179,080	-	43,183,672	4,592
	スイスフラン	25,698,256	-	25,718,430	20,174
	スウェーデンクローナ	11,635,989	-	11,659,440	23,451
	デンマーククローネ	9,819,700	-	9,823,000	3,300

	オーストラリアドル	33,439,816	-	33,473,796	33,980
	シンガポールドル	2,214,216	-	2,214,469	253
	イスラエルシェケル	3,363,300	-	3,379,732	16,432
	合計	2,063,945,785	-	2,062,694,537	247,958

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	7,185	25.10	180,343.50	
	CABOT OIL & GAS CORP	5,423	17.77	96,366.71	
	CHENIERE ENERGY INC	2,514	83.83	210,748.62	
	CHEVRON CORP	26,491	109.47	2,899,969.77	
	CONOCOPHILLIPS	18,076	56.52	1,021,655.52	
	DEVON ENERGY CORP	8,400	26.38	221,592.00	
	EOG RESOURCES INC	7,783	82.60	642,875.80	
	EXXON MOBIL CORP	58,218	60.77	3,537,907.86	
	HALLIBURTON CO	11,937	23.06	275,267.22	
	HESS CORP	4,079	84.33	343,982.07	
	KINDER MORGAN INC	27,151	18.36	498,492.36	

MARATHON PETROLEUM CORP	8,739	60.08	525,039.12
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	13,724	25.10	344,472.40
ONEOK INC	6,554	54.35	356,209.90
PHILLIPS 66	5,838	87.70	511,992.60
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,424	157.05	380,689.20
SCHLUMBERGER LTD	18,563	32.81	609,052.03
VALERO ENERGY CORP	5,488	81.21	445,680.48
WILLIAMS COS INC	16,239	25.88	420,265.32
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,096	301.05	932,050.80
ALBEMARLE CORP	1,582	163.81	259,147.42
AMCOR PLC	23,330	12.37	288,592.10
AVERY DENNISON CORP	928	219.06	203,287.68
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	1,686	32.64	55,031.04
BALL CORP	4,409	89.10	392,841.90
CELANESE CORP	1,759	167.19	294,087.21
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	54.34	160,683.38
CORTEVA INC	10,203	46.32	472,602.96
CROWN HOLDINGS INC	1,510	111.69	168,651.90
DOW INC	9,910	69.83	692,015.30
DUPONT DE NEMOURS INC	7,359	83.24	612,563.16
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	128.99	242,372.21
ECOLAB INC	3,609	224.06	808,632.54
FMC CORP	1,927	118.19	227,752.13
FREEMPORT-MCMORAN INC	19,809	42.29	837,722.61
INTERNATIONAL PAPER CO	5,534	62.65	346,705.10
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,032	141.21	428,148.72
LINDE PLC	7,260	301.17	2,186,494.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,676	114.07	419,321.32
MARTIN MARIETTA MATERIALS	926	377.97	350,000.22
MOSAIC CO/THE	3,288	36.49	119,979.12
NEWMONT CORP	10,613	70.75	750,869.75
NUCOR CORP	4,490	102.51	460,269.90
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	154.25	202,376.00
PPG INDUSTRIES INC	3,178	179.10	569,179.80
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	96.98	140,233.08

SEALED AIR CORP	1,397	56.49	78,916.53
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,447	286.09	986,152.23
STEEL DYNAMICS INC	2,352	63.76	149,963.52
VULCAN MATERIALS CO	1,832	191.18	350,241.76
WESTROCK CO	3,862	60.57	233,921.34
3M CO	7,994	204.38	1,633,813.72
ALLEGION PLC	1,026	140.25	143,896.50
AMETEK INC	3,087	134.34	414,707.58
BOEING CO/THE	7,426	228.47	1,696,618.22
CARRIER GLOBAL CORP	11,040	43.64	481,785.60
CATERPILLAR INC	7,524	242.23	1,822,538.52
CUMMINS INC	1,966	265.67	522,307.22
DEERE & CO	4,154	384.00	1,595,136.00
DOVER CORP	2,147	151.40	325,055.80
EATON CORP PLC	5,290	148.16	783,766.40
EMERSON ELECTRIC CO	7,898	95.84	756,944.32
FASTENAL CO	7,657	53.90	412,712.30
FORTIVE CORP	4,092	70.61	288,936.12
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	107.95	203,161.90
GENERAC HOLDINGS INC	936	300.89	281,633.04
GENERAL DYNAMICS CORP	3,232	191.94	620,350.08
GENERAL ELECTRIC CO	121,691	13.26	1,613,622.66
HEICO CORP	647	136.48	88,302.56
HEICO CORP-CLASS A	819	124.63	102,071.97
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9,692	227.36	2,203,573.12
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	33.25	194,645.50
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	216.21	130,590.84
IDEX CORP	1,126	224.36	252,629.36
ILLINOIS TOOL WORKS	4,425	238.50	1,055,362.50
INGERSOLL-RAND INC	5,287	48.54	256,630.98
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,800	64.79	181,412.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	9,914	65.55	649,862.70
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,858	217.04	620,300.32
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	350.84	164,894.80
LOCKHEED MARTIN CORP	3,495	390.78	1,365,776.10

MASCO CORP	3,079	64.15	197,517.85
NORDSON CORP	746	205.87	153,579.02
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,082	371.61	773,692.02
OTIS WORLDWIDE CORP	5,512	78.88	434,786.56
OWENS CORNING	1,611	106.47	171,523.17
PACCAR INC	4,610	94.66	436,382.60
PARKER HANNIFIN CORP	1,716	321.84	552,277.44
PENTAIR PLC	2,474	68.78	170,161.72
PLUG POWER INC	6,069	24.58	149,176.02
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	21,167	85.88	1,817,821.96
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,550	267.46	414,563.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,378	438.35	604,046.30
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	58.00	97,556.00
SMITH (A.O.) CORP	1,507	71.77	108,157.39
SNAP-ON INC	772	255.19	197,006.68
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,069	216.01	446,924.69
SUNRUN INC	1,550	41.42	64,201.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	550	425.84	234,212.00
TEXTRON INC	3,103	67.99	210,972.97
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,195	184.20	588,519.00
TRANSDIGM GROUP INC	689	597.41	411,615.49
UNITED RENTALS INC	983	341.79	335,979.57
WABTEC CORP	2,696	80.53	217,108.88
WW GRAINGER INC	677	467.06	316,199.62
XYLEM INC	2,684	118.40	317,785.60
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	83.15	128,134.15
CINTAS CORP	1,181	358.08	422,892.48
COPART INC	2,853	124.13	354,142.89
COSTAR GROUP INC	524	821.90	430,675.60
EQUIFAX INC	1,644	239.41	393,590.04
IHS MARKIT LTD	5,054	104.96	530,467.84
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	138.45	245,748.75
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	103.38	202,934.94
REPUBLIC SERVICES INC	3,015	111.10	334,966.50
ROBERT HALF INTL INC	1,565	90.12	141,037.80

ROLLINS INC	3,021	36.92	111,535.32
TRANSUNION	2,592	108.05	280,065.60
VERISK ANALYTICS INC	2,060	175.00	360,500.00
WASTE CONNECTIONS INC	3,522	121.26	427,077.72
WASTE MANAGEMENT INC	5,564	141.94	789,754.16
AMERCO	106	617.14	65,416.84
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1,486	99.78	148,273.08
CSX CORP	10,702	101.71	1,088,500.42
DELTA AIR LINES INC	1,316	46.31	60,943.96
EXPEDITORS INTL WASH INC	2,507	119.61	299,862.27
FEDEX CORP	3,480	309.43	1,076,816.40
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	176.49	205,787.34
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	309.01	405,730.13
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	1,044	48.88	51,030.72
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,384	289.83	980,784.72
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,297	269.57	349,632.29
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	62.30	137,371.50
UBER TECHNOLOGIES INC	12,797	47.42	606,833.74
UNION PACIFIC CORP	9,382	227.86	2,137,782.52
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9,792	216.38	2,118,792.96
XPO LOGISTICS INC	977	146.05	142,690.85
APTIV PLC	3,602	139.18	501,326.36
AUTOLIV INC	743	101.72	75,577.96
BORGWARNER INC	3,548	51.43	182,473.64
FORD MOTOR CO	52,187	11.84	617,894.08
GENERAL MOTORS CO	17,042	56.00	954,352.00
LEAR CORP	775	186.20	144,305.00
TESLA INC	10,321	589.74	6,086,706.54
DR HORTON INC	4,656	96.29	448,326.24
GARMIN LTD	1,968	140.39	276,287.52
HASBRO INC	1,788	96.30	172,184.40
LENNAR CORP-A	3,733	99.71	372,217.43
LULULEMON ATHLETICA INC	1,638	314.65	515,396.70
MOHAWK INDUSTRIES INC	564	219.10	123,572.40
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	28.95	160,209.30



NIKE INC -CL B	17,217	135.93	2,340,306.81
NVR INC	54	4,949.71	267,284.34
PELOTON INTERACTIVE INC-A	3,397	96.58	328,082.26
PULTEGROUP INC	3,683	58.46	215,308.18
VF CORP	4,481	85.44	382,856.64
WHIRLPOOL CORP	714	246.72	176,158.08
AIRBNB INC-CLASS A	758	141.20	107,029.60
ARAMARK	2,216	39.10	86,645.60
BOOKING HOLDINGS INC	566	2,282.48	1,291,883.68
CARNIVAL CORP	11,230	27.20	305,456.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	355	1,356.21	481,454.55
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	139.52	250,577.92
DOMINO'S PIZZA INC	590	427.29	252,101.10
DRAFTKINGS INC - CL A	2,552	44.89	114,559.28
EXPEDIA GROUP INC	1,958	171.80	336,384.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,758	123.61	464,526.38
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	57.90	296,737.50
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	3,715	143.29	532,322.35
MCDONALD'S CORP	10,270	231.72	2,379,764.40
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	17.64	63,504.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	39.11	274,825.97
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,461	84.27	207,388.47
STARBUCKS CORP	16,209	111.20	1,802,440.80
VAIL RESORTS INC	557	323.64	180,267.48
WYNN RESORTS LTD	1,490	126.67	188,738.30
YUM! BRANDS INC	4,053	119.27	483,401.31
ACTIVISION BLIZZARD INC	10,874	93.35	1,015,087.90
ALPHABET INC-CL A	4,117	2,278.38	9,380,090.46
ALPHABET INC-CL C	4,044	2,316.16	9,366,551.04
ALTICE USA INC- A	4,447	37.83	168,230.01
CABLE ONE INC	68	1,740.36	118,344.48
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,909	710.40	1,356,153.60
COMCAST CORP-CLASS A	62,734	58.68	3,681,231.12
DISCOVERY INC - A	1,722	35.65	61,389.30
DISCOVERY INC-C	3,336	30.74	102,548.64

DISH NETWORK CORP-A	3,674	45.82	168,342.68
ELECTRONIC ARTS INC	3,889	138.62	539,093.18
FACEBOOK INC-A	32,918	315.94	10,400,112.92
FOX CORP - CLASS A	3,877	37.26	144,457.02
FOX CORP- CLASS B	1,836	36.27	66,591.72
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	228.29	257,054.54
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	32.52	191,022.48
LIBERTY BROADBAND-A	223	161.99	36,123.77
LIBERTY BROADBAND-C	2,173	166.62	362,065.26
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	44.06	94,861.18
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	41.78	73,407.46
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	41.72	39,467.12
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	85.80	210,639.00
MATCH GROUP INC	3,380	142.19	480,602.20
NETFLIX INC	6,074	493.37	2,996,729.38
NEWS CORP - CLASS A	5,861	26.70	156,488.70
OMNICOM GROUP	3,237	83.64	270,742.68
PINTEREST INC- CLASS A	6,698	58.05	388,818.90
ROKU INC	1,447	315.95	457,179.65
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	5.91	61,387.17
SNAP INC - A	12,546	52.99	664,812.54
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	1,602	166.99	267,517.98
TWITTER INC	10,694	51.73	553,200.62
VIACOMCBS INC - CLASS B	8,010	38.91	311,669.10
WALT DISNEY CO/THE	24,844	173.70	4,315,402.80
ZILLOW GROUP INC - A	904	113.32	102,441.28
ZILLOW GROUP INC - C	1,987	111.88	222,305.56
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	202.81	190,032.97
AMAZON.COM INC	5,817	3,222.90	18,747,609.30
AUTOZONE INC	311	1,527.58	475,077.38
BEST BUY CO INC	3,104	120.39	373,690.56
BURLINGTON STORES INC	893	333.76	298,047.68
CARMAX INC	2,353	124.83	293,724.99
CARVANA CO	902	237.53	214,252.06
CHEWY INC - CLASS A	1,090	67.75	73,847.50

DOLLAR GENERAL CORP	3,308	206.20	682,109.60
DOLLAR TREE INC	3,180	111.23	353,711.40
EBAY INC	9,836	60.86	598,618.96
ETSY INC	1,722	163.11	280,875.42
GENUINE PARTS CO	1,957	131.96	258,245.72
HOME DEPOT INC	14,748	323.63	4,772,895.24
LKQ CORP	2,845	50.68	144,184.60
LOWE'S COS INC	9,885	198.91	1,966,225.35
MERCADOLIBRE INC	587	1,323.10	776,659.70
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	983	553.33	543,923.39
POOL CORP	578	437.87	253,088.86
ROSS STORES INC	4,714	130.50	615,177.00
TARGET CORP	6,913	211.16	1,459,749.08
TJX COMPANIES INC	16,596	72.43	1,202,048.28
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,677	187.88	315,074.76
ULTA BEAUTY INC	726	324.28	235,427.28
WAYFAIR INC- CLASS A	864	300.00	259,200.00
COSTCO WHOLESALE CORP	6,083	384.42	2,338,426.86
KROGER CO	10,508	37.20	390,897.60
SYSCO CORP	6,442	84.00	541,128.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	9,956	54.71	544,692.76
WALMART INC	19,472	139.52	2,716,733.44
ALTRIA GROUP INC	25,841	50.28	1,299,285.48
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	7,379	67.66	499,263.14
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	4,118	78.24	322,192.32
BUNGE LTD	1,423	90.63	128,966.49
CAMPBELL SOUP CO	1,995	49.27	98,293.65
COCA-COLA CO/THE	56,069	54.73	3,068,656.37
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,797	60.27	168,575.19
CONAGRA BRANDS INC	6,526	37.56	245,116.56
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,218	234.44	519,987.92
GENERAL MILLS INC	7,972	63.40	505,424.80
HERSHEY CO/THE	1,965	171.11	336,231.15
HORMEL FOODS CORP	4,355	46.58	202,855.90
JM SMUCKER CO/THE	1,257	135.33	170,109.81

KELLOGG CO	3,449	66.54	229,496.46
KEURIG DR PEPPER INC	8,271	36.05	298,169.55
KRAFT HEINZ CO/THE	8,943	43.73	391,077.39
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	78.79	168,216.65
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	3,284	89.56	294,115.04
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	58.18	162,613.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	19,830	62.37	1,236,797.10
MONSTER BEVERAGE CORP	5,211	92.14	480,141.54
PEPSICO INC	19,035	146.59	2,790,340.65
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	21,507	97.70	2,101,233.90
TYSON FOODS INC-CL A	3,944	80.34	316,860.96
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	88.55	285,396.65
CLOROX COMPANY	1,647	181.32	298,634.04
COLGATE-PALMOLIVE CO	11,289	83.56	943,308.84
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,127	296.48	927,092.96
KIMBERLY-CLARK CORP	4,429	134.18	594,283.22
PROCTER & GAMBLE CO/THE	33,650	138.01	4,644,036.50
ABBOTT LABORATORIES	24,356	118.31	2,881,558.36
ABIOMED INC	494	268.56	132,668.64
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,007	569.04	573,023.28
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,255	116.52	262,752.60
ANTHEM INC	3,497	393.93	1,377,573.21
BAXTER INTERNATIONAL INC	6,716	83.86	563,203.76
BECTON DICKINSON AND CO	4,044	242.38	980,184.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18,762	41.55	779,561.10
CARDINAL HEALTH INC	4,308	56.34	242,712.72
CENTENE CORP	7,685	69.20	531,802.00
CERNER CORP	4,098	76.80	314,726.40
CIGNA CORP	5,108	263.52	1,346,060.16
COOPER COS INC/THE	727	389.19	282,941.13
CVS HEALTH CORP	18,157	84.33	1,531,179.81
DANAHER CORP	8,807	253.58	2,233,279.06
DAVITA INC	1,175	125.41	147,356.75
DENTSPLY SIRONA INC	3,218	67.83	218,276.94
DEXCOM INC	1,222	333.25	407,231.50

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,153	89.49	729,611.97
HCA HEALTHCARE INC	3,581	211.50	757,381.50
HENRY SCHEIN INC	2,103	80.66	169,627.98
HOLOGIC INC	3,815	63.74	243,168.10
HUMANA INC	1,738	452.75	786,879.50
IDEXX LABORATORIES INC	1,129	530.07	598,449.03
INSULET CORP	967	232.42	224,750.14
INTUITIVE SURGICAL INC	1,625	833.38	1,354,242.50
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,325	274.50	363,712.50
MASIMO CORP	701	219.92	154,163.92
MCKESSON CORP	2,170	195.00	423,150.00
MEDTRONIC PLC	18,512	125.27	2,318,998.24
MOLINA HEALTHCARE INC	807	260.48	210,207.36
NOVOCURE LTD	1,266	179.27	226,955.82
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,978	135.42	267,860.76
RESMED INC	1,937	195.42	378,528.54
STERIS PLC	1,157	197.78	228,831.46
STRYKER CORP	4,699	252.95	1,188,612.05
TELADOC HEALTH INC	1,474	139.68	205,888.32
TELEFLEX INC	632	393.00	248,376.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	13,033	409.80	5,340,923.40
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	159.76	169,026.08
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,787	251.70	449,787.90
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	995	333.07	331,404.65
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,759	167.27	461,497.93
10X GENOMICS INC-CLASS A	892	143.79	128,260.68
ABBVIE INC	24,246	116.43	2,822,961.78
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,121	131.15	540,469.15
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,965	173.49	514,397.85
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,684	135.70	228,518.80
AMGEN INC	8,068	251.38	2,028,133.84
AVANTOR INC	6,265	31.61	198,036.65
BIO-RAD LABORATORIES-A	246	600.75	147,784.50
BIOGEN INC	2,151	280.21	602,731.71
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	76.93	202,633.62

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	31,024	64.88	2,012,837.12
CATALENT INC	2,108	102.70	216,491.60
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	34.80	188,894.40
ELI LILLY & CO	11,862	196.21	2,327,443.02
EXACT SCIENCES CORP	2,304	96.74	222,888.96
GILEAD SCIENCES INC	17,383	68.53	1,191,256.99
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,200	92.14	294,848.00
ILLUMINA INC	1,933	381.03	736,530.99
INCYTE CORP	2,513	82.62	207,624.06
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,802	38.24	68,908.48
IQVIA HOLDINGS INC	2,542	234.04	594,929.68
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	179.17	134,915.01
JOHNSON & JOHNSON	36,055	170.22	6,137,282.10
MERCK & CO. INC.	34,728	78.29	2,718,855.12
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	321	1,274.65	409,162.65
MODERNA INC	3,691	161.38	595,653.58
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	94.60	91,194.40
PERKINELMER INC	1,624	143.56	233,141.44
PFIZER INC	76,299	40.02	3,053,485.98
PPD INC	1,772	46.12	81,724.64
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,458	516.62	753,231.96
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	40.73	67,285.96
SAREPTA THERAPEUTICS INC	813	76.05	61,828.65
SEAGEN INC	1,643	147.50	242,342.50
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	12,819	10.57	135,496.83
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5,436	459.07	2,495,504.52
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3,629	217.09	787,819.61
VIATRIS INC	17,737	16.00	283,792.00
WATERS CORP	843	312.24	263,218.32
ZOETIS INC	6,586	172.29	1,134,701.94
BANK OF AMERICA CORP	106,922	42.36	4,529,215.92
CITIGROUP INC	28,659	76.56	2,194,133.04
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	50.47	286,417.25
FIFTH THIRD BANCORP	10,229	42.64	436,164.56
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,273	188.77	429,074.21

HUNTINGTON BANCSHARES INC	14,642	15.85	232,075.70
JPMORGAN CHASE & CO	41,718	164.01	6,842,169.18
KEYCORP	12,976	23.39	303,508.64
M & T BANK CORP	1,846	166.82	307,949.72
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,541	199.38	1,104,764.58
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	23.25	296,832.75
SVB FINANCIAL GROUP	685	578.42	396,217.70
TRUIST FINANCIAL CORP	18,676	61.64	1,151,188.64
US BANCORP	18,811	61.91	1,164,589.01
WELLS FARGO & CO	53,908	46.96	2,531,519.68
ALLY FINANCIAL INC	5,678	54.00	306,612.00
AMERICAN EXPRESS CO	9,575	157.15	1,504,711.25
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	258.34	432,977.84
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	1,555	57.42	89,288.10
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	10,702	51.78	554,149.56
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	18,650	290.68	5,421,182.00
BLACKROCK INC	2,122	856.87	1,818,278.14
BLACKSTONE GROUP INC/THE	8,940	87.48	782,071.20
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6,102	158.11	964,787.22
CARLYLE GROUP INC/THE	1,250	43.51	54,387.50
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	113.83	141,035.37
CME GROUP INC	5,056	216.99	1,097,101.44
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	4,228	116.82	493,914.96
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	34.02	190,443.96
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	330.91	173,065.93
FRANKLIN RESOURCES INC	2,738	34.54	94,570.52
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4,581	368.77	1,689,335.37
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	7,216	113.26	817,284.16
INVESCO LTD	5,927	27.96	165,718.92
KKR & CO INC	6,932	56.14	389,162.48
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	456.30	237,276.00
MOODY'S CORP	2,233	334.04	745,911.32
MORGAN STANLEY	18,743	87.35	1,637,201.05
MSCI INC	1,140	463.46	528,344.40
NASDAQ INC	1,746	164.36	286,972.56

NORTHERN TRUST CORP	2,987	120.17	358,947.79
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	134.17	228,491.51
S&P GLOBAL INC	3,373	379.16	1,278,906.68
SCHWAB (CHARLES) CORP	21,435	73.25	1,570,113.75
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	63.34	109,958.24
STATE STREET CORP	4,767	86.75	413,537.25
SYNCHRONY FINANCIAL	7,979	46.80	373,417.20
T ROWE PRICE GROUP INC	3,050	191.07	582,763.50
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	734	83.88	61,567.92
VOYA FINANCIAL INC	1,741	68.68	119,571.88
AFLAC INC	9,192	56.46	518,980.32
ALLEGHANY CORP	197	720.69	141,975.93
ALLSTATE CORP	4,209	139.26	586,145.34
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	130.17	101,011.92
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	11,606	51.90	602,351.40
AON PLC	3,057	254.24	777,211.68
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	40.19	245,199.19
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,584	147.30	380,623.20
ASSURANT INC	896	161.23	144,462.08
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	1,270	62.23	79,032.10
BROWN & BROWN INC	2,686	52.51	141,041.86
CHUBB LTD	6,327	170.18	1,076,728.86
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,734	120.96	209,744.64
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	203.83	77,863.06
EVEREST RE GROUP LTD	550	271.43	149,286.50
FNF GROUP	3,124	47.02	146,890.48
GLOBE LIFE INC	1,521	106.43	161,880.03
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5,383	66.07	355,654.81
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	70.45	145,127.00
LOEWS CORP	2,906	58.93	171,250.58
MARKEL CORP	207	1,233.32	255,297.24
MARSH & MCLENNAN COS	6,717	134.56	903,839.52
METLIFE INC	10,331	65.90	680,812.90
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	66.83	251,548.12
PROGRESSIVE CORP	8,272	107.10	885,931.20



PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,308	107.68	571,565.44
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,021	128.05	130,739.05
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	160.62	90,268.44
TRAVELERS COS INC/THE	3,388	160.51	543,807.88
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,732	264.85	458,720.20
WR BERKLEY CORP	2,140	80.49	172,248.60
CBRE GROUP INC - A	4,736	86.32	408,811.52
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.77	95,877.00
ACCENTURE PLC-CL A	8,750	288.20	2,521,750.00
ADOBE INC	6,583	486.56	3,203,024.48
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	113.16	245,670.36
ANSYS INC	1,132	326.47	369,564.04
AUTODESK INC	3,052	277.63	847,326.76
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5,962	194.64	1,160,443.68
AVALARA INC	1,064	122.94	130,808.16
BLACK KNIGHT INC	2,282	72.45	165,330.90
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,673	163.18	273,000.14
CADENCE DESIGN SYS INC	3,685	124.28	457,971.80
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	88.31	170,349.99
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	118.95	197,932.80
CITRIX SYSTEMS INC	1,705	117.71	200,695.55
CLOUDFLARE INC - CLASS A	2,240	72.30	161,952.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7,112	71.01	505,023.12
COUPA SOFTWARE INC	887	231.04	204,932.48
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,408	190.64	459,061.12
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	121.50	86,508.00
DATADOG INC - CLASS A	2,452	82.51	202,314.52
DOCUSIGN INC	2,288	187.08	428,039.04
DROPBOX INC-CLASS A	2,695	25.38	68,399.10
DYNATRACE INC	2,449	46.68	114,319.32
EPAM SYSTEMS INC	745	451.56	336,412.20
FAIR ISAAC CORP	389	491.41	191,158.49
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	8,567	150.00	1,285,050.00
FISERV INC	7,910	114.41	904,983.10
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	272.93	304,862.81

FORTINET INC	1,600	205.86	329,376.00
GARTNER INC	1,196	231.10	276,395.60
GLOBAL PAYMENTS INC	4,167	198.93	828,941.31
GODADDY INC - CLASS A	2,217	81.61	180,929.37
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	94.69	85,978.52
HUBSPOT INC	629	498.05	313,273.45
INTL BUSINESS MACHINES CORP	12,287	144.68	1,777,683.16
INTUIT INC	3,606	417.26	1,504,639.56
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	843	157.32	132,620.76
MASTERCARD INC-CLASS A	12,242	363.91	4,454,986.22
MICROSOFT CORP	97,840	248.15	24,278,996.00
MONGODB INC	644	261.19	168,206.36
NORTONLIFELOCK INC	6,268	26.09	163,532.12
OKTA INC	1,540	229.25	353,045.00
ORACLE CORP	27,510	78.89	2,170,263.90
PALO ALTO NETWORKS INC	1,280	336.82	431,129.60
PAYCHEX INC	4,283	100.11	428,771.13
PAYCOM SOFTWARE INC	719	326.31	234,616.89
PAYPAL HOLDINGS INC	15,303	246.29	3,768,975.87
PTC INC	1,603	129.01	206,803.03
RINGCENTRAL INC-CLASS A	975	239.99	233,990.25
SALESFORCE.COM INC	12,489	217.66	2,718,355.74
SERVICENOW INC	2,649	460.33	1,219,414.17
SLACK TECHNOLOGIES INC- CL A	5,137	41.31	212,209.47
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	209.99	79,796.20
SPLUNK INC	2,092	116.22	243,132.24
SQUARE INC - A	5,144	207.85	1,069,180.40
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	74.26	230,057.48
SYNOPSYS INC	1,988	239.70	476,523.60
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	546	517.49	282,549.54
TWILIO INC - A	1,834	299.40	549,099.60
TYLER TECHNOLOGIES INC	585	398.95	233,385.75
VERISIGN INC	1,385	220.92	305,974.20
VISA INC-CLASS A SHARES	23,094	226.94	5,240,952.36
VMWARE INC-CLASS A	1,126	164.30	185,001.80

WESTERN UNION CO	5,513	24.86	137,053.18
WIX.COM LTD	747	222.64	166,312.08
WORKDAY INC-CLASS A	2,288	228.77	523,425.76
ZENDESK INC	1,677	135.04	226,462.08
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	2,665	307.89	820,526.85
ZSCALER INC	963	165.34	159,222.42
AMPHENOL CORP-CL A	7,888	66.36	523,447.68
APPLE INC	231,427	127.45	29,495,371.15
ARISTA NETWORKS INC	777	326.38	253,597.26
ARROW ELECTRONICS INC	902	119.02	107,356.04
CDW CORP/DE	2,130	169.45	360,928.50
CISCO SYSTEMS INC	58,210	52.90	3,079,309.00
COGNEX CORP	1,928	74.04	142,749.12
CORNING INC	10,238	44.28	453,338.64
DELL TECHNOLOGIES -C	3,296	98.43	324,425.28
F5 NETWORKS INC	916	181.27	166,043.32
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19,254	16.26	313,070.04
HP INC	19,172	32.92	631,142.24
IPG PHOTONICS CORP	558	195.81	109,261.98
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	26.58	120,487.14
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	2,546	139.85	356,058.10
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,283	201.88	460,892.04
NETAPP INC	2,471	78.50	193,973.50
SEAGATE TECHNOLOGY	3,159	97.97	309,487.23
TE CONNECTIVITY LTD	4,399	134.20	590,345.80
TRIMBLE INC	3,417	76.31	260,751.27
WESTERN DIGITAL CORP	4,100	71.87	294,667.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	793	486.73	385,976.89
AT&T INC	98,260	32.24	3,167,902.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	28.29	36,946.74
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	3,503	28.25	98,959.75
LUMEN TECHNOLOGIES INC	12,971	14.43	187,171.53
T-MOBILE US INC	7,827	141.52	1,107,677.04
VERIZON COMMUNICATIONS INC	56,968	58.69	3,343,451.92
AES CORP	9,870	25.37	250,401.90

ALLIANT ENERGY CORP	3,704	56.76	210,239.04
AMEREN CORPORATION	3,331	83.70	278,804.70
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,546	86.76	567,930.96
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,418	152.83	369,542.94
ATMOS ENERGY CORP	1,353	100.46	135,922.38
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	25.02	170,636.40
CMS ENERGY CORP	3,883	63.50	246,570.50
CONSOLIDATED EDISON INC	4,473	78.97	353,232.81
DOMINION ENERGY INC	10,981	78.07	857,286.67
DTE ENERGY COMPANY	2,584	141.12	364,654.08
DUKE ENERGY CORP	10,265	103.06	1,057,910.90
EDISON INTERNATIONAL	5,098	58.39	297,672.22
ENERGY CORP	2,701	107.18	289,493.18
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,465	46.38	114,326.70
EVERGY INC	2,522	62.67	158,053.74
EVERSOURCE ENERGY	4,479	85.12	381,252.48
EXELON CORP	12,893	45.09	581,345.37
FIRSTENERGY CORP	8,044	37.61	302,534.84
NEXTERA ENERGY INC	27,024	73.12	1,975,994.88
NISOURCE INC	4,230	25.75	108,922.50
NRG ENERGY INC	3,312	34.33	113,700.96
OGE ENERGY CORP	2,970	34.40	102,168.00
P G & E CORP	21,589	10.81	233,377.09
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	86.06	131,327.56
PPL CORP	10,335	29.26	302,402.10
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6,746	62.52	421,759.92
SEMPRA ENERGY	3,870	138.11	534,485.70
SOUTHERN CO/THE	14,774	65.11	961,935.14
UGI CORP	3,091	45.94	142,000.54
VISTRA CORP	4,854	16.38	79,508.52
WEC ENERGY GROUP INC	4,196	96.20	403,655.20
XCEL ENERGY INC	6,948	71.72	498,310.56
ADVANCED MICRO DEVICES	16,160	74.59	1,205,374.40
ANALOG DEVICES INC	4,806	149.61	719,025.66
APPLIED MATERIALS INC	12,609	124.83	1,573,981.47

	BROADCOM INC	5,520	441.62	2,437,742.40	
	ENPHASE ENERGY INC	1,709	119.78	204,704.02	
	INTEL CORP	55,848	55.35	3,091,186.80	
	KLA CORP	2,030	305.75	620,672.50	
	LAM RESEARCH CORP	2,014	602.99	1,214,421.86	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	10,845	43.36	470,239.20	
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,781	92.85	351,065.85	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3,220	145.47	468,413.40	
	MICRON TECHNOLOGY INC	15,347	79.70	1,223,155.90	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	609	316.52	192,760.68	
	NVIDIA CORP	8,445	569.72	4,811,285.40	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	3,648	192.27	701,400.96	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	37.45	203,166.25	
	QORVO INC	1,631	171.01	278,917.31	
	QUALCOMM INC	15,483	130.15	2,015,112.45	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,194	165.45	362,997.30	
	SOLAREdge TECHNOLOGIES INC	716	218.87	156,710.92	
	TERADYNE INC	2,370	122.35	289,969.50	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	12,577	183.27	2,304,986.79	
	XILINX INC	3,193	118.00	376,774.00	
	米ドル 小計	4,256,424		497,544,177.30 (54,456,210,205)	
カナダドル	CAMECO CORP	2,464	23.79	58,618.56	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	16,284	41.67	678,554.28	
	CENOVUS ENERGY INC	10,337	9.73	100,579.01	
	ENBRIDGE INC	28,581	47.20	1,349,023.20	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	38.91	111,944.07	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	17.92	62,200.32	
	KEYERA CORP	2,259	30.64	69,215.76	
	PARKLAND CORP	1,790	40.28	72,101.20	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	38.58	333,176.88	
	SUNCOR ENERGY INC	20,962	28.12	589,451.44	
	TC ENERGY CORP	12,551	61.24	768,623.24	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	84.82	290,169.22	
	B2GOLD CORP	10,119	6.19	62,636.61	

BARRICK GOLD CORP	23,822	29.12	693,696.64
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	68.61	114,784.53
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	29.52	271,967.76
FRANCO-NEVADA CORP	2,617	181.11	473,964.87
KINROSS GOLD CORP	19,092	9.42	179,846.64
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	3,141	50.27	157,898.07
LUNDIN MINING CORP	7,300	14.18	103,514.00
NUTRIEN LTD	7,998	73.34	586,573.32
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	37.46	76,793.00
SSR MINING INC	2,800	20.91	58,548.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	30.84	228,339.36
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,300	95.16	123,708.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,261	54.77	342,914.97
YAMANA GOLD INC	9,288	6.21	57,678.48
BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	17.75	47,463.50
CAE INC	3,196	37.03	118,347.88
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	103.65	146,768.40
WSP GLOBAL INC	1,340	138.65	185,791.00
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	38.50	120,697.50
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	76.59	138,551.31
THOMSON REUTERS CORP	2,714	114.84	311,675.76
AIR CANADA	840	25.80	21,672.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	9,995	130.07	1,300,049.65
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,165	97.01	889,096.65
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,285	116.94	501,087.90
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,800	43.55	78,390.00
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	81.95	338,125.70
QUEBECOR INC -CL B	1,274	33.26	42,373.24
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	5,731	36.05	206,602.55
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	210.34	196,247.22
DOLLARAMA INC	3,451	53.03	183,006.53
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	11,716	43.13	505,311.08
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	40.51	106,460.28
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	72.14	152,503.96
METRO INC	4,107	58.09	238,575.63

WESTON (GEORGE) LTD	817	114.97	93,930.49
SAPUTO INC	3,667	39.54	144,993.18
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	35.22	115,415.94
CANOPY GROWTH CORP	3,659	27.75	101,537.25
BANK OF MONTREAL	8,502	120.65	1,025,766.30
BANK OF NOVA SCOTIA	16,021	79.76	1,277,834.96
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5,942	132.53	787,493.26
NATIONAL BANK OF CANADA	4,616	91.56	422,640.96
ROYAL BANK OF CANADA	19,705	121.86	2,401,251.30
TORONTO-DOMINION BANK	25,036	87.73	2,196,408.28
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	17,959	58.58	1,052,038.22
IGM FINANCIAL INC	81	44.97	3,642.57
ONEX CORPORATION	908	86.78	78,796.24
TMX GROUP LTD	540	133.06	71,852.40
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	326	569.52	185,663.52
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	36.78	159,183.84
IA FINANCIAL CORP INC	1,254	72.18	90,513.72
INTACT FINANCIAL CORP	2,057	160.44	330,025.08
MANULIFE FINANCIAL CORP	26,548	26.18	695,026.64
POWER CORP OF CANADA	8,338	37.52	312,841.76
SUN LIFE FINANCIAL INC	8,077	65.70	530,658.90
FIRSTSERVICE CORP	671	189.27	127,000.17
BLACKBERRY LTD	7,347	10.22	75,086.34
CGI INC	3,488	108.65	378,971.20
CONSTELLATION SOFTWARE INC	275	1,733.08	476,597.00
OPEN TEXT CORP	4,289	55.94	239,926.66
SHOPIFY INC - CLASS A	1,503	1,314.47	1,975,648.41
BCE INC	2,440	59.34	144,789.60
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	61.89	320,156.97
TELUS CORP	4,085	26.42	107,925.70
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	18.60	166,432.80
ALTAGAS LTD	2,930	23.79	69,704.70
ATCO LTD -CLASS I	863	43.99	37,963.37
BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	47.62	97,906.72
CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.47	35,008.89

	EMERA INC	4,109	56.34	231,501.06
	FORTIS INC	6,487	55.02	356,914.74
	HYDRO ONE LTD	4,991	30.19	150,678.29
	NORTHLAND POWER INC	3,252	38.36	124,746.72
	カナダドル 小計	531,712		31,039,793.32 (2,802,582,938)
ユーロ	ENI SPA	35,538	10.43	370,661.34
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	10.33	76,545.30
	NESTE OYJ	5,733	50.92	291,924.36
	OMV AG	2,574	45.98	118,352.52
	REPSOL SA	21,728	11.10	241,224.25
	TENARIS SA	5,062	9.77	49,496.23
	TOTAL SE	35,015	39.75	1,391,846.25
	VOPAK	762	38.50	29,337.00
	AIR LIQUIDE SA	6,642	142.10	943,828.20
	AKZO NOBEL	2,659	102.65	272,946.35
	ARCELORMITTAL	9,134	26.63	243,238.42
	ARKEMA	822	108.10	88,858.20
	BASF SE	12,913	69.03	891,384.39
	COVESTRO AG	2,528	56.54	142,933.12
	CRH PLC	10,365	41.88	434,086.20
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	29.55	52,983.15
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,085	41.78	45,331.30
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	75.20	162,732.80
	KONINKLIJKE DSM NV	2,331	147.95	344,871.45
	LANXESS AG	745	62.60	46,637.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	43.72	173,830.72
	SOLVAY SA	925	113.15	104,663.75
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	15.64	136,361.82
	SYMRISE AG	1,815	103.75	188,306.25
	UMICORE	2,388	49.99	119,376.12
	UPM-KYMMENE OYJ	8,076	32.69	264,004.44
	VOESTALPINE AG	2,425	36.82	89,288.50
	(Right)FERROVIAL SA-RTS	7,014	0.20	1,437.87
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	26.63	76,561.25



AIRBUS SE	7,861	99.57	782,719.77
ALSTOM	3,998	44.35	177,311.30
BOUYGUES SA	3,499	34.57	120,960.43
BRENTAG SE	2,419	75.22	181,957.18
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	14.00	227,892.00
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	7,237	55.61	402,449.57
DASSAULT AVIATION SA	11	974.50	10,719.50
EIFFAGE	1,313	94.54	124,131.02
FERROVIAL SA	7,014	24.66	172,965.24
GEA GROUP AG	1,676	35.88	60,134.88
HOCHTIEF AG	17	72.58	1,233.86
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	75.68	155,144.00
KION GROUP AG	740	84.96	62,870.40
KNORR-BREMSE AG	1,136	105.05	119,336.80
KONE OYJ-B	4,561	66.74	304,401.14
LEGRAND SA	3,715	86.66	321,941.90
MTU AERO ENGINES AG	831	214.60	178,332.60
PRYSMIAN SPA	2,867	28.78	82,512.26
RATIONAL AG	80	751.20	60,096.00
SAFRAN SA	4,327	124.54	538,884.58
SCHNEIDER ELECTRIC SE	7,324	131.44	962,666.56
SIEMENS AG-REG	10,651	144.06	1,534,383.06
SIEMENS ENERGY AG	5,006	25.45	127,402.70
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	2,294	25.95	59,529.30
THALES SA	1,768	86.32	152,613.76
VINCI SA	7,391	95.41	705,175.31
WARTSILA OYJ ABP	2,705	10.65	28,808.25
BUREAU VERITAS SA	4,564	24.85	113,415.40
RANDSTAD NV	1,871	61.98	115,964.58
TELEPERFORMANCE	832	313.50	260,832.00
WOLTERS KLUWER	3,691	78.12	288,340.92
ADP	314	115.05	36,125.70
AENA SME SA	1,045	147.20	153,824.00
ATLANTIA SPA	8,066	15.86	127,967.09
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	10.88	15,308.16

DEUTSCHE POST AG-REG	13,231	51.01	674,913.31
GETLINK	4,655	13.45	62,609.75
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4,522	83.60	378,039.20
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	70.40	43,577.60
CONTINENTAL AG	1,647	114.76	189,009.72
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	11,398	73.60	838,892.80
FAURECIA	1,292	44.69	57,739.48
FERRARI NV	1,758	163.25	286,993.50
MICHELIN (CGDE)	2,383	124.15	295,849.45
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	1,775	85.72	152,153.00
RENAULT SA	3,099	33.40	103,522.09
STELLANTIS NV	28,900	14.85	429,338.40
VALEO SA	3,692	25.81	95,290.52
VOLKSWAGEN AG	462	266.40	123,076.80
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,502	211.80	529,923.60
ADIDAS AG	2,705	288.90	781,474.50
ESSILORLUXOTTICA	3,854	139.88	539,097.52
HERMES INTERNATIONAL	437	1,068.00	466,716.00
KERING	1,018	706.90	719,624.20
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	3,853	628.10	2,420,069.30
MONCLER SPA	2,414	51.60	124,562.40
PUMA SE	1,586	89.70	142,264.20
SEB SA	166	157.40	26,128.40
ACCOR SA	2,330	32.36	75,398.80
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,314	147.50	341,315.00
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	43.84	35,335.04
SODEXO	1,088	84.44	91,870.72
BOLLORE	3,240	4.21	13,666.32
PUBLICIS GROUPE	3,613	55.46	200,376.98
SCOUT24 AG	1,621	65.22	105,721.62
SES	2,232	6.46	14,427.64
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	54.40	59,568.00
VIVENDI	11,862	29.05	344,591.10
DELIVERY HERO SE	1,926	105.20	202,615.20
HELLOFRESH SE	2,219	67.10	148,894.90

INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	14,775	31.64	467,481.00
JUST EAT TAKEAWAY	1,952	72.40	141,324.80
PROSUS NV	6,873	84.10	578,019.30
ZALANDO SE	2,148	84.24	180,947.52
CARREFOUR SA	7,042	17.05	120,066.10
COLRUYT SA	290	50.42	14,621.80
JERONIMO MARTINS	5,217	15.81	82,506.85
KESKO OYJ-B SHS	4,478	26.17	117,189.26
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	14,664	23.46	344,017.44
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	10,177	62.32	634,230.64
DANONE	8,264	57.55	475,593.20
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	10.10	91,086.47
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	84.90	154,518.00
HEINEKEN NV	3,455	98.92	341,768.60
JDE PEET'S BV	1,184	33.11	39,202.24
KERRY GROUP PLC-A	2,069	108.55	224,589.95
PERNOD RICARD SA	2,853	175.35	500,273.55
REMY COINTREAU	264	166.30	43,903.20
BEIERSDORF AG	1,128	96.94	109,348.32
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	83.00	129,646.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	95.78	229,488.88
L'OREAL	3,494	352.35	1,231,110.90
AMPLIFON SPA	2,059	33.50	68,976.50
BIOMERIEUX	402	94.44	37,964.88
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	245	139.85	34,263.25
DIASORIN SPA	256	138.00	35,328.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	66.92	197,815.52
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,777	44.80	258,838.48
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12,089	46.26	559,297.58
ORPEA	501	108.05	54,133.05
SARTORIUS AG-VORZUG	502	417.30	209,484.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	3,463	46.58	161,306.54
ARGENX SE	674	220.90	148,886.60
BAYER AG-REG	12,953	55.90	724,072.70
EUROFINS SCIENTIFIC	1,530	82.58	126,347.40

GALAPAGOS NV	507	63.05	31,966.35
GRIFOLS SA	3,329	23.73	78,997.17
IPSEN	158	82.62	13,053.96
MERCK KGAA	1,798	140.40	252,439.20
ORION OYJ-CLASS B	739	36.64	27,076.96
QIAGEN N.V.	2,679	38.51	103,168.29
RECORDATI SPA	830	44.20	36,686.00
SANOFI	15,691	86.72	1,360,723.52
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	359.70	159,706.80
UCB SA	2,009	77.82	156,340.38
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	10.71	40,769.87
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	91,083	5.02	457,965.32
BANCO SANTANDER SA	225,197	3.35	755,085.54
BNP PARIBAS	14,918	57.04	850,922.72
CAIXABANK S.A	52,513	2.84	149,294.45
COMMERZBANK AG	13,866	6.48	89,879.41
CREDIT AGRICOLE SA	16,523	13.32	220,185.49
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	33.44	131,118.24
FINECOBANK SPA	7,003	14.18	99,337.55
ING GROEP NV-CVA	51,310	10.86	557,226.60
INTESA SANPAOLO	223,051	2.38	532,534.26
KBC GROEP NV	3,531	68.46	241,732.26
MEDIOBANCA SPA	6,857	9.72	66,704.89
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	19.67	23,918.72
SOCIETE GENERALE SA	12,059	26.10	314,739.90
UNICREDIT SPA	29,529	10.20	301,432.03
AMUNDI SA	618	71.75	44,341.50
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	27,465	11.79	323,812.35
DEUTSCHE BOERSE AG	2,564	139.35	357,293.40
EURAZEO	403	71.55	28,834.65
EXOR NV	1,318	68.76	90,625.68
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	90.72	179,534.88
NATIXIS	3,105	4.06	12,631.14
SOFINA	168	312.20	52,449.60
WENDEL	294	114.60	33,692.40

AEGON NV	16,557	4.03	66,790.93
AGEAS	2,765	52.82	146,047.30
ALLIANZ SE-REG	5,595	216.75	1,212,716.25
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	17.64	282,345.84
AXA SA	26,166	22.87	598,547.25
CNP ASSURANCES	1,015	15.26	15,493.97
HANNOVER RUECK SE	718	146.60	105,258.80
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,879	243.25	457,066.75
NN GROUP NV	4,060	43.60	177,016.00
POSTE ITALIANE SPA	5,374	11.12	59,758.88
SAMPO OYJ-A SHS	6,490	40.79	264,727.10
SCOR SE	1,565	27.59	43,178.35
AROUNDTOWN SA	10,475	6.69	70,140.60
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,911	42.89	210,632.79
LEG IMMOBILIEN SE	1,031	116.35	119,956.85
VONOVIA SE	7,029	51.14	359,463.06
ADYEN NV	239	1,701.20	406,586.80
AMADEUS IT GROUP SA	6,112	61.66	376,865.92
ATOS SE	1,599	54.68	87,433.32
BECHTLE AG	414	152.85	63,279.90
CAPGEMINI SA	2,213	154.05	340,912.65
DASSAULT SYSTEMES SA	1,805	185.15	334,195.75
EDENRED	3,764	45.96	172,993.44
NEMETSCHKE SE	536	56.84	30,466.24
NEXI SPA	7,091	16.00	113,456.00
SAP SE	14,429	113.60	1,639,134.40
TEAMVIEWER AG	2,285	31.00	70,835.00
WORLDLINE SA	3,094	75.78	234,463.32
NOKIA OYJ	76,089	4.04	307,894.13
CELLNEX TELECOM SA	5,983	45.50	272,226.50
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	47,340	16.80	795,312.00
ELISA OYJ	2,152	48.12	103,554.24
ILIAD SA	98	148.00	14,504.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	9.40	23,236.80
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.80	165,225.63

	ORANGE	28,127	10.55	296,964.86	
	PROXIMUS	918	16.98	15,592.23	
	TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.43	31,409.66	
	TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.47	33,621.45	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.56	32,397.88	
	TELEFONICA SA	69,076	4.01	277,063.83	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	34.83	26,679.78	
	E.ON SE	30,402	10.63	323,416.47	
	EDF	10,409	11.86	123,502.78	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	37,111	4.56	169,226.16	
	ELIA GROUP SA/NV	345	89.80	30,981.00	
	ENAGAS SA	2,667	18.96	50,579.65	
	ENDESA SA	4,803	23.06	110,757.18	
	ENEL SPA	113,841	8.20	933,951.56	
	ENGIE	25,193	12.68	319,548.01	
	FORTUM OYJ	6,395	22.80	145,806.00	
	IBERDROLA SA	83,775	11.28	945,400.87	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	21.80	101,326.40	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.21	79,542.47	
	RWE AG	8,723	32.00	279,136.00	
	SNAM SPA	32,585	4.79	156,277.66	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	19.93	115,543.26	
	TERNA SPA	16,305	6.23	101,645.37	
	UNIPER SE	2,857	30.88	88,224.16	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,568	26.10	223,624.80	
	VERBUND AG	797	73.25	58,380.25	
	ASM INTERNATIONAL NV	621	230.70	143,264.70	
	ASML HOLDING NV	5,862	528.00	3,095,136.00	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	18,294	31.58	577,815.99	
	STMICROELECTRONICS NV	8,739	29.17	254,960.32	
	ユーロ 小計	2,476,019		63,203,410.94 (8,391,516,870)	
英債券	BP PLC	284,061	3.13	890,957.32	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	57,449	14.19	815,201.31	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	52,102	13.62	710,046.05	

ANGLO AMERICAN PLC	16,694	32.66	545,309.51
ANTOFAGASTA PLC	4,320	17.78	76,831.20
BHP GROUP PLC	28,186	22.22	626,433.85
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	65.34	143,290.62
EVRAZ PLC	3,072	6.67	20,496.38
FRESNILLO PLC	2,896	8.85	25,635.39
GLENCORE PLC	138,176	3.24	448,519.29
JOHNSON MATTHEY PLC	1,803	32.42	58,453.26
MONDI PLC	5,627	19.38	109,051.26
RIO TINTO PLC	15,750	61.35	966,262.50
ASHTED GROUP PLC	6,287	49.88	313,595.56
BAE SYSTEMS PLC	43,957	5.25	230,950.07
BUNZL PLC	4,790	23.06	110,457.40
DCC PLC	1,401	60.50	84,760.50
FERGUSON PLC	3,075	92.68	284,991.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	76,613	1.62	124,227.97
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107,239	1.07	115,432.05
SMITHS GROUP PLC	3,824	15.72	60,113.28
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	848	121.80	103,286.40
EXPERIAN PLC	12,198	26.59	324,344.82
INTERTEK GROUP PLC	1,825	58.82	107,346.50
RELX PLC	25,710	18.58	477,820.35
RENTOKIL INITIAL PLC	20,885	4.71	98,368.35
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	7.68	93,186.24
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	47.21	70,720.58
BURBERRY GROUP PLC	5,808	21.05	122,258.40
PERSIMMON PLC	5,194	31.47	163,455.18
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.77	76,770.21
COMPASS GROUP PLC	24,300	15.40	374,220.00
ENTAIN PLC	6,950	15.57	108,246.25
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	49.77	125,022.24
WHITBREAD PLC	2,921	31.80	92,887.80
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	5.51	62,529.97
INFORMA PLC	17,619	5.61	98,842.59
PEARSON PLC	7,332	8.59	63,040.53

WPP PLC	19,572	9.81	192,157.89
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	8.93	44,292.80
KINGFISHER PLC	29,802	3.71	110,565.42
NEXT PLC	1,878	80.86	151,855.08
OCADO GROUP PLC	6,371	19.86	126,559.91
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.59	72,110.78
TESCO PLC	104,502	2.30	241,347.36
WM MORRISON SUPERMARKETS	23,008	1.83	42,265.69
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	23.00	114,402.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	32,021	28.27	905,233.67
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	25.10	46,083.60
DIAGEO PLC	32,550	33.53	1,091,564.25
IMPERIAL BRANDS PLC	14,237	15.90	226,368.30
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	9,941	63.66	632,844.06
UNILEVER PLC	36,228	42.94	1,555,630.32
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	15.26	185,073.28
ASTRAZENECA PLC	18,127	78.64	1,425,507.28
GLAXOSMITHKLINE PLC	69,675	13.70	954,826.20
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	23.67	32,001.84
BARCLAYS PLC	231,567	1.80	418,441.56
HSBC HOLDINGS PLC	281,727	4.48	1,264,390.77
LLOYDS BANKING GROUP PLC	943,785	0.48	455,376.26
NATWEST GROUP PLC	73,118	1.93	141,154.29
STANDARD CHARTERED PLC	39,789	5.07	201,730.23
3I GROUP PLC	14,053	12.44	174,889.58
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,068	17.32	53,137.76
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4,254	71.90	305,862.60
M&G PLC	41,949	2.36	99,041.58
SCHRODERS PLC	1,161	35.41	41,111.01
ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	13.76	106,678.75
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	32,937	2.71	89,391.01
ADMIRAL GROUP PLC	2,745	29.45	80,840.25
AVIVA PLC	60,743	4.08	248,378.12
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	2.98	58,457.85



	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	83,505	2.82	236,152.14
	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	7.35	64,365.00
	PRUDENTIAL PLC	34,888	15.14	528,378.76
	RSA INSURANCE GROUP PLC	16,473	6.84	112,708.26
	AVEVA GROUP PLC	700	31.98	22,386.00
	SAGE GROUP PLC/THE	15,187	6.47	98,320.63
	HALMA PLC	4,416	24.97	110,267.52
	BT GROUP PLC	129,623	1.61	209,600.39
	VODAFONE GROUP PLC	360,190	1.40	506,859.36
	NATIONAL GRID PLC	46,737	9.36	437,505.05
	SEVERN TRENT PLC	2,734	25.10	68,623.40
	SSE PLC	14,351	15.35	220,287.85
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	9.89	77,488.15
	英ポンド 小計	3,997,015		23,905,876.04 (3,687,003,261)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.46	55,455.78
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	806.50	62,907.00
	GIVAUDAN-REG	124	3,827.00	474,548.00
	HOLCIM LTD	7,141	54.06	386,042.46
	SIKA AG-REG	1,908	273.80	522,410.40
	ABB LTD-REG	24,382	30.71	748,771.22
	GEBERIT AG-REG	504	621.00	312,984.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	252.20	54,223.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	463	260.50	120,611.50
	ADECCO SA-REG	2,354	61.02	143,641.08
	SGS SA-REG	90	2,734.00	246,060.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	844	283.10	238,936.40
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6,992	94.34	659,625.28
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	290.20	118,982.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	56.80	14,256.80
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,014.00	84,588.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	15	8,280.00	124,200.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	89,000.00	89,000.00
	NESTLE SA-REG	39,531	108.84	4,302,554.04
	ALCON INC	6,601	61.92	408,733.92

	SONOVA HOLDING AG-REG	840	255.60	214,704.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	116	1,327.50	153,990.00	
	LONZA GROUP AG-REG	985	564.20	555,737.00	
	NOVARTIS AG-REG	30,528	80.49	2,457,198.72	
	ROCHE HOLDING AG-BR	420	326.00	136,920.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9,649	303.45	2,927,989.05	
	VIFOR PHARMA AG	638	126.05	80,419.90	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	87.50	23,887.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,933	9.30	306,540.36	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	59.30	211,641.70	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	259	1,300.00	336,700.00	
	UBS GROUP AG-REG	48,789	13.89	677,679.21	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	151.10	99,423.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	368	459.50	169,096.00	
	SWISS RE AG	4,010	88.12	353,361.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,123	381.90	810,773.70	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	89.85	100,362.45	
	TEMENOS GROUP AG-REG	737	132.90	97,947.30	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,319	94.10	218,217.90	
	SWISSCOM AG-REG	414	503.80	208,573.20	
	スイスフラン 小計	235,540		19,309,693.87 (2,342,458,963)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	1,099	278.80	306,401.20	
	BOLIDEN AB	4,039	348.60	1,407,995.40	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	9,468	149.15	1,412,152.20	
	ALFA LAVAL AB	4,566	301.70	1,377,562.20	
	ASSA ABLOY AB-B	13,841	253.90	3,514,229.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	9,124	523.00	4,771,852.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	5,552	447.30	2,483,409.60	
	EPIROC AB-A	9,564	194.60	1,861,154.40	
	EPIROC AB-B	4,649	175.40	815,434.60	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	258.40	378,297.60	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	4,889	314.00	1,535,146.00	
	SANDVIK AB	15,627	233.10	3,642,653.70	
	SKANSKA AB-B SHS	4,937	237.80	1,174,018.60	

SKF AB-B SHARES	4,538	229.90	1,043,286.20		
VOLVO AB-B SHS	18,249	220.95	4,032,116.55		
SECURITAS AB-B SHS	3,833	144.75	554,826.75		
ELECTROLUX AB-SER B	3,653	238.30	870,509.90		
HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	119.65	339,447.05		
EVOLUTION GAMING GROUP	1,877	1,432.80	2,689,365.60		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	9,591	211.90	2,032,332.90		
ICA GRUPPEN AB	1,462	399.40	583,922.80		
SWEDISH MATCH AB	19,990	76.02	1,519,639.80		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	8,201	292.70	2,400,432.70		
NORDEA BANK ABP	43,708	88.37	3,862,475.96		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,883	110.15	2,630,712.45		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	99.70	2,293,598.50		
SWEDBANK AB - A SHARES	13,356	154.42	2,062,433.52		
EQT AB	2,344	262.70	615,768.80		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	327.00	560,478.00		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	307.60	723,782.80		
INVESTOR AB-B SHS	6,250	730.00	4,562,500.00		
KINNEVIK AB - B	3,881	410.95	1,594,896.95		
LUNDBERGS AB-B SHS	920	478.90	440,588.00		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	504.60	798,781.80		
ERICSSON LM-B SHS	39,493	110.26	4,354,498.18		
HEXAGON AB-B SHS	3,933	806.40	3,171,571.20		
TELE2 AB-B SHS	7,424	111.30	826,291.20		
TELIA CO AB	31,100	36.64	1,139,504.00		
スウェーデンクローナ 小計	367,997		70,384,069.01 (924,142,826)		
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	14,162	178.78	2,531,882.36	
	NORSK HYDRO ASA	20,202	53.88	1,088,483.76	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	444.80	1,232,985.60	
	ADEVINTA ASA	3,943	137.75	543,148.25	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	334.60	184,699.20	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	383.00	446,195.00	
	MOWI ASA	5,643	211.10	1,191,237.30	
	ORKLA ASA	11,182	83.80	937,051.60	

	DNB ASA	10,456	182.70	1,910,311.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	189.45	506,589.30	
	TELENOR ASA	9,278	148.05	1,373,607.90	
	ノルウェークローネ 小計	82,029		11,946,191.47 (158,645,422)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	546.20	665,271.60	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	441.60	1,472,294.40	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	2,888.00	372,552.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	13,530	226.50	3,064,545.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	14,740.00	574,860.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	15,505.00	1,534,995.00	
	DSV PANALPINA A S	2,852	1,364.50	3,891,554.00	
	PANDORA A/S	1,659	743.40	1,233,300.60	
	CARLSBERG AS-B	1,603	1,121.00	1,796,963.00	
	AMBU A/S-B	1,526	232.60	354,947.60	
	COLOPLAST-B	1,680	952.00	1,599,360.00	
	DEMANT A/S	550	298.70	164,285.00	
	GN STORE NORD A/S	1,892	475.10	898,889.20	
	GENMAB A/S	907	2,231.00	2,023,517.00	
	H LUNDBECK A/S	120	203.30	24,396.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	23,103	478.85	11,062,871.55	
	DANSKE BANK A/S	9,894	116.25	1,150,177.50	
TRYG A/S	4,694	144.00	675,936.00		
ORSTED A/S	2,606	848.00	2,209,888.00		
	デンマーククローネ 小計	71,435		34,770,603.45 (621,002,977)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	25.93	78,101.16	
	OIL SEARCH LTD	32,812	3.82	125,341.84	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.03	106,424.24	
	SANTOS LTD	26,550	7.01	186,115.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	29.79	10,635.03	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	22.58	307,291.22	
	BHP GROUP LTD	39,662	49.57	1,966,045.34	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	21.49	134,441.44	
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	4.86	78,440.40	

FORTESCUE METALS GROUP LTD	23,433	22.79	534,038.07
JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	41.93	279,086.08
NEWCREST MINING LTD	11,374	27.63	314,263.62
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	10.53	156,654.81
ORICA LTD	6,263	13.80	86,429.40
RIO TINTO LTD	5,096	125.43	639,191.28
SOUTH32 LTD	74,829	2.93	219,248.97
CIMIC GROUP LTD	682	20.05	13,674.10
BRAMBLES LTD	17,428	10.71	186,653.88
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.66	84,311.76
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	4.45	38,715.00
SYDNEY AIRPORT	22,505	5.70	128,278.50
TRANSURBAN GROUP	37,559	14.00	525,826.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	37.34	340,130.06
CROWN RESORTS LTD	773	13.04	10,079.92
TABCORP HOLDINGS LTD	21,233	5.10	108,288.30
REA GROUP LTD	563	147.70	83,155.10
SEEK LTD	3,309	28.92	95,696.28
WESFARMERS LTD	15,132	54.20	820,154.40
COLES GROUP LTD	18,622	16.35	304,469.70
WOOLWORTHS GROUP LTD	16,961	40.58	688,277.38
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	10.84	76,422.00
COCHLEAR LTD	1,060	216.42	229,405.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	63.83	175,532.50
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	35.36	257,067.20
CSL LTD	6,304	277.68	1,750,494.72
AUST AND NZ BANKING GROUP	37,603	27.42	1,031,074.26
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	24,511	96.58	2,367,272.38
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	46,101	26.22	1,208,768.22
WESTPAC BANKING CORP	47,676	25.41	1,211,447.16
AMP LTD	36,656	1.09	39,955.04
ASX LTD	3,256	74.51	242,604.56
MACQUARIE GROUP LTD	4,578	158.34	724,880.52
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	46.93	73,070.01
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	4.91	173,278.81

	MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	2.98	100,181.64	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	24,270	10.52	255,320.40	
	SUNCORP GROUP LTD	19,255	10.29	198,133.95	
	LENDLEASE GROUP	8,292	11.80	97,845.60	
	AFTERPAY LTD	2,984	86.35	257,668.40	
	COMPUTERSHARE LTD	5,604	14.93	83,667.72	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	26.00	41,600.00	
	XERO LTD	1,891	112.50	212,737.50	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.45	249,645.45	
	TPG TELECOM LTD	287	5.26	1,509.62	
	AGL ENERGY LTD	7,599	8.51	64,667.49	
	APA GROUP	13,816	9.66	133,462.56	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.80	2,586.60	
	オーストラリアドル 小計	957,623		19,909,758.29 (1,691,533,064)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.37	164,277.30	
	A2 MILK CO LTD	7,857	6.03	47,377.71	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	6,636	32.90	218,324.40	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	14.65	80,662.90	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	22,917	4.45	102,095.23	
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.54	47,088.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	5.26	120,764.34	
	ニュージーランドドル 小計	95,365		780,589.88 (61,768,077)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	39,000	62.30	2,429,700.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	18,000	138.40	2,491,200.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	26.40	792,000.00	
	MTR CORP	19,500	43.85	855,075.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	32,000	63.20	2,022,400.00	
	SANDS CHINA LTD	31,000	33.15	1,027,650.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	8.65	17,300.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	12.94	67,288.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	27.45	603,900.00	
	WH GROUP LTD	152,000	6.74	1,024,480.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	15.90	57,240.00	

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	44,000	29.40	1,293,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	159.80	1,901,620.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	17,200	442.20	7,605,840.00	
	AIA GROUP LTD	168,200	102.20	17,190,040.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	49.95	1,998,000.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	23.40	683,280.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	19.62	529,740.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	13,916	35.05	487,755.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	40.30	1,047,800.00	
	SINO LAND CO	18,000	11.62	209,160.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	114.60	2,257,620.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	58.85	247,170.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	22.70	113,500.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	43.80	1,007,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.48	345,840.00	
	PCCW LTD	4,000	4.32	17,280.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	49.45	217,580.00	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	79.50	1,908,000.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.84	243,040.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	156,874	13.20	2,070,736.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	49.80	896,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,600	100.50	160,800.00	
	香港ドル 小計	1,074,490		53,820,435.60 (758,329,937)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.11	97,090.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.71	44,520.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	4.50	118,350.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.78	63,428.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.72	118,944.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	24,500	29.29	717,605.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	45,800	11.72	536,776.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	16,600	25.37	421,142.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	10.11	116,265.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	3.51	174,798.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.25	21,750.00	

	UOL GROUP LTD	2,100	7.16	15,036.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.10	74,210.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.32	285,592.00	
	シンガポールドル 小計	443,800		2,805,506.00 (230,107,602)	
イスラエルシ ケル	ICL GROUP LTD	4,122	22.15	91,302.30	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	441.10	168,059.10	
	BANK HAPOLIM BM	18,231	27.00	492,237.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	24.55	440,034.20	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	7,519	15.42	115,942.98	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	93.80	132,633.20	
	AZRIELI GROUP	234	230.40	53,913.60	
	NICE SYSTEMS LTD	960	742.80	713,088.00	
	イスラエルシケル 小計	50,785		2,207,210.38 (73,859,218)	
	合 計	14,640,234		76,199,161,360 (76,199,161,360)	

(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	153,384.66	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,752	304,550.16	
		AMERICAN TOWER CORP	6,152	1,518,067.52	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	146,509.11	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,949	385,824.04	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,200	238,040.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,108	135,475.16	
		CROWN CASTLE INTL CORP	6,024	1,091,006.64	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	3,602	536,265.76	
		DUKE REALTY CORP	5,513	247,809.35	
		EQUINIX INC	1,170	844,763.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	169,145.10	



	EQUITY RESIDENTIAL	5,175	383,312.25
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	970	279,718.90
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,920	277,689.60
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	251,606.48
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	181,843.69
	INVITATION HOMES INC	7,683	269,750.13
	IRON MOUNTAIN INC	4,068	172,890.00
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	5,932	123,504.24
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,702	266,788.50
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	83,437.30
	PROLOGIS INC	10,311	1,182,156.15
	PUBLIC STORAGE	2,131	582,721.95
	REALTY INCOME CORP	4,769	311,606.46
	REGENCY CENTERS CORP	1,514	96,547.78
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,510	435,816.20
	SIMON PROPERTY GROUP INC	4,258	520,242.44
	SUN COMMUNITIES INC	1,389	226,837.59
	UDR INC	3,355	155,638.45
	VENTAS INC	5,547	303,088.08
	VEREIT INC	2,220	100,055.40
	VICI PROPERTIES INC	7,940	245,107.80
	VORNADO REALTY TRUST	1,259	57,095.65
	WELLTOWER INC	5,753	421,234.66
	WEYERHAEUSER CO	10,330	395,742.30
	WP CAREY INC	2,436	179,411.40
	米ドル 小計	169,000	13,274,684.30 (1,452,914,196)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	54,834.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	32,145.30
	カナダドル 小計	2,480	86,979.30 (7,853,360)
ユーロ	COVIVIO	522	39,943.44
	GECINA SA	569	73,401.00
	KLEPIERRE	1,289	29,827.46
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	159,555.95

		ユーロ 小計	4,661	302,727.85 (40,193,176)
英ポンド		BRITISH LAND CO PLC	13,842	72,836.60
		LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	48,211.29
		SEGREO PLC	18,596	185,774.04
		英ポンド 小計	39,086	306,821.93 (47,321,146)
オーストラリアドル		DEXUS	13,745	140,336.45
		GOODMAN GROUP	23,275	436,639.00
		GPT GROUP	32,860	151,484.60
		MIRVAC GROUP	63,099	172,891.26
		SCENTRE GROUP	83,252	223,115.36
		STOCKLAND	29,890	138,091.80
		VICINITY CENTRES	42,168	64,517.04
		オーストラリアドル 小計	288,289	1,327,075.51 (112,748,335)
香港ドル		LINK REIT	31,300	2,291,160.00
		香港ドル 小計	31,300	2,291,160.00 (32,282,444)
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	41,300	118,531.00
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	147,578.40
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	45,540.00
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	73,150.00
		SUNTEC REIT	8,500	12,155.00
		シンガポールドル 小計	185,460	396,954.40 (32,558,199)
		合計		1,725,870,856 (1,725,870,856)

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

#### 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
----	-----	--------------	----------------	----------------

米ドル	株式	591銘柄	97.4%		69.8%
	投資証券	37銘柄		2.6%	1.9%
カナダドル	株式	87銘柄	99.7%		3.6%
	投資証券	2銘柄		0.3%	0.0%
ユーロ	株式	234銘柄	99.5%		10.8%
	投資証券	4銘柄		0.5%	0.1%
英ポンド	株式	86銘柄	98.7%		4.7%
	投資証券	3銘柄		1.3%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式	38銘柄	100.0%		1.2%
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	57銘柄	93.8%		2.2%
	投資証券	7銘柄		6.2%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	33銘柄	95.9%		1.0%
	投資証券	1銘柄		4.1%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	87.6%		0.3%
	投資証券	5銘柄		12.4%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 5月17日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	2,088,115,138
コール・ローン	74,937,087
株式	11,461,934,429
投資証券	11,450,872
派生商品評価勘定	2,709,553
未収入金	82,029
未収配当金	9,185,487
差入委託証拠金	1,029,229,711
流動資産合計	14,677,644,306
資産合計	14,677,644,306
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	42,916,856
未払解約金	130,593,000
未払利息	203
流動負債合計	173,510,059
負債合計	173,510,059
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	8,786,523,443
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,717,610,804
元本等合計	14,504,134,247
純資産合計	14,504,134,247
負債純資産合計	14,677,644,306

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	6,306,192,788円
期中追加設定元本額	6,228,019,135円
期中一部解約元本額	3,747,688,480円
期末元本額	8,786,523,443円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	548,502,929円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	959,642,777円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,093,194,458円
DCりそな グローバルバランス	9,913,302円
つみたてバランスファンド	413,402,511円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	248,362,759円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	131,293,639円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	82,263,342円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,117,649円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,372,148円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,541,681円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	9,756,551円
リスクコントロール・オープン	8,420,316円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	114,533,304円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	192,021,676円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,144,090,391円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,290,929,048円
Smart-i 8資産バランス 安定型	44,531,285円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	108,181,726円
Smart-i 8資産バランス 成長型	122,329,534円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	286,001,745円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	321,722,386円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	190,262,573円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	125,847,042円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	259,495,194円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	43,713,470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）	1,080,007円
2. 計算日における受益権の総数	8,786,523,443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	1.6507円
(10,000口当たり純資産額)	(16,507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 5月17日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

( 関連当事者との取引に関する注記 )

2021年 5月17日現在

該当事項はありません。

( 重要な後発事象に関する注記 )

該当事項はありません。

( その他の注記 )

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		734,948,816
投資証券		1,432,924
合計		733,515,892

(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 5月17日現在 )

( 単位 : 円 )

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
				うち1年超	
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,028,963,080	-	2,988,667,968	40,295,112
合計		3,028,963,080	-	2,988,667,968	40,295,112

## (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 5月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	14,878,310	-	14,855,287	23,023
	米ドル	14,878,310	-	14,855,287	23,023
	売建	107,450,218	-	107,339,386	110,832
	米ドル	107,370,540	-	107,259,734	110,806
	マレーシアリン ギット	43,602	-	43,599	3
	オフショア人民元	36,076	-	36,053	23
合計		122,328,528	-	122,194,673	87,809

## (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	77,193	6.69	516,884.32	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	5,418	81.86	443,517.48	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,183	185.20	219,091.60	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	14,941	7.32	109,457.76	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	9,089	4.77	43,354.53	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,026	40.60	122,855.60	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	4.47	8,493.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	11.72	37,421.96	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	8,276	37.01	306,294.76	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	1,840	36.02	66,276.80	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	18.39	43,142.94	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	875	101.00	88,375.00	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	23.88	76,416.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,085	76.30	82,785.50	
	51JOB INC-ADR	300	71.89	21,567.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	5,600	30.83	172,648.00	
	LI AUTO INC - ADR	2,300	18.35	42,205.00	
	NIO INC - ADR	16,900	33.42	564,798.00	
	XPENG INC - ADR	2,200	25.70	56,540.00	
	GSX TECHEDU INC- ADR	1,000	22.74	22,740.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,200	56.50	124,300.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	20,500	12.20	250,100.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	5,000	48.74	243,700.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	5,350	63.12	337,692.00	
	AUTOHOME INC-ADR	820	90.66	74,341.20	
	BAIDU INC - SPON ADR	3,550	186.21	661,045.50	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,100	96.87	203,427.00	
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	7.84	12,544.00		
HUYA INC-ADR	900	15.58	14,022.00		
IQIYI INC-ADR	3,700	12.84	47,508.00		
JOYY INC	720	87.57	63,050.40		
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	20.32	34,361.12		

MOMO INC-SPON ADR	1,950	13.95	27,202.50	
NETEASE INC-ADR	5,510	105.34	580,423.40	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	4,600	15.21	69,966.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	630	48.91	30,813.30	
YANDEX NV-A	4,000	63.43	253,720.00	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	24,830	209.51	5,202,133.30	
BAOZUN INC-SPN ADR	900	32.26	29,034.00	
JD.COM INC-ADR	11,420	68.15	778,273.00	
PINDUODUO INC-ADR	5,100	118.33	603,483.00	
TRIP.COM GROUP LTD	6,450	37.51	241,939.50	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	6,100	25.24	153,964.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,497	14.60	65,656.20	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	31.62	59,413.98	
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	1,600	10.97	17,552.00	
BEIGENE LTD-ADR	600	319.61	191,766.00	
HUTCHMED CHINA-ADR	900	25.81	23,229.00	
ZAI LAB LTD-ADR	1,000	152.93	152,930.00	
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	18,976	3.66	69,452.16	
CREDICORP LTD	844	145.78	123,038.32	
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	35,132	16.30	572,827.26	
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	1,523	62.60	95,339.80	
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.32	29,307.25	
LUFAX HOLDING LTD	2,100	11.60	24,360.00	
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	43.21	21,605.00	
KE HOLDINGS INC	1,600	50.00	80,000.00	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.89	9,061.92	
21VIANET GROUP INC-ADR	1,100	25.77	28,347.00	
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,200	74.53	89,436.00	
GLOBANT SA	521	214.96	111,994.16	
KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	700	37.65	26,355.00	
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	5,600	8.89	49,784.00	
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	870	5.15	4,480.50	
DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	700	71.73	50,211.00	
米ドル 小計	395,510		14,978,055.02	(1,639,348,121)

メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	189,600	16.62	3,151,152.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	40,100	100.58	4,033,258.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	275.59	509,841.50	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	56.93	808,406.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	57.66	426,684.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	5,100	226.54	1,155,354.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	371.53	1,125,735.90	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	154.09	423,747.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	33,900	50.42	1,709,238.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	74.00	162,800.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	70,200	62.08	4,358,016.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	4,800	108.87	522,576.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	47.49	251,697.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	97.12	752,194.40	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	26,100	163.94	4,278,834.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	206.82	590,471.10	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	20,400	39.01	795,804.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	16,500	35.15	579,975.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	34,800	123.26	4,289,448.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	30,800	19.23	592,284.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	452,000	14.67	6,630,840.00		
TELESITES SAB DE CV	19,700	18.66	367,602.00		
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	6,200	87.68	543,616.00		
	メキシコペソ 小計	997,530		38,059,574.40	(209,110,719)
ブラジルリアル	COSAN SA	14,000	22.34	312,760.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	49,500	25.64	1,269,180.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	63,200	26.28	1,660,896.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	19.96	207,584.00	
	BRADESPAR SA -PREF	3,300	71.02	234,366.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	47.00	465,300.00	
	GERDAU SA-PREF	15,200	34.61	526,072.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,200	26.90	274,380.00	
	SUZANO SA	10,207	65.15	664,986.05	
	VALE SA	48,800	110.56	5,395,328.00	

WEG SA	21,700	32.10	696,570.00	
CCR SA	13,400	13.38	179,292.00	
LOCALIZA RENT A CAR	8,010	58.79	470,907.90	
RUMO SA	17,100	20.95	358,245.00	
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	45.70	123,390.00	
B2W CIA DIGITAL	2,800	59.31	166,068.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	11,200	19.44	217,728.00	
LOJAS RENNER S.A.	9,800	43.75	428,750.00	
MAGAZINE LUIZA SA	39,000	19.15	746,850.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	9,600	24.91	239,136.00	
VIA VAREJO SA	15,900	12.13	192,867.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	3,000	20.57	61,710.00	
RAIA DROGASIL SA	14,000	25.88	362,320.00	
AMBEV SA	63,100	17.18	1,084,058.00	
BRF SA	5,900	20.91	123,369.00	
JBS SA	13,600	30.72	417,792.00	
NATURA &CO HOLDING SA	12,000	49.34	592,080.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	14.74	253,528.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	6,700	81.62	546,854.00	
HYPERA SA	4,000	33.73	134,920.00	
BANCO BRADESCO S.A.	19,932	21.75	433,521.00	
BANCO BRADESCO SA-PREF	64,779	24.89	1,612,349.31	
BANCO DO BRASIL S.A.	10,700	31.16	333,412.00	
BANCO INTER SA-UNITS	1,200	181.20	217,440.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	4,400	39.30	172,920.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	64,200	29.00	1,861,800.00	
ITAUSA SA	59,400	10.64	632,016.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	26,600	53.55	1,424,430.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	3,400	112.30	381,820.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	23.35	228,830.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	4,621	33.24	153,602.04	
TOTVS SA	7,200	31.01	223,272.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	5,600	42.99	240,744.00	
TIM SA	9,000	12.22	109,980.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	39.86	135,524.00	

	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	39.84	195,216.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	15,742	12.18	191,737.56	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	5.83	64,130.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	42.25	211,250.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	28.37	65,251.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	45.25	90,500.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	40.08	91,182.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,900	25.30	301,070.00	
	ブラジルリアル 小計	874,766		27,779,283.86	(576,575,704)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	8,000.00	45,560,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	2,004.80	29,717,150.40	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	1,812	36,690.00	66,482,280.00	
	FALABELLA SA	10,992	3,400.00	37,372,800.00	
	CENCOSUD SA	18,824	1,526.60	28,736,718.40	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	6,560.00	11,381,600.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	2,850	1,659.00	4,728,150.00	
	BANCO DE CHILE	601,649	76.00	45,725,324.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	594	35,401.00	21,028,194.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	40.60	39,045,994.40	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,370.00	7,130,850.00	
	COLBUN SA	83,944	114.00	9,569,616.00	
	ENEL AMERICAS SA	283,665	103.40	29,330,961.00	
	ENEL CHILE SA	369,172	50.99	18,824,080.28	
	チリペソ 小計	2,362,684		394,633,718.48	(61,662,307)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,387.00	169,534,288.00	
	BANCOLOMBIA SA	2,542	28,960.00	73,616,320.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	5,980	29,300.00	175,214,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	19,780.00	51,190,640.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	21,500.00	142,824,500.00	
	コロンビアペソ 小計	88,777		612,379,748.00	(18,182,779)
ユーロ	OPAP SA	2,135	12.45	26,580.75	
	JUMBO SA	1,515	16.56	25,088.40	

	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	14.70	48,392.40	
	ユーロ 小計	6,942		100,061.55	(13,285,171)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	3,050	15.99	48,769.50	
	英ポンド 小計	3,050		48,769.50	(7,521,719)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	98.60	173,043.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	19.99	454,592.59	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	14.85	117,463.50	
	KOC HOLDING AS	8,691	19.08	165,824.28	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	7.67	130,390.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	5,500	13.39	73,645.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	531	177.00	93,987.00	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	5,969	64.85	387,089.65	
	AKBANK T.A.S.	43,035	5.03	216,466.05	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	7.68	243,617.28	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	5.02	125,695.78	
	YAPI VE KREDI BANKASI	29,612	2.11	62,481.32	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	12,059	8.36	100,813.24	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	15.20	290,183.20	
	トルコリラ 小計	230,654		2,635,291.89	(34,175,782)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	749	686.00	513,814.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	76.30	537,533.50	
	CEZ AS	2,147	609.50	1,308,596.50	
	チェココルナ 小計	9,941		2,359,944.00	(12,308,523)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,284.00	12,399,836.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	8,445.00	17,109,570.00	
	OTP BANK PLC	2,819	14,600.00	41,157,400.00	
	ハンガリーフォリント 小計	10,274		70,666,806.00	(26,414,969)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,010	76.46	306,604.60	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	26,615	6.26	166,769.59	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	1,815	212.00	384,780.00	

	LPP SA	19	10,470.00	198,930.00	
	CD PROJEKT SA	857	164.88	141,302.16	
	CYFROWY POLSAT SA	3,192	29.00	92,568.00	
	ALLEGRO.EU SA	4,700	52.40	246,280.00	
	DINO POLSKA SA	707	271.40	191,879.80	
	BANK PEKAO SA	2,676	85.22	228,048.72	
	PKO BANK POLSKI SA	11,255	34.44	387,622.20	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	229.10	123,255.80	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	7,829	34.40	269,317.60	
	ORANGE POLSKA SA	4,699	6.71	31,553.78	
	PGE SA	9,929	9.61	95,417.69	
	ポーランドズロチ 小計	78,841		2,864,329.94	(83,964,967)
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	87,400	44.79	3,914,646.00	
	ALROSA PJSC	32,550	113.50	3,694,425.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	16,150	174.45	2,817,367.50	
	INTER RAO UES PJSC	423,000	5.06	2,142,495.00	
	ロシアルーブル 小計	559,100		12,568,933.50	(18,476,332)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	7.68	215,040.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	330,000	4.03	1,329,900.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	43,000	17.22	740,460.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	268,000	3.10	830,800.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	14,000	10.06	140,840.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	4.37	288,420.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	17,500	46.35	811,125.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	26,000	12.26	318,760.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	5.18	248,640.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	48,000	10.54	505,920.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	8.47	304,920.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	15,000	18.20	273,000.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	7.18	157,960.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	20,000	12.48	249,600.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	15.84	150,480.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	7.87	102,310.00	

ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	74,000	11.70	865,800.00	
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	5.05	222,200.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	68.10	238,350.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.25	91,000.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	21,000	37.00	777,000.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	13,000	18.00	234,000.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	44,000	4.18	183,920.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	5.63	168,900.00	
CITIC LTD	77,000	8.66	666,820.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	34,500	11.76	405,720.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	8,000	30.10	240,800.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	8,000	18.14	145,120.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	26,000	16.60	431,600.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	11.96	153,088.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	6,700	34.90	233,830.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	9.13	178,948.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	7,250	35.25	255,562.50	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	41,000	4.72	193,520.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	19,000	75.15	1,427,850.00	
EVER SUNSHINE LIFESTYLE SERV	8,000	18.60	148,800.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	11.54	230,800.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	6.10	183,000.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	20,000	5.57	111,400.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	18,000	12.48	224,640.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	5.14	133,640.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	39,000	16.14	629,460.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	18,000	6.63	119,340.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	9.20	184,000.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	15,500	13.48	208,940.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.67	120,060.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	10,500	143.80	1,509,900.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	32,000	7.11	227,520.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	7,600	42.40	322,240.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	77,000	17.58	1,353,660.00	



GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	43,000	17.68	760,240.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	40,000	6.71	268,400.00	
MINTH GROUP LTD	10,000	29.00	290,000.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	16,000	15.98	255,680.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	14,000	138.30	1,936,200.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	3.94	212,760.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	25,800	29.70	766,260.00	
LI NING CO LTD	28,500	64.30	1,832,550.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	11,300	174.90	1,976,370.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	17.14	102,840.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	11,000	17.78	195,580.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	12,000	7.07	84,840.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	10,000	43.90	439,000.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	8,000	29.55	236,400.00	
KOOLEARN TECHNOLOGY HOLDING	2,500	12.28	30,700.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	140,000	1.01	141,400.00	
CHINA LITERATURE LTD	4,200	75.30	316,260.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	2,700	221.80	598,860.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	75,400	583.00	43,958,200.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	39.00	312,000.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	1.20	166,800.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	3,700	106.70	394,790.00	
MEITUAN	47,200	244.00	11,516,800.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	17.50	252,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	14,000	11.58	162,120.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	8,000	59.30	474,400.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	5.95	187,425.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	104.04	114,444.00	
CHINA FEIHE LTD	16,000	22.15	354,400.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	37,000	42.70	1,579,900.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	20,000	65.80	1,316,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.70	143,350.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	4,400	38.05	167,420.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	8,000	51.40	411,200.00	
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	26,000	14.22	369,720.00	

TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	6,000	78.75	472,500.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	15,000	8.50	127,500.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.77	415,440.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	6,000	70.70	424,200.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	9,000	50.50	454,500.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	4,000	24.85	99,400.00
AK MEDICAL HOLDINGS LTD	4,000	13.34	53,360.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	54,000	21.30	1,150,200.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	20.55	411,000.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	11,000	57.45	631,950.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	87.65	631,080.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	32,000	18.16	581,120.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	16.76	189,388.00
SINOPHARM GROUP CO-H	17,600	25.60	450,560.00
3SBIO INC	13,000	7.69	99,970.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,000	330.40	330,400.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	16,000	17.50	280,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	11,000	5.08	55,880.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	24,000	4.50	108,000.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	124,000	10.90	1,351,600.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	23.90	430,200.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	148.10	281,390.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	16,000	30.05	480,800.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	13,500	84.35	1,138,725.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	168.90	354,690.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	6,000	59.35	356,100.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	142,250	8.49	1,207,702.50
SSY GROUP LTD	10,000	5.11	51,100.00
WUXI APPTec CO LTD-H	3,624	175.20	634,924.80
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	42,500	105.50	4,483,750.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	3.06	1,175,040.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,059,000	3.13	3,314,670.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	111,000	5.11	567,210.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	3.32	131,140.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	115,000	4.20	483,000.00

CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,273,000	6.23	7,930,790.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	3.27	153,690.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	51,000	66.15	3,373,650.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	4.19	314,669.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.47	62,460.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	810,000	4.99	4,041,900.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.29	661,250.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	105,000	1.60	168,000.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	9.32	130,480.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.80	268,800.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.02	105,060.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	17,600	20.20	355,520.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	28,500	20.65	588,525.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.41	243,890.00
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	10.98	171,288.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	7.18	313,048.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	17,400	11.34	197,316.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	100,000	15.90	1,590,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	37,800	28.00	1,058,400.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	14.20	346,480.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	10,700	30.00	321,000.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.74	345,240.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	86,000	7.59	652,740.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	78,500	81.20	6,374,200.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	5,200	40.95	212,940.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	12.08	217,440.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	14,000	8.12	113,680.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	12.48	299,520.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	74,000	2.76	204,240.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	53,500	18.48	988,680.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	15,000	7.83	117,450.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	44,000	35.50	1,562,000.00
CHINA VANKE CO LTD-H	22,100	26.30	581,230.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	42,000	6.53	274,260.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	106,000	9.35	991,100.00

GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	8.82	132,300.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	9.97	263,208.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	8,000	31.75	254,000.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	3.49	129,130.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	14,000	11.40	159,600.00	
LOGAN GROUP CO LTD	19,000	11.80	224,200.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	25,000	45.15	1,128,750.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	1,200	57.75	69,300.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	24,000	8.06	193,440.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.65	137,800.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	16,000	21.10	337,600.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	36,000	29.10	1,047,600.00	
WHARF HOLDINGS LTD	20,000	23.65	473,000.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	104,000	1.79	186,160.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	12,000	5.06	60,720.00	
CHINA YOUZAN LTD	180,000	1.61	289,800.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	34,000	23.75	807,500.00	
KINGSOFT CORP LTD	10,000	56.20	562,000.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	5,000	35.70	178,500.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	15.86	206,180.00	
WEIMOB INC	21,000	15.54	326,340.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	9,500	42.55	404,225.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	9,000	37.85	340,650.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	9,500	44.05	418,475.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	17.24	284,460.00	
LENOVO GROUP LTD	92,000	9.09	836,280.00	
SUNNY OPTICAL TECH	9,700	168.50	1,634,450.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	188,000	25.85	4,859,800.00	
ZTE CORP-H	8,800	19.18	168,784.00	
CHINA TOWER CORP LTD-H	614,000	1.09	669,260.00	
BEIJING ENTERPRISES HLDGS	6,000	26.65	159,900.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	58,000	2.99	173,420.00	
CGN POWER CO LTD-H	110,000	1.82	200,200.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	40,400	26.90	1,086,760.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	41,000	9.88	405,080.00	

	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.78	105,020.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	12,000	46.00	552,000.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	26,000	10.08	262,080.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	10,900	137.80	1,502,020.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	38,000	11.38	432,440.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	2.78	144,560.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	52,000	8.72	453,440.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	8,000	40.00	320,000.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	52,000	11.10	577,200.00	
	香港ドル 小計	11,165,524		173,960,170.80 (2,451,098,806)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	50,000	3.00	150,000.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	2,900	19.10	55,390.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	30,700	8.10	248,670.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	33,400	5.40	180,360.00	
	GAMUDA BHD	21,000	3.30	69,300.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	7.98	60,648.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.23	73,813.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.42	69,918.00	
	MISC BHD	17,600	6.73	118,448.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	6,800	4.38	29,784.00	
	GENTING BHD	32,900	4.80	157,920.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	32,600	2.77	90,302.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	28.80	60,480.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	3,000	8.89	26,670.00	
	IOI CORP BHD	32,500	4.12	133,900.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	22.50	144,000.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	136.00	136,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	8,220	18.66	153,385.20	
	QL RESOURCES BHD	17,150	6.01	103,071.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	4.56	138,624.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	9.53	225,861.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.45	173,310.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	4.24	70,384.00	
	SUPERMAX CORP BHD	19,217	4.77	91,665.09	

	TOP GLOVE CORP BHD	66,500	5.35	355,775.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	2.94	68,796.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	80,200	4.18	335,236.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	7,200	17.70	127,440.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	16.88	30,384.00	
	MALAYAN BANKING BHD	53,700	8.21	440,877.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	195,500	4.14	809,370.00	
	RHB BANK BHD	18,100	5.27	95,387.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	30,400	3.71	112,784.00	
	DIGI.COM BHD	39,700	4.20	166,740.00	
	MAXIS BHD	30,200	4.53	136,806.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.64	103,776.00	
	PETRONAS GAS BHD	10,400	15.80	164,320.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	29,400	9.87	290,178.00	
	マレーシアリングット 小計	1,078,487		5,999,772.79	(158,771,387)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	20,000	119.00	2,380,000.00	
	PTT PCL-NVDR	154,400	40.25	6,214,600.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	58.50	772,200.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	16,500	46.50	767,250.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	67.50	2,214,000.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	10,800	464.00	5,011,200.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	59,300	59.75	3,543,175.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	7.55	675,725.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	8.60	907,300.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.64	288,608.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	29.50	1,433,700.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	20,625	32.00	660,000.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	13.50	1,189,350.00	
	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	40,000	28.50	1,140,000.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	33.25	548,625.00	
	CP ALL PCL-NVDR	79,400	57.25	4,545,650.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	28.50	1,615,950.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	6,500	35.00	227,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	18.50	899,100.00	

	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	132,600	21.10	2,797,860.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	127.00	762,000.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	47.50	636,500.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	116.00	904,800.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	21,300	121.00	2,577,300.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.80	270,000.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	9,900	98.50	975,150.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	18.10	331,230.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	8,200	70.75	580,150.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	57.00	433,200.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	71.50	643,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	50.75	1,492,050.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	96,400	7.75	747,100.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	4,400	480.00	2,112,000.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	16,600	169.50	2,813,700.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	64.00	1,830,400.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	9,700	31.25	303,125.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.08	262,108.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	40.25	382,375.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	171.50	686,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	17,900	59.75	1,069,525.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	7,300	69.50	507,350.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	32,200	32.75	1,054,550.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	50.25	562,800.00	
	タイパーツ 小計	1,580,625		59,768,706.00	(207,995,096)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	35.80	836,288.00	
	AYALA CORPORATION	3,790	725.00	2,747,750.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	528.00	823,680.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	40,131	49.50	1,986,484.50	
	SM INVESTMENTS CORP	3,185	963.50	3,068,747.50	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	11,700	138.00	1,614,600.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	168.00	1,167,600.00	
	PUREGOLD PRICE CLUB INC	9,500	31.65	300,675.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	9,090	136.00	1,236,240.00	

	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	82.15	2,169,581.50	
	BDO UNIBANK INC	28,100	106.00	2,978,600.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	44.50	1,228,734.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.66	530,700.00	
	AYALA LAND INC	105,400	31.20	3,288,480.00	
	MEGAWORLD CORP	98,000	2.60	254,800.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	128,800	33.00	4,250,400.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	1,811.00	814,950.00	
	PLDT INC	980	1,270.00	1,244,600.00	
	ABOITIZ POWER CORP	16,000	22.05	352,800.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	274.00	860,360.00	
	フィリピンベソ 小計	689,158		31,756,070.50 (72,699,172)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,195.00	180,325,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	21,450.00	474,045,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	111,500	2,670.00	297,705,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	925.00	349,187,500.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	26,900	10,100.00	271,690,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	12,450.00	288,840,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,710.00	434,955,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	32,200	9,925.00	319,585,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	250,800	5,225.00	1,310,430,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	108,300	6,675.00	722,902,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	35,050.00	231,330,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	8,525.00	278,767,500.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	48,200	6,575.00	316,915,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	5,625.00	566,437,500.00	
	KALBE FARMA TBK PT	226,500	1,445.00	327,292,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	132,200	32,400.00	4,283,280,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	230,800	5,900.00	1,361,720,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	5,525.00	582,887,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	740,200	3,990.00	2,953,398,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,185.00	411,550,500.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	665,000	3,180.00	2,114,700,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	131,500	1,215.00	159,772,500.00	



	インドネシアルピア 小計	4,031,100		18,237,716,500.00 (140,430,417)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	490	48,250.00	23,642,500.00	
	S-OIL CORP	483	96,100.00	46,416,300.00	
	SK INNOVATION CO LTD	750	269,000.00	201,750,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,444	44,050.00	63,608,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,255	55,900.00	70,154,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	121	459,000.00	55,539,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	218	244,000.00	53,192,000.00	
	LG CHEM LTD	607	854,000.00	518,378,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	88	407,000.00	35,816,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	239	282,500.00	67,517,500.00	
	POSCO	989	380,000.00	375,820,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	286	146,500.00	41,899,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	254,500.00	27,995,000.00	
	CJ CORP	193	107,500.00	20,747,500.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	36,400.00	18,709,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	580	49,300.00	28,594,000.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	2,846	12,300.00	35,005,800.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	43,450.00	36,454,550.00	
	HANWHA CORPORATION	800	31,800.00	25,440,000.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	868	51,900.00	45,049,200.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	550	73,400.00	40,370,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	31,250.00	31,250,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	148,500.00	82,714,500.00	
	LG CORP	1,224	126,500.00	154,836,000.00	
	LOTTE CORP	242	37,450.00	9,062,900.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,073	140,000.00	150,220,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	19,000.00	45,695,000.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	5,840.00	40,336,880.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	454	270,000.00	122,580,000.00	
	S-1 CORPORATION	228	79,900.00	18,217,200.00	
CJ LOGISTICS	135	170,000.00	22,950,000.00		
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	219	186,000.00	40,734,000.00		
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,155	29,300.00	63,141,500.00		

PAN OCEAN CO LTD	3,277	6,870.00	22,512,990.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	48,000.00	46,368,000.00	
HANON SYSTEMS	2,393	16,000.00	38,288,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	885	275,000.00	243,375,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	1,979	229,000.00	453,191,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	464	113,000.00	52,432,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	111,500.00	37,464,000.00	
KIA CORP	3,506	82,600.00	289,595,600.00	
COWAY CO LTD	531	78,000.00	41,418,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	53,700.00	35,119,800.00	
HLB INC	1,142	31,950.00	36,486,900.00	
LG ELECTRONICS INC	1,352	148,500.00	200,772,000.00	
KANGWON LAND INC	1,387	25,950.00	35,992,650.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	23,000.00	24,150,000.00	
KAKAO CORP	3,800	109,000.00	414,200,000.00	
NAVER CORP	1,629	342,500.00	557,932,500.00	
NCSOFT CORP	220	831,000.00	182,820,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	127,500.00	34,552,500.00	
PEARL ABYSS CORP	350	56,600.00	19,810,000.00	
CJ ENM CO LTD	113	149,300.00	16,870,900.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	92,600.00	37,688,200.00	
LOTTE SHOPPING CO	80	114,500.00	9,160,000.00	
SHINSEGAE INC	109	308,000.00	33,572,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	57	177,500.00	10,117,500.00	
E-MART INC	257	154,000.00	39,578,000.00	
GS RETAIL CO., LTD.	195	36,700.00	7,156,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	88	454,000.00	39,952,000.00	
KT&G CORP	1,569	82,300.00	129,128,700.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	251	121,000.00	30,371,000.00	
OTTOGI CORPORATION	13	547,000.00	7,111,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	422	291,500.00	123,013,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	74,700.00	32,046,300.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	125	1,521,000.00	190,125,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	712,000.00	22,072,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	852	113,800.00	96,957,600.00	

ALTEOGEN INC	360	72,800.00	26,208,000.00
CELLTRION INC	1,291	270,500.00	349,215,500.00
CELLTRION PHARM INC	238	132,200.00	31,463,600.00
HANMI PHARM CO LTD	87	329,000.00	28,623,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	227	948,000.00	215,196,000.00
SEEGENE INC	480	82,000.00	39,360,000.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	65,600.00	26,240,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	387	110,500.00	42,763,500.00
YUHAN CORP	539	63,300.00	34,118,700.00
HANA FINANCIAL GROUP	4,027	45,900.00	184,839,300.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	2,591	10,700.00	27,723,700.00
KB FINANCIAL GROUP INC	5,250	57,600.00	302,400,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	5,544	41,200.00	228,412,800.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	11,100.00	82,284,300.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	557	106,000.00	59,042,000.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	2,317	4,880.00	11,306,960.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,302	10,100.00	43,450,200.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	13,300.00	20,482,000.00
SAMSUNG CARD CO	517	33,600.00	17,371,200.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	44,400.00	36,585,600.00
DB INSURANCE CO LTD	726	51,700.00	37,534,200.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	968	24,800.00	24,006,400.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	381	212,500.00	80,962,500.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	84,900.00	82,013,400.00
DOUZONE BIZON CO LTD	190	79,200.00	15,048,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	430	180,500.00	77,615,000.00
KMW CO LTD	357	51,800.00	18,492,600.00
LG DISPLAY CO LTD	3,338	22,000.00	73,436,000.00
LG INNOTEK CO LTD	153	195,500.00	29,911,500.00
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	724	164,500.00	119,098,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	62,558	80,100.00	5,010,895,800.00
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	10,879	73,900.00	803,958,100.00
SAMSUNG SDI CO LTD	731	626,000.00	457,606,000.00
LG UPLUS CORP	2,330	14,800.00	34,484,000.00
SK TELECOM	534	317,000.00	169,278,000.00

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	3,411	23,900.00	81,522,900.00	
	KOREA GAS CORPORATION	525	32,150.00	16,878,750.00	
	SK HYNIX INC	7,150	118,500.00	847,275,000.00	
	韓国ウォン 小計	197,301		15,992,339,780.00 (1,549,657,724)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	15,000	96.70	1,450,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	49.00	1,519,000.00	
	CHINA STEEL CORP	150,000	34.85	5,227,500.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	45,000	82.90	3,730,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	52,000	95.50	4,966,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	70,000	80.40	5,628,000.00	
	TAIWAN CEMENT	61,477	49.60	3,049,259.20	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	1,600	1,000.00	1,600,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	30.75	1,199,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	3,174	330.50	1,049,007.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	31,550	70.10	2,211,655.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	28.85	634,700.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	22,000	44.35	975,700.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	2,020	587.00	1,185,740.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	197.50	1,200,800.00	
	GIANT MANUFACTURING	4,000	322.50	1,290,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	386.50	773,000.00	
	POU CHEN	34,000	31.50	1,071,000.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	4,000	537.00	2,148,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	8,000	271.50	2,172,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	65,000	74.20	4,823,000.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	216.50	649,500.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	16.75	1,199,568.00	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	238,000	22.00	5,236,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	140,906	25.55	3,600,148.30		
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	130,627	21.70	2,834,605.90		
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	107,416	18.05	1,938,858.80		
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	149,000	31.70	4,723,300.00		
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	13.15	1,906,684.25		
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	118,769	14.20	1,686,519.80		

TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.63	767,241.36
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	118,374	20.75	2,456,260.50
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	49,000	42.65	2,089,850.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	15,997	195.50	3,127,413.50
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	125,920	24.30	3,059,856.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	99,000	51.50	5,098,500.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	176,000	12.10	2,129,600.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	23.65	659,811.35
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	84,000	69.60	5,846,400.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	9.28	1,436,868.80
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	6,600	42.80	282,480.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	51.00	483,480.00
ACCTON TECHNOLOGY CORP	7,000	271.50	1,900,500.00
ACER INC	38,000	29.35	1,115,300.00
ADVANTECH CO LTD	5,299	324.50	1,719,525.50
ASUSTEK COMPUTER INC	9,000	380.00	3,420,000.00
AU OPTRONICS CORP	122,000	21.85	2,665,700.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	9,000	178.00	1,602,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	5,015	79.10	396,686.50
COMPAL ELECTRONICS	46,000	22.70	1,044,200.00
DELTA ELECTRONICS INC	26,000	266.50	6,929,000.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	60.90	852,600.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	162,800	104.50	17,012,600.00
INNOLUX CORP	90,000	20.90	1,881,000.00
INVENTEC CORP	28,000	24.95	698,600.00
LARGAN PRECISION CO LTD	1,350	2,850.00	3,847,500.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	27,000	61.90	1,671,300.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	170.00	1,700,000.00
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	3,000	290.00	870,000.00
PEGATRON CORP	26,000	70.60	1,835,600.00
QUANTA COMPUTER INC	37,000	90.30	3,341,100.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	56.70	963,900.00
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	95.00	1,615,000.00
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	195.00	975,000.00
WISTRON CORP	29,951	29.55	885,052.05

	WIWYNN CORP	1,000	808.00	808,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	17,960	48.35	868,366.00	
	YAGEO CORPORATION	5,198	440.00	2,287,120.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	6,000	90.00	540,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	51,000	113.50	5,788,500.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	64.90	1,557,600.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	21,000	99.70	2,093,700.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	41,000	105.00	4,305,000.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,100.00	550,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	715.00	2,145,000.00	
	MEDIATEK INC	20,000	895.00	17,900,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	73.00	1,241,000.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	7,000	480.00	3,360,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	450.00	900,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	100.00	1,000,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	6,000	451.50	2,709,000.00	
	SILERGY CORP	1,000	2,700.00	2,700,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	322,700	557.00	179,743,900.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	155,000	46.80	7,254,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	105.50	1,266,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	4,000	302.50	1,210,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	28.45	1,194,900.00	
	新台湾ドル 小計	4,224,780		399,481,807.81 (1,563,811,484)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	11,598	442.25	5,129,215.50	
	COAL INDIA LTD	16,101	146.80	2,363,626.80	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	254.40	2,063,692.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	101.05	2,473,097.70	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	37,490	112.95	4,234,495.50	
	PETRONET LNG LTD	7,875	242.40	1,908,900.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	37,549	1,937.30	72,743,677.70	
	ACC LTD	1,105	1,876.80	2,073,864.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	7,740	307.10	2,376,954.00	
	ASIAN PAINTS LTD	5,129	2,774.50	14,230,410.50	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	2,639	752.75	1,986,507.25	

GRASIM INDUSTRIES LTD	3,232	1,367.00	4,418,144.00
HINDALCO INDUSTRIES LTD	21,528	382.80	8,240,918.40
JSW STEEL LTD	9,306	707.10	6,580,272.60
PI INDUSTRIES LTD	1,184	2,697.45	3,193,780.80
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	1,888.25	4,020,084.25
SHREE CEMENT LTD	150	26,713.60	4,007,040.00
TATA STEEL LTD	9,239	1,132.10	10,459,471.90
ULTRATECH CEMENT LTD	1,426	6,368.10	9,080,910.60
UPL LTD	5,324	743.30	3,957,329.20
VEDANTA LTD	14,486	272.40	3,945,986.40
HAVELLS INDIA LTD	2,780	997.55	2,773,189.00
LARSEN & TOUBRO LTD	8,999	1,415.50	12,738,084.50
SIEMENS LTD	766	1,993.00	1,526,638.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	6,672	733.55	4,894,245.60
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	572.75	2,352,857.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,694.75	2,201,480.25
BAJAJ AUTO LTD	881	3,848.80	3,390,792.80
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	1,896.10	2,303,761.50
BHARAT FORGE LTD	3,030	648.25	1,964,197.50
EICHER MOTORS LTD	1,839	2,415.20	4,441,552.80
HERO MOTOCORP LTD	1,613	2,812.35	4,536,320.55
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	10,773	741.50	7,988,179.50
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	1,802	6,736.40	12,138,992.80
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	12,820	228.45	2,928,729.00
MRF LTD	27	76,135.75	2,055,665.25
TATA MOTORS LTD	22,991	312.25	7,178,939.75
PAGE INDUSTRIES LTD	54	28,033.70	1,513,819.80
TITAN CO LTD	4,773	1,455.85	6,948,772.05
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	2,805.25	3,144,685.25
INFO EDGE INDIA LTD	964	4,291.65	4,137,150.60
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	9,317	191.60	1,785,137.20
TRENT LTD	2,541	772.60	1,963,176.60
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,002	2,844.65	5,694,989.30
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,464	3,501.45	5,126,122.80
ITC LTD	39,545	212.25	8,393,426.25

NESTLE INDIA LTD	452	17,224.15	7,785,315.80
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	8,154	645.15	5,260,553.10
UNITED SPIRITS LTD	3,058	565.30	1,728,687.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,566.95	2,640,310.75
DABUR INDIA LTD	7,196	535.00	3,849,860.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	851.80	4,582,684.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	10,853	2,376.85	25,795,953.05
MARICO LTD	7,098	474.55	3,368,355.90
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,300	3,140.95	4,083,235.00
AUROBINDO PHARMA LTD	3,700	1,006.70	3,724,790.00
BIOCON LTD	5,970	388.80	2,321,136.00
CIPLA LTD	6,268	904.05	5,666,585.40
DIVI'S LABORATORIES LTD	1,884	4,020.55	7,574,716.20
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,471	5,196.85	7,644,566.35
IPCA LABORATORIES LTD	1,001	2,148.85	2,150,998.85
LUPIN LTD	2,363	1,178.45	2,784,677.35
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	10,895	691.45	7,533,347.75
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	480	2,722.30	1,306,704.00
AXIS BANK LTD	29,968	685.00	20,528,080.00
BANDHAN BANK LTD	9,895	280.55	2,776,042.25
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	22,428	2,422.00	54,320,616.00
ICICI BANK LTD	67,302	597.30	40,199,484.60
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	7,353	1,706.65	12,548,997.45
STATE BANK OF INDIA	22,200	360.45	8,001,990.00
YES BANK LTD	141,484	13.20	1,867,588.80
BAJAJ FINANCE LTD	3,495	5,330.35	18,629,573.25
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,799.45	1,987,609.50
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,167.95	2,118,661.30
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,198	1,633.65	1,957,112.70
REC LTD	14,000	139.00	1,946,000.00
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,326.50	3,630,630.50
BAJAJ FINSERV LTD	521	10,971.50	5,716,151.50
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	10,185	670.60	6,830,061.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	2,586	1,473.10	3,809,436.60
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	3,727	560.15	2,087,679.05



	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	4,992	978.40	4,884,172.80	
	DLF LTD	9,206	250.55	2,306,563.30	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	14,482	910.35	13,183,688.70	
	INFOSYS LTD	44,914	1,316.40	59,124,789.60	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	3,598.35	2,691,565.80	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	12,388	3,051.50	37,801,982.00	
	TECH MAHINDRA LTD	8,467	952.20	8,062,277.40	
	WIPRO LTD	14,289	498.45	7,122,352.05	
	BHARTI AIRTEL LTD	31,858	560.40	17,853,223.20	
	INDUS TOWERS LTD	8,128	244.35	1,986,076.80	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	4,900	1,088.05	5,331,445.00	
	GAIL INDIA LTD	24,471	152.70	3,736,721.70	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	511.65	2,412,941.40	
	NTPC LTD	56,698	111.40	6,316,157.20	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	29,117	228.85	6,663,425.45	
	インドルピー 小計	1,061,397		751,844,859.35 (1,127,767,289)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	18.18	116,352.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.15	116,895.90	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	48,600	1.92	93,457.80	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	13.45	321,629.85	
	COMMERCIAL BANK PQSC	21,760	5.39	117,329.92	
	MASRAF AL RAYAN	44,940	4.47	201,061.56	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	9.40	88,237.60	
	QATAR ISLAMIC BANK	15,926	17.30	275,519.80	
	QATAR NATIONAL BANK	60,107	18.00	1,081,926.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.22	79,853.17	
	QOOREDOO QPSC	12,412	7.13	88,522.38	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	17.06	138,151.88	
	カタールリアル 小計	313,315		2,718,937.86 (81,051,537)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	2,800	161.77	452,956.00	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	278.68	456,199.16	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	677	1,770.00	1,198,290.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	5,636	332.00	1,871,152.00	

GOLD FIELDS LTD	11,992	156.34	1,874,829.28	
HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	68.48	472,169.60	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	10,024	257.72	2,583,385.28	
KUMBA IRON ORE LTD	703	685.89	482,180.67	
NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	236.71	1,178,815.80	
SASOL LTD	7,017	237.00	1,663,029.00	
SIBANYE STILLWATER LTD	35,684	63.95	2,281,991.80	
BIDVEST GROUP LTD	4,193	175.00	733,775.00	
MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	124.63	761,240.04	
MR PRICE GROUP LTD	2,802	196.51	550,621.02	
NASPERS LTD-N SHS	5,730	3,016.38	17,283,857.40	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	12,960	50.89	659,534.40	
BID CORP LTD	4,319	281.89	1,217,482.91	
CLICKS GROUP LTD	3,433	257.23	883,070.59	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	6,519	145.81	950,535.39	
SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	187.65	476,818.65	
TIGER BRANDS LTD	2,099	214.85	450,970.15	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	5,174	164.47	850,967.78	
ABSA GROUP LTD	9,806	124.70	1,222,808.20	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	941	1,580.00	1,486,780.00	
NEDBANK GROUP LTD	5,252	145.00	761,540.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	17,330	122.06	2,115,299.80	
FIRSTRAND LTD	60,842	53.28	3,241,661.76	
REINET INVESTMENTS SCA	2,213	271.09	599,922.17	
REMGRO LTD	7,030	108.49	762,684.70	
DISCOVERY LTD	5,539	144.10	798,169.90	
OLD MUTUAL LTD	59,174	12.77	755,651.98	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	32.30	323,452.20	
SANLAM LTD	21,916	58.84	1,289,537.44	
NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	96.40	575,411.60	
MTN GROUP LTD	20,781	96.05	1,996,015.05	
VODACOM GROUP LTD	7,934	125.89	998,811.26	
南アフリカランド 小計	378,664		56,261,617.98 (434,902,306)	
アラブディールハ	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	33,706	6.35	214,033.10

ム	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	5.15	104,920.95	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	4.55	93,002.00	
	EMIRATES NBD PJSC	34,921	12.35	431,274.35	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	37,331	16.06	599,535.86	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	51,017	3.57	182,130.69	
	EMAAR MALLS PJSC	30,674	1.92	58,894.08	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	3.90	191,774.70	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	21,250	21.88	464,950.00	
	アラブディルハム 小計	298,885		2,340,515.73	(69,864,394)
クウェートディ ナール	AGILITY	17,000	1.05	18,003.00	
	BOUBAYAN BANK K.S.C	14,451	0.66	9,537.66	
	GULF BANK	19,790	0.22	4,472.54	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	60,809	0.72	44,329.76	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	89,602	0.83	74,548.86	
	MABANEE CO KPSC	7,811	0.74	5,827.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	28,329	0.60	17,054.05	
	クウェートディナール 小計	237,792		173,772.87	(63,334,997)
オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,000	5.32	10,640.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	11,800	4.39	51,802.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	19.96	109,780.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	3.28	3,608.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.50	2,250.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.65	100,905.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	11.88	112,860.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	520	6.90	3,588.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	10.38	3,114.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	7.51	27,787.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	35.79	32,211.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	13.62	13,497.42	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	2,100	5.28	11,088.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	2,800	49.83	139,524.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	8.13	153,657.00	
BBMG CORPORATION-A	900	2.85	2,565.00		

BEIJING ORIENTAL YUHONG-A	1,800	55.62	100,116.00
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	17.76	42,624.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	2,900	17.31	50,199.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	6,800	5.76	39,168.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	500	20.15	10,075.00
GEM CO LTD-A	3,500	10.23	35,805.00
GUANGDONG HEC TECHNOLOGY H-A	1,400	4.87	6,818.00
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	26.78	13,390.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	62.96	74,922.40
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	3,620	27.67	100,165.40
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	12.72	24,804.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.76	4,140.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	23.18	25,498.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	7.49	26,215.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	17,900	1.69	30,251.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.87	20,545.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	10.46	19,874.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	108.08	32,424.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	300	26.56	7,968.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	102.73	113,003.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	20.33	65,056.00
LOMON BILLIONS GROUP CO -A	1,700	34.45	58,565.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.52	18,144.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	3,400	25.91	88,094.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	1,568	20.81	32,630.08
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,400	37.45	52,430.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	3.90	39,000.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	47.98	38,384.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	15.37	33,814.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	420	77.05	32,361.00
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	7.15	34,320.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	72.38	43,428.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	19.50	42,900.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.88	2,328.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	400	236.00	94,400.00

TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	14.34	15,774.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	22.44	33,660.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	2.96	4,440.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	6.22	8,086.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	2,300	103.40	237,820.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	61.23	24,492.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	18.64	22,368.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	10.61	25,251.80
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	600	126.73	76,038.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	75.31	87,359.60
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	9.32	21,436.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	400	14.27	5,708.00
ZHONGJIN GOLD CORP-A	400	9.25	3,700.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	11.06	195,762.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	20.07	20,070.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	41.90	104,750.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.08	30,240.00
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,100	69.60	76,560.00
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	2,500	25.60	64,000.00
AVICOPTER PLC-A	500	51.58	25,790.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	42.28	59,192.00
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.12	16,376.00
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	15.47	1,547.00
CHINA GEZHOUBA GROUP CO LT-A	500	7.30	3,650.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	6.50	3,250.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.55	118,770.00
CHINA SHIPBUILDINGIndustr-A	25,300	4.23	107,019.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	5.02	149,596.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	1,900	359.00	682,100.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	11.26	6,756.00
EAST GROUP CO LTD-A	3,000	6.34	19,020.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,520	96.58	146,801.60
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	8.96	3,736.32
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	31.82	31,820.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	177.65	71,060.00

HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	47.96	28,776.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	54.96	16,488.00
INNER MONGOLIA FIRST MACHI-A	1,400	10.98	15,372.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	82.09	85,045.24
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	10.11	26,286.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.16	68,888.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	3,539	29.60	104,754.40
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	4,000	3.93	15,720.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	6,200	29.08	180,296.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.94	16,464.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	800	5.14	4,112.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	1,800	81.20	146,160.00
SIASUN ROBOT & AUTOMATION-A	1,300	9.48	12,324.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	81.70	122,550.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	20.86	27,118.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	9.34	3,736.00
TBEA CO LTD-A	400	12.09	4,836.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	18.50	16,650.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	17.50	103,250.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	1,100	7.15	7,865.00
XIAMEN C & D INC-A	300	8.05	2,415.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	400	11.66	4,664.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	700	56.47	39,529.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	30.69	61,380.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	65.15	27,363.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	20.41	61,025.90
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	22.81	29,653.00
ZHENGZHOU YUTONG BUS CO -A	200	13.90	2,780.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	11.06	70,784.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.14	18,564.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	87.97	70,376.00
AIR CHINA LTD-A	800	8.56	6,848.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	10,400	5.63	58,552.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	1,300	5.26	6,838.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	6.36	57,876.00

COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	9,900	19.08	188,892.00	
DAQIN RAILWAY CO LTD -A	11,100	7.09	78,699.00	
GUANGZHOU BAIYUN INTERNATI-A	800	12.24	9,792.00	
S F HOLDING CO LTD-A	3,500	62.87	220,045.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	46.35	46,350.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	1,000	4.80	4,800.00	
SHENZHEN AIRPORT CO-A	1,900	8.22	15,618.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	5.31	10,620.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	100	61.61	6,161.00	
STO EXPRESS CO LTD-A	3,400	8.31	28,254.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	11.24	44,960.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	15.45	18,076.50	
BYD CO LTD -A	1,600	153.53	245,648.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	173.06	34,612.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	4,300	23.01	98,943.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	48.96	93,024.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	1,600	30.74	49,184.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	1,400	24.65	34,510.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	16.56	19,872.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	28.13	22,504.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	20.37	140,756.70	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	100	46.83	4,683.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	23.83	2,383.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	162.30	97,380.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	28.80	164,160.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	100	37.82	3,782.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	75.66	60,528.00	
JOYOUNG CO LTD -A	600	31.92	19,152.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	3,200	76.44	244,608.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	12.86	11,574.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	140	148.05	20,727.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	27.14	10,856.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	6,200	8.54	52,948.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	41.01	20,915.10	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	13.02	5,208.00	

ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	75.99	22,797.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	24.65	24,650.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	60.80	36,480.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	1,100	8.65	9,515.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	18.89	20,401.20	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	12.09	15,717.00	
BEIJING KUNLUN TECH CO LTD-A	800	18.58	14,864.00	
CHINA FILM CO LTD-A	200	13.05	2,610.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	10.09	2,018.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	9.90	119,790.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	437.32	43,732.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	13.75	2,750.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	2.37	9,717.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	65.16	85,359.60	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	8.99	9,889.00	
ORIENTAL PEARL GROUP CO LT-A	300	9.02	2,706.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	20.96	28,296.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	22.86	20,574.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	6.63	19,890.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,500	309.58	464,370.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	23.27	4,654.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	11.32	56,600.00	
SUNING.COM CO LTD-A	3,300	6.86	22,638.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	4.81	28,860.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	600	71.52	42,912.00	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	53.80	15,064.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	420	80.70	33,894.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	5.55	17,205.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	59.88	41,916.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	217.86	65,358.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	57.26	28,630.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	8.64	4,320.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	48.95	29,370.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	7.82	18,768.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	52.86	21,144.00	



CHONGQING BREWERY CO-A	400	170.55	68,220.00
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	39.20	27,440.00
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	2,300	173.57	399,211.00
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	230.40	92,160.00
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	24.93	22,437.00
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	82.51	107,263.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	16.37	40,925.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	37.18	89,232.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	4,200	39.27	164,934.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	53.64	53,640.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	185.72	260,008.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	13.78	27,560.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	219.28	87,712.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	47.86	14,358.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	85.67	25,701.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,000	2,009.85	2,009,850.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,000	247.80	247,800.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	2,940	99.95	293,853.00
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	15.92	41,392.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	800	434.66	347,728.00
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	100.51	40,204.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	34.18	23,926.00
TONGWEI CO LTD-A	3,300	37.40	123,420.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	100	101.89	10,189.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	14.13	79,975.80
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,200	287.00	918,400.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	900	78.97	71,073.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	17.36	19,096.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	33.45	43,485.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	31.82	31,820.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	175.25	17,525.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	56.12	33,672.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	3,521	74.72	263,089.12
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	100	118.53	11,853.00
CHINA NATIONAL ACCORD MEDI-A	200	40.57	8,114.00

CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	37.57	15,028.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	200	140.00	28,000.00
GUANGZHOU WONFO BIOTECH C-A	300	92.79	27,837.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	240	47.77	11,464.80
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	145.15	43,545.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	380	98.77	37,532.60
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	30.60	15,300.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	16.91	3,382.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	32.06	22,442.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	12.02	5,769.60
OVCTEK CHINA INC-A	300	126.49	37,947.00
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	39.50	23,700.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	200	21.07	4,214.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	700	450.17	315,119.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	100	343.90	34,390.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	15.15	15,756.00
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	28.68	25,812.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	349.75	69,950.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	33.52	36,201.60
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	102.23	30,669.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	124.98	37,494.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	516.90	206,760.00
CHENGDU KANGHONG PHARMACEU-A	600	21.00	12,600.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	25.54	2,554.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,300	216.00	280,800.00
DA AN GENE CO LTD SUN YAT-A	600	35.23	21,138.00
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	34.06	3,406.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	200	31.25	6,250.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	156.35	46,905.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	780	40.25	31,395.00
HUBEI JUMPCAN PHARMACEUT-A	700	19.06	13,342.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	29.98	41,972.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	4,180	83.83	350,409.40
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.71	15,710.00
JINYU BIO-TECHNOLOGY CO LT-A	900	21.47	19,323.00

JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	16.72	26,752.00
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	54.20	27,100.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	47.33	47,330.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	650	43.91	28,541.50
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	22.48	5,844.80
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,200	70.30	84,360.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.64	22,156.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	16.45	14,805.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	203.68	122,208.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	35.65	3,565.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,000	28.72	28,720.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	20.85	4,170.00
TIANJIN CHASE SUN PHARM-A	2,200	4.48	9,856.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	12.94	2,588.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	600	68.20	40,920.00
WUXI APPTec CO LTD-A	1,440	153.20	220,608.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	19.40	19,400.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	107.95	118,745.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	600	373.58	224,148.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	20.48	24,780.80
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	1,780	40.20	71,556.00
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	71.80	28,720.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	50,300	3.29	165,487.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.95	92,565.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	12.90	19,350.00
BANK OF CHINA LTD-A	16,300	3.29	53,627.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	27,200	4.95	134,640.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	16.70	96,860.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	3,200	7.26	23,232.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	9.86	87,754.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	42.47	212,350.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	8,810	8.42	74,180.20
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	3,000	6.98	20,940.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	3.88	135,412.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	17,300	54.98	951,154.00

CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	4.68	139,464.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	4,400	6.39	28,116.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	36,200	5.28	191,136.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	22.97	413,460.00	
PING AN BANK CO LTD-A	13,100	23.32	305,492.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	21,100	5.39	113,729.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	19,400	10.19	197,686.00	
AVIC CAPITAL CO LTD -A	900	3.98	3,582.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.83	16,245.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.54	51,272.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.50	29,400.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	10.18	30,540.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	19.50	130,650.00	
CITIC SECURITIES CO-A	8,600	25.44	218,784.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	2,500	29.92	74,800.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.85	2,170.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	8,420	34.40	289,648.00	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	16.03	51,296.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.03	3,515.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	9.41	67,752.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	15.38	90,742.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	12.77	30,648.00	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	15.44	33,968.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.15	51,290.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	17.52	120,888.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.01	4,005.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	11.63	103,507.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	115.30	57,650.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	6.31	2,524.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	16.59	91,245.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.71	2,913.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	8.58	57,486.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	9.52	15,232.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.56	25,680.00	
OCEANWIDE HOLDINGS CO LTD -A	1,200	2.91	3,492.00	

ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	9.27	48,204.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.46	11,072.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	3,600	13.60	48,960.00
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.39	10,975.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	7.04	2,816.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	15,200	4.82	73,264.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	12.38	53,234.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	8.37	2,511.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.76	18,088.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	4.94	21,242.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.64	4,320.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	12.27	15,951.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	35.45	88,625.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	4,400	33.92	149,248.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	4.07	2,442.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	50.91	96,729.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	6.23	21,805.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	8,900	71.18	633,502.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	20.07	14,049.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	3,600	11.72	42,192.00
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	27.07	240,923.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.75	2,700.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	800	43.98	35,184.00
GEMDALE CORP-A	3,300	11.11	36,663.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	1,200	5.96	7,152.00
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	6.72	20,832.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	6.42	4,494.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	8,300	13.63	113,129.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	6.09	3,654.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,400	22.15	31,010.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	17.97	16,173.00
XINHU ZHONGBAO CO LTD-A	1,200	3.24	3,888.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	5.61	19,074.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	7.37	22,847.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.95	15,045.00

360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	11.95	47,800.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	25.05	12,024.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	100	33.14	3,314.00
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	14.37	10,059.00
BEIJING THUNISOFT CORP LTD-A	800	18.15	14,520.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	47.00	9,400.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	15.24	10,668.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.24	2,896.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	689	87.29	60,142.81
IFLYTEK CO LTD - A	1,000	53.96	53,960.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	34.98	27,984.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	268.00	107,200.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	400	60.25	24,100.00
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	129.44	38,832.00
WANGSU SCIENCE & TECHNOLOG-A	900	5.73	5,157.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	31.85	73,509.80
ACCELINK TECHNOLOGIES CO -A	600	22.87	13,722.00
ADDSINO CO LTD -A	1,700	17.62	29,954.00
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	70.20	63,180.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	40.04	20,020.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	6.58	225,694.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	700	37.24	26,068.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	12.31	32,006.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	17.48	19,228.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	3,800	13.48	51,224.00
GOERTEK INC -A	2,000	35.08	70,160.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	13.04	28,688.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	2,500	8.11	20,275.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.92	2,976.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	124.03	62,015.00
HENGTONG OPTIC-ELECTRIC CO-A	200	11.68	2,336.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	20.20	20,200.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	27.05	16,230.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	25.61	117,806.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	7.08	16,284.00

LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	5,533	33.47	185,189.51	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	380.50	136,980.00	
NINESTAR CORP-A	100	24.35	2,435.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	8.55	3,420.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	23.10	23,100.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	80.52	22,545.60	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	17.14	17,140.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	26.23	23,607.00	
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	16.28	11,396.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	32.70	22,890.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	300	13.82	4,146.00	
UNISPLENDOR CORP LTD-A	1,876	18.49	34,687.24	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	15.51	20,163.00	
VISIONOX TECHNOLOGY INC-A	1,100	8.80	9,680.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	700	83.80	58,660.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,360	32.34	43,982.40	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	7.87	19,675.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,600	14.63	23,408.00	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	400	76.05	30,420.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	300	76.06	22,818.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	23.15	55,560.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	34.98	17,490.00	
ZTE CORP-A	2,700	29.08	78,516.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	5.35	23,005.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	17,400	19.65	341,910.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.45	4,485.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.23	3,384.00	
LUENMEI QUANTUM CO LTD-A	2,400	9.10	21,840.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	9.87	65,142.00	
SHANGHAI ELECTRIC POWER CO-A	2,200	7.08	15,576.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.77	4,039.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	9.76	5,856.00	
SICHUAN CHUANYOU ENERGY CO-A	700	11.38	7,966.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	3.15	13,545.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	540	171.89	92,820.60	

	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,000	87.12	87,120.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	36.71	73,420.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	25.98	31,176.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	34.91	66,329.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	2,600	95.80	249,080.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	200	163.75	32,750.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	24.17	106,348.00	
	SG MICRO CORP-A	100	259.52	25,952.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	123.96	30,990.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	27.37	62,951.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	12.18	23,142.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	19.92	15,936.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	128.05	64,025.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	272.00	217,600.00	
	WUXI TAIJI INDUS CO LTD-A	1,500	7.78	11,670.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	36.90	33,210.00	
	オフショア人民元 小計	1,377,038		29,956,379.44 (508,958,886)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	1,627	21.40	34,817.80	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	29,604	35.80	1,059,823.20	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,174	80.00	93,920.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	19.08	72,160.56	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	2,572	102.00	262,344.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	3,500	27.30	95,550.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	5,424	55.60	301,574.40	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	12,072	122.80	1,482,441.60	
	SAUDI CEMENT	1,265	64.80	81,972.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	36.00	107,388.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	8,138	17.40	141,601.20	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	71.20	259,096.80	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	422	80.40	33,928.80	
	JARIR MARKETING CO	611	213.00	130,143.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	130.80	53,104.80	
	ALMARAI CO	3,167	55.00	174,185.00	
	SAVOLA	3,337	39.90	133,146.30	



DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	150.00	117,900.00	
AL RAJHI BANK	16,412	99.70	1,636,276.40	
ALINMA BANK	12,351	19.50	240,844.50	
ARAB NATIONAL BANK	8,707	22.04	191,902.28	
BANK AL-JAZIRA	5,356	18.84	100,907.04	
BANK ALBILAD	5,393	37.00	199,541.00	
BANQUE SAUDI FRANSI	7,513	35.95	270,092.35	
RIYAD BANK	16,646	24.56	408,825.76	
SAUDI BRITISH BANK	8,978	29.90	268,442.20	
THE SAUDI NATIONAL BANK	30,022	54.00	1,621,188.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	113.80	91,040.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	77.00	50,897.00	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	3,942	10.60	41,785.20	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	10.68	45,870.60	
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	31.80	177,571.20	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	14.64	76,128.00	
SAUDI TELECOM CO	8,115	121.40	985,161.00	
SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	23.84	294,638.56	
サウジアラビアリアル 小計	236,843		11,336,208.55 (330,563,841)	
合 計	32,488,978		11,461,934,429 (11,461,934,429)	

(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	1,096,910.00	
	メキシコペソ 小計		45,800	1,096,910.00 (6,026,752)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	701,697.36	
	南アフリカランド 小計		48,594	701,697.36 (5,424,120)	
				11,450,872	

合計		(11,450,872)
----	--	--------------

(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。

(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 65銘柄	100.0%		14.3%
メキシコペソ	株式 23銘柄	97.2%		1.8%
	投資証券 1銘柄		2.8%	0.1%
ブラジルレアル	株式 53銘柄	100.0%		5.0%
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%		0.3%
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%		0.7%
ロシアルーブル	株式 4銘柄	100.0%		0.2%
香港ドル	株式 200銘柄	100.0%		21.5%
マレーシアリングgit	株式 38銘柄	100.0%		1.4%
タイバーツ	株式 43銘柄	100.0%		1.8%
フィリピンペソ	株式 20銘柄	100.0%		0.6%
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%		13.5%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%		13.6%
インドルピー	株式 96銘柄	100.0%		9.8%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%		0.7%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.8%		3.8%
	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%		0.6%
クウェートディナール	株式 7銘柄	100.0%		0.6%
オフショア人民元	株式 452銘柄	100.0%		4.4%

サウジアラビアリアル	株式	35銘柄	100.0%		2.9%
------------	----	------	--------	--	------

(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 M新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

2021年 5月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	10,486,746
コール・ローン	16,712,417
投資信託受益証券	5,638,563,588
派生商品評価勘定	120,795
未収入金	77,675,158
流動資産合計	5,743,558,704
資産合計	5,743,558,704
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,548
未払解約金	83,679,000
未払利息	45
流動負債合計	83,685,593
負債合計	83,685,593
純資産の部	
元本等	
元本	5,089,962,177
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	569,910,934
元本等合計	5,659,873,111
純資産合計	5,659,873,111
負債純資産合計	5,743,558,704

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	3,991,536,643円
期中追加設定元本額	4,034,293,653円
期中一部解約元本額	2,935,868,119円
期末元本額	5,089,962,177円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	848,192,939円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	578,259,878円
りそなラップ型ファンド(成長型)	315,409,612円
DCりそな グローバルバランス	15,206,277円
つみたてバランスファンド	634,038,750円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	189,282,720円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	99,934,512円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	62,322,113円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,595,805円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	9,334,407円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,975,793円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,242,515円
リスクコントロール・オープン	3,162,109円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	88,406,801円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	48,938,615円

FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,040,168,013円
Smart-i 8資産バランス 安定型	33,331,583円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	81,637,640円
Smart-i 8資産バランス 成長型	91,820,965円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	217,262,174円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	240,706,200円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	142,239,361円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	94,084,352円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	196,044,763円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	33,499,560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)	864,720円
2. 計算日における受益権の総数	5,089,962,177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	1.1120円
(10,000口当たり純資産額)	(11,120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 5月17日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### 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 5月17日現在

該当事項はありません。

#### （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

#### （その他の注記）

#### 1 有価証券に関する注記

#### 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		93,983,195
合計		93,983,195

（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 5月17日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	時価	評価損益
			うち1年超	

市場取引以外 の取引	為替予約取引 売建	165,917,808	-	165,803,561	114,247
	米ドル	165,917,808	-	165,803,561	114,247
合計		165,917,808	-	165,803,561	114,247

## (注) 時価の算定方法

## 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受 益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	650,637	37,047,270.78	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	457,332	14,469,984.48	
		米ドル 小計	1,107,969	51,517,255.26	
				(5,638,563,588)	
合計				5,638,563,588	
				(5,638,563,588)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 外貨建有価証券の内訳

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

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M国内リートマザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 5月17日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,157,812,272
投資証券	27,386,231,710
派生商品評価勘定	41,696,900
未収入金	9,412,140
未収配当金	232,834,764
差入委託証拠金	33,912,000
流動資産合計	28,861,899,786
資産合計	28,861,899,786
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	644,640
前受金	33,864,800
未払金	769,488,061
未払解約金	111,379,000
未払利息	3,140
流動負債合計	915,379,641
負債合計	915,379,641
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	19,309,595,731



2021年 5月17日現在

剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	8,636,924,414
元本等合計	27,946,520,145
純資産合計	27,946,520,145
負債純資産合計	28,861,899,786

## 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 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	14,135,268,413円
期中追加設定元本額	20,078,033,109円
期中一部解約元本額	14,903,705,791円
期末元本額	19,309,595,731円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	814,037,964円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	631,780,110円
りそなラップ型ファンド(成長型)	532,619,154円
DCりそな グローバルバランス	17,027,841円
つみたてバランスファンド	961,019,390円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	140,016,520円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	73,949,085円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	46,872,333円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	10,236,921円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	7,022,610円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,743,271円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	5,565,611円

リスクコントロール・オープン	2,393,437円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	67,948,238円
FWりそな国内リートインデックスオープン	4,123,162,588円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,124,179,427円
Smart-i リートインデックス	2,477,825,927円
Smart-i 8資産バランス 安定型	25,024,723円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	61,115,810円
Smart-i 8資産バランス 成長型	69,584,945円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	164,154,398円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	184,778,899円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	109,234,436円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	72,248,617円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	149,140,128円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	25,243,887円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,229,094,231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)	1,406,093円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	825,326,102円
J-REITインデックス202102(適格機関投資家専用)	2,353,843,035円
2. 計算日における受益権の総数	19,309,595,731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	1.4473円
(10,000口当たり純資産額)	(14,473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 5月17日現在	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3.金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

##### 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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 5月17日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		2,365,982,321
合計		2,365,982,321

(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 5月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引 買建	595,268,740	-	636,321,000	41,052,260
合計		595,268,740	-	636,321,000	41,052,260

## (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	408	51,530,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	611	71,303,700	
	S O S i L A 物流リート投資法人	657	94,673,700	
	日本アコモデーションファンド投資法人	861	541,569,000	
	森ヒルズリート投資法人	2,935	458,447,000	
	産業ファンド投資法人	3,532	685,914,400	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,373	819,871,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,703	376,022,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,252	626,000,000	
	G L P 投資法人	7,808	1,411,686,400	

コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,123	383,504,500	
日本プロロジスリート投資法人	3,950	1,354,850,000	
星野リゾート・リート投資法人	380	240,160,000	
Oneリート投資法人	389	116,661,100	
イオンリート投資法人	2,534	375,792,200	
ヒューリックリート投資法人	2,071	358,490,100	
日本リート投資法人	812	348,348,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	15,878	313,114,160	
積水ハウス・リート投資法人	7,349	652,591,200	
トーセイ・リート投資法人	553	73,106,600	
ケネディクス商業リート投資法人	994	272,057,800	
ヘルスケア&メディカル投資法人	533	73,074,300	
サムティ・レジデンシャル投資法人	481	55,747,900	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,080	1,387,336,000	
いちごホテルリート投資法人	437	37,319,800	
ラサルロジポート投資法人	3,022	516,762,000	
スターアジア不動産投資法人	2,567	143,238,600	
マリモ地方創生リート投資法人	234	30,443,400	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	872	476,112,000	
大江戸温泉リート投資法人	403	32,884,800	
投資法人みらい	2,699	129,956,850	
森トラスト・ホテルリート投資法人	541	70,275,900	
三菱地所物流リート投資法人	628	276,634,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	799	135,750,100	
ザイマックス・リート投資法人	383	43,853,500	
タカラレーベン不動産投資法人	751	86,365,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	969	132,171,600	
日本ビルファンド投資法人	2,812	1,920,596,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,499	1,631,847,000	
日本都市ファンド投資法人	12,446	1,346,657,200	
オリックス不動産投資法人	4,978	955,278,200	
日本プライムリアルティ投資法人	1,556	660,522,000	
NTT都市開発リート投資法人	2,257	354,123,300	
東急リアル・エステート投資法人	1,675	312,220,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,735	214,793,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	5,344	867,331,200	

森トラスト総合リート投資法人	1,786	277,901,600	
インヴィンシブル投資法人	10,448	453,965,600	
フロンティア不動産投資法人	829	401,236,000	
平和不動産リート投資法人	1,533	250,492,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,633	503,780,500	
福岡リート投資法人	1,292	224,291,200	
ケネディクス・オフィス投資法人	773	609,124,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,073	191,545,200	
大和証券オフィス投資法人	532	406,448,000	
阪急阪神リート投資法人	1,129	172,511,200	
スタートアップリート投資法人	389	86,280,200	
大和ハウスリート投資法人	3,565	1,064,152,500	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,049	517,550,700	
大和証券リビング投資法人	3,263	365,129,700	
ジャパンエクセレント投資法人	2,319	344,835,300	
合計	156,487	27,386,231,710	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## R M先進国リートマザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

2021年 5月17日現在

資産の部	
流動資産	
預金	615,407,390
コール・ローン	151,261,793

2021年 5月17日現在

株式	30,806,547
投資証券	22,358,781,648
未収入金	31,625,098
未収配当金	38,973,938
流動資産合計	23,226,856,414
資産合計	23,226,856,414
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,023
未払金	570,085,518
未払解約金	137,520,000
未払利息	410
流動負債合計	707,608,951
負債合計	707,608,951
純資産の部	
元本等	
元本	18,321,813,990
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,197,433,473
元本等合計	22,519,247,463
純資産合計	22,519,247,463
負債純資産合計	23,226,856,414

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 5月17日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 6月15日
期首元本額	14,464,332,727円
期中追加設定元本額	23,704,379,915円
期中一部解約元本額	19,846,898,652円
期末元本額	18,321,813,990円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,337,255,504円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,079,013,243円
りそなラップ型ファンド(成長型)	873,509,628円
DCりそな グローバルバランス	20,605,039円
つみたてバランスファンド	569,577,538円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	345,798,183円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	182,845,259円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	112,396,617円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	24,798,953円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	16,893,103円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	8,992,605円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,360,027円
リスクコントロール・オープン	11,447,475円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	164,360,793円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,150,694,751円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,792,906,560円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,639,365,816円
Smart-i 8資産バランス 安定型	60,542,449円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	147,079,000円
Smart-i 8資産バランス 成長型	166,331,305円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	389,932,923円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	441,827,591円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	260,975,403円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	172,663,394円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	354,191,882円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	60,070,488円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,665,046円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	921,713,415円
2. 計算日における受益権の総数	18,321,813,990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	1.2291円
(10,000口当たり純資産額)	(12,291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 5月17日現在

## 1. 金融商品に対する取組方針

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

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

## 金融商品の時価等に関する事項

2021年 5月17日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## 3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

## （関連当事者との取引に関する注記）

2021年 5月17日現在

該当事項はありません。

## （重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

## 1 有価証券に関する注記

## 売買目的有価証券

種類	2021年 5月17日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	2,873,566	
投資証券	1,939,605,124	
合計	1,942,478,690	

(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 5月17日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	39,523,815	-	39,526,838	3,023
	米ドル	32,503,680	-	32,506,085	2,405
	ユーロ	1,991,580	-	1,991,598	18
	英ポンド	1,850,532	-	1,850,728	196
	オーストラリアドル	1,783,887	-	1,784,132	245
	シンガポールドル	1,394,136	-	1,394,295	159
合計		39,523,815	-	39,526,838	3,023

## (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	BROADSTONE NET LEASE INC-A	5,775	20.59	118,907.25	
米ドル 小計		5,775		118,907.25 (13,014,398)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	77,276	2.71	209,417.96	
オーストラリアドル 小計		77,276		209,417.96 (17,792,149)	
合計		83,051		30,806,547 (30,806,547)	

(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	12,803	272,703.90	
		AGREE REALTY CORP	9,280	645,609.60	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,826	196,600.16	
		ALEXANDER'S INC	282	75,415.26	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	18,368	3,192,909.44	

AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,908	241,572.76
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,949	932,017.28
AMERICAN FINANCE TRUST INC	14,353	135,348.79
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	38,861	1,449,903.91
AMERICOLD REALTY TRUST	35,851	1,375,244.36
APARTMENT INCOME REIT CO	21,155	943,089.90
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	19,728	132,966.72
APPLE HOSPITALITY REIT INC	30,685	477,151.75
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,742	101,265.36
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,199	3,998,594.04
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	32,216.40
BOSTON PROPERTIES INC	20,461	2,213,880.20
BRANDYWINE REALTY TRUST	23,422	318,539.20
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	42,024	943,859.04
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	4,942	90,438.60
BRT APARTMENTS CORP	877	16,303.43
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,101	1,724,129.27
CARETRUST REIT INC	13,280	301,190.40
CENTERSPACE	1,720	119,419.60
CHATHAM LODGING TRUST	6,046	78,416.62
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	22,660.00
CITY OFFICE REIT INC	5,694	62,804.82
CLIPPER REALTY INC	1,350	11,097.00
COLONY CAPITAL INC	72,716	474,108.32
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	15,763	282,945.85
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	2,985	141,250.20
COREPOINT LODGING INC	4,988	52,024.84
CORESITE REALTY CORP	6,274	738,387.06
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,284	442,436.28
COUSINS PROPERTIES INC	21,068	745,596.52
CTO REALTY GROWTH INC	900	46,908.00
CUBESMART	28,846	1,212,974.30
CYRUSONE INC	17,129	1,192,007.11
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29,008	291,820.48
DIGITAL REALTY TRUST INC	40,636	6,049,887.68

DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	31,514	114,710.96	
DOUGLAS EMMETT INC	23,866	780,179.54	
DUKE REALTY CORP	53,923	2,423,838.85	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,183	244,269.15	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,734	887,107.14	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	19,248	221,544.48	
EPR PROPERTIES	10,960	525,422.40	
EQUINIX INC	12,892	9,308,281.84	
EQUITY COMMONWEALTH	17,650	479,374.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,505	1,695,255.90	
EQUITY RESIDENTIAL	49,547	3,669,946.29	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	15,854	393,496.28	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,425	2,717,887.25	
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,088	2,760,697.44	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	44,224.63	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,160	1,143,304.80	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,451	924,395.10	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,555	288,151.50	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12,675	65,783.25	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31,744	1,459,589.12	
GEO GROUP INC/THE	15,904	98,604.80	
GETTY REALTY CORP	4,846	147,027.64	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,661	97,321.68	
GLADSTONE LAND CORP	3,096	74,365.92	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,879	84,128.49	
GLOBAL NET LEASE INC	13,494	251,663.10	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20,146	610,020.88	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	31,328	868,725.44	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	78,050	2,581,894.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	64,951.90	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,906	648,560.06	
HOST HOTELS & RESORTS INC	102,373	1,774,124.09	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,871	589,860.87	

INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,188	246,653.12	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,736	241,550.16	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,465	607,795.65	
INVITATION HOMES INC	81,885	2,874,982.35	
IRON MOUNTAIN INC	41,755	1,774,587.50	
JBG SMITH PROPERTIES	16,030	501,097.80	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	87,700	63,582.50	
KILROY REALTY CORP	15,084	1,006,857.00	
KIMCO REALTY CORP	62,927	1,335,940.21	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,509	257,185.04	
LEXINGTON REALTY TRUST	41,799	506,603.88	
LIFE STORAGE INC	10,972	1,052,105.08	
LTC PROPERTIES INC	5,856	233,712.96	
MACERICH CO/THE	17,246	241,616.46	
MACK-CALI REALTY CORP	12,808	215,814.80	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	155,782.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	84,271	1,754,522.22	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,517	2,589,039.75	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,510	275,690.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	25,522	1,151,807.86	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,844	383,829.60	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,595	445,953.90	
NETSTREIT CORP	3,551	75,529.77	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	81,096.75	
NEXPOINT RESIDENTIAL	2,990	150,486.70	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	196,903.02	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	33,559	1,201,747.79	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	54,392.10	
PARAMOUNT GROUP INC	24,691	255,551.85	
PARK HOTELS & RESORTS INC	33,881	747,414.86	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,446	444,146.64	
PHYSICIANS REALTY TRUST	30,660	554,639.40	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	17,014	307,442.98	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	78,843.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,628	62,899.72	

PRIME US REIT	58,100	49,094.50	
PROLOGIS INC	106,654	12,227,881.10	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,969	455,533.67	
PUBLIC STORAGE	21,976	6,009,337.20	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	9,438	591,196.32	
REALTY INCOME CORP	54,013	3,529,209.42	
REGENCY CENTERS CORP	22,831	1,455,932.87	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,513	307,703.41	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	31,321	368,334.96	
RETAIL VALUE INC	2,135	38,515.40	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	18,772	1,010,309.04	
RLJ LODGING TRUST	24,148	369,222.92	
RPT REALTY	10,705	133,491.35	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,100	617,382.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30,693	524,850.30	
SAFEHOLD INC	1,886	131,416.48	
SAUL CENTERS INC	2,130	91,717.80	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	4,727	75,537.46	
SERVICE PROPERTIES TRUST	22,759	257,631.88	
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,466	5,799,395.88	
SITE CENTERS CORP	24,350	359,649.50	
SL GREEN REALTY CORP	9,945	718,725.15	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,218	744,730.56	
STAG INDUSTRIAL INC	22,906	816,827.96	
STORE CAPITAL CORP	35,014	1,167,366.76	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,766	137,935.32	
SUN COMMUNITIES INC	16,127	2,633,700.37	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30,464	386,588.16	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13,892	230,190.44	
TERRENO REALTY CORP	9,938	626,292.76	
UDR INC	42,885	1,989,435.15	
UMH PROPERTIES INC	5,141	108,886.38	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,693	114,023.55	
URBAN EDGE PROPERTIES	16,309	308,729.37	
URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,952	73,270.08	

	VENTAS INC	54,250	2,964,220.00
	VEREIT INC	33,312	1,501,371.84
	VICI PROPERTIES INC	77,686	2,398,166.82
	VORNADO REALTY TRUST	22,681	1,028,583.35
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	4,054	7,905.30
	WASHINGTON REIT	11,646	265,645.26
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,445	568,707.00
	WELLTOWER INC	60,361	4,419,632.42
	WHITESTONE REIT	5,243	46,767.56
	WP CAREY INC	25,455	1,874,760.75
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,713	305,303.59
	米ドル 小計	3,552,081	151,783,317.02 (16,612,684,047)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,935	383,579.55
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,346	92,390.22
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	42,700.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,575	134,348.50
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,156	701,644.32
	CHOICE PROPERTIES REIT	22,900	329,760.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,992	142,578.48
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,406	109,414.48
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	6,646	109,659.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,853	183,540.84
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	84,627.60
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,318	285,728.18
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,569	363,738.09
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,239	312,287.77
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	8,965	141,109.10
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	151,772.16
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,257	48,457.79
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	39,138.86
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,584	167,241.36
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	39,800.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,137	465,098.37
	SLATE GROCERY REIT	2,561	31,551.52



	SLATE OFFICE REIT	4,169	18,843.88
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,783	316,912.37
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,809	206,481.08
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	39,379.10
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	5,274	110,490.30
	カナダドル 小計	251,506	5,052,272.92 (456,169,721)
ユーロ	AEDIFICA	4,860	496,206.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,381	378,039.73
	ALTAREA	482	80,879.60
	BEFIMMO	3,878	136,699.50
	CARE PROPERTY INVEST	3,357	85,099.95
	CARMILA	6,182	92,482.72
	COFINIMMO	4,208	551,668.80
	COVIVIO	7,060	540,231.20
	CROMWELL REIT EUR	37,440	86,860.80
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	5,043	113,770.08
	GECINA SA	7,917	1,021,293.00
	HAMBORNER REIT AG	9,356	84,204.00
	HIBERNIA REIT PLC	87,366	100,296.16
	ICADE	4,668	331,894.80
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,951	44,570.57
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	35,232	315,150.24
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,038	66,684.10
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	68,224	103,700.48
	KLEPIERRE	28,629	662,475.06
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	43,772.82
	MERCIALYS	5,259	56,323.89
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	48,236	434,027.52
	MONTEA	1,425	132,952.50
	NSI NV	2,217	75,045.45
	RETAIL ESTATES	1,443	93,795.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,118	1,407,254.10
	VASTNED RETAIL NV	2,828	66,599.40
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,620	580,359.60
	WERELDHAVE NV	6,360	89,612.40

	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,620	122,616.00	
	ユーロ 小計	472,415	8,394,565.47 (1,114,546,457)	
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	19,300.00	
	ASSURA PLC	390,783	285,076.19	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,982	310,327.08	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	123,187	101,998.83	
	BRITISH LAND CO PLC	133,948	704,834.37	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	128,057	224,099.75	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	108,732.78	
	CUSTODIAN REIT PLC	53,561	52,436.21	
	DERWENT LONDON PLC	15,967	540,961.96	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	78,829	69,369.52	
	GCP STUDENT LIVING PLC	67,882	109,290.02	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36,909	263,530.26	
	HAMMERSON PLC	556,917	200,211.66	
	HOME REIT PLC	35,027	39,930.78	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	41,323	46,199.11	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	109,483	793,970.71	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	128,694	290,848.44	
	LXI REIT PLC	71,175	96,228.60	
	NEWRIVER REIT PLC	39,505	37,727.27	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	70,311	60,115.90	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	189,064	283,974.12	
	REGIONAL REIT LTD	63,471	52,680.93	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	30,606	279,738.84	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	103,503	49,163.92	
	SEGRO PLC	171,917	1,717,450.83	
	SHAFTESBURY PLC	45,322	288,701.14	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	46,920.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	121,418	139,023.61	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	61,746.08	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	248,826	479,238.87	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	95,460	73,026.90	

	UNITE GROUP PLC	56,785	631,449.20
	WORKSPACE GROUP PLC	19,226	168,323.63
	英ポンド 小計	3,609,315	8,626,627.51 (1,330,484,760)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	62,398	184,698.08
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	84,651.09
	ARENA REIT	45,189	149,123.70
	AVENTUS GROUP	48,838	139,676.68
	BWP TRUST	66,863	279,487.34
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	63,573	221,234.04
	CENTURIA OFFICE REIT	49,819	109,601.80
	CHARTER HALL GROUP	66,709	905,908.22
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	70,884	343,078.56
	CHARTER HALL RETAIL REIT	76,733	281,610.11
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	42,983	141,414.07
	CROMWELL PROPERTY GROUP	282,409	247,107.87
	DEXUS	158,236	1,615,589.56
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	71,973.47
	GOODMAN GROUP	243,422	4,566,596.72
	GPT GROUP	277,641	1,279,925.01
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	38,211	142,527.03
	HOME CONSORTIUM	23,930	108,642.20
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	44,081	55,542.06
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	94,563.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	40,374	221,249.52
	IRONGATE GROUP	69,568	104,352.00
	MIRVAC GROUP	573,102	1,570,299.48
	NATIONAL STORAGE REIT	138,895	279,178.95
	RURAL FUNDS GROUP	44,091	105,818.40
	SCENTRE GROUP	754,242	2,021,368.56
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	148,342	358,987.64
STOCKLAND	348,464	1,609,903.68	
VICINITY CENTRES	567,728	868,623.84	
WAYPOINT REIT LTD	117,252	300,165.12	
	オーストラリアドル 小計	4,587,551	18,462,897.80 (1,568,607,797)

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	133,298	196,614.55
	GOODMAN PROPERTY TRUST	157,709	354,845.25
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	226,618	277,607.05
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	164,901	265,490.61
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	51,535	153,831.97
ニュージーランドドル 小計		734,061	1,248,389.43 (98,785,055)
香港ドル	CHAMPION REIT	294,000	1,320,060.00
	FORTUNE REIT	198,000	1,587,960.00
	LINK REIT	301,900	22,099,080.00
	PROSPERITY REIT	163,000	448,250.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	131,000	555,440.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	202,000	789,820.00
香港ドル 小計		1,289,900	26,800,610.00 (377,620,594)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	58,500	78,390.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	146,400	109,800.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	449,300	1,289,491.00
	ASCOTT TRUST	258,296	254,421.56
	CAPITALAND CHINA TRUST	133,600	173,680.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	647,132	1,287,792.68
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	122,600	144,668.00
	EC WORLD REIT	50,000	36,750.00
	ESR REIT	312,600	118,788.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	92,115.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	41,825.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	189,700	434,413.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	66,850.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	390,979	543,460.81
	IREIT GLOBAL	55,000	34,925.00
	KEPPEL DC REIT	188,300	485,814.00
	KEPPEL REIT	293,900	343,863.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	100,847.50
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	56,013.30
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	320,800	635,184.00

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	243,800	648,508.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	424,000	805,600.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	319,400	322,594.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	137,775.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	53,900	224,763.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	91,400	37,017.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,300	58,513.00	
	SPH REIT	129,700	105,057.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	178,700	92,924.00	
	SUNTEC REIT	304,100	434,863.00	
	シンガポールドル 小計	7,283,207	9,196,705.85 (754,313,813)	
韓国ウォン	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	20,040,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	92,880,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	25,571,910.00	
	LOTTE REIT CO LTD	15,761	87,315,940.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	48,027,250.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	41,265,220.00	
	韓国ウォン 小計	57,085	315,100,320.00 (30,533,221)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	25,765	449,341.60	
	イスラエルシュケル 小計	25,765	449,341.60 (15,036,183)	
合計			22,358,781,648 (22,358,781,648)	

(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 1銘柄	0.1%		0.1%
	投資証券 155銘柄		99.9%	74.2%
カナダドル	投資証券 27銘柄		100.0%	2.0%

ユーロ	投資証券	30銘柄		100.0%	5.0%
英ポンド	投資証券	34銘柄		100.0%	5.9%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.1%		0.1%
	投資証券	30銘柄		98.9%	7.0%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄		100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄		100.0%	1.7%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄		100.0%	3.4%
韓国ウォン	投資証券	6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 5月31日現在です。

## 【りそな・リスクコントロールファンド2020-06】

## 【純資産額計算書】

資産総額	2,649,336,960円
負債総額	12,070,176円
純資産総額（ - ）	2,637,266,784円
発行済口数	2,500,365,498口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0548円

（参考）

## R M国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	94,370,683,035円
負債総額	31,416,169円
純資産総額（ - ）	94,339,266,866円
発行済口数	89,791,473,804口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0506円

## R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

## 純資産額計算書

資産総額	233,638,872,685円
負債総額	4,133,453,494円
純資産総額（ - ）	229,505,419,191円
発行済口数	221,954,616,405口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0340円

## R M国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	51,836,076,680円
負債総額	338,278,051円
純資産総額（ - ）	51,497,798,629円
発行済口数	37,010,320,043口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3914円

## R M先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	98,801,195,473円
負債総額	3,166,914,574円
純資産総額（ - ）	95,634,280,899円
発行済口数	52,223,510,617口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8312円

## R M新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	16,209,821,682円
負債総額	882,977,886円
純資産総額（ - ）	15,326,843,796円
発行済口数	8,897,960,596口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7225円

## R M新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	5,771,568,921円
負債総額	34,833,129円
純資産総額（ - ）	5,736,735,792円
発行済口数	5,109,329,305口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1228円

## R M国内リートマザーファンド

## 純資産額計算書



資産総額	28,440,918,612円
負債総額	610,389,296円
純資産総額（ - ）	27,830,529,316円
発行済口数	18,794,596,318口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4808円

## R 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	23,422,831,072円
負債総額	12,348,719円
純資産総額（ - ）	23,410,482,353円
発行済口数	18,513,691,442口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2645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5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5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5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	94	985,415
単位型株式投資信託	7	102,937
合計	101	1,088,352

## 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。
- （2）財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- （3）当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

	（単位：千円）	
	前事業年度 （2020年3月31日）	当事業年度 （2021年3月31日）
資産の部		
流動資産		
預金	2,211,091	4,261,664
前払費用	186,739	245,658
未収入金	247	8,551
未収委託者報酬	810,183	768,778
未収運用受託報酬	1,261,327	2,597,734
未収投資助言報酬	418,494	437,046
流動資産計	4,888,083	8,319,433
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 4,325	5,302
器具備品	1 11,668	18,218
有形固定資産計	15,993	23,520
無形固定資産		
ソフトウェア	18,733	8,588
無形固定資産計	18,733	8,588
投資その他の資産		
投資有価証券	7,975	19,301
長期前払費用	416	-
繰延税金資産	72,304	128,654

投資その他の資産計	80,969	147,956
固定資産計	115,424	180,065
資産合計	5,003,507	8,499,498

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料	311,378	256,287
その他未払金	2 760,759	1,255,082
未払費用	85,094	99,584
未払法人税等	192,367	269,609
未払消費税等	287,966	352,528
預り金	1,648	1,387
賞与引当金	96,675	224,862
流動負債計	1,735,890	2,459,343
負債合計	1,735,890	2,459,343
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	1,778,051	4,548,350
利益剰余金計	1,778,051	4,548,350
株主資本計	3,268,051	6,038,350
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	433	1,804
評価・換算差額等計	433	1,804
純資産合計	3,267,617	6,040,155
負債・純資産合計	5,003,507	8,499,498

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,170,025	3,539,887
運用受託報酬	1,201,400	4,624,333
投資助言報酬	1,166,500	839,669
その他営業収益	-	261
営業収益計	5,537,925	9,004,153
営業費用		
支払手数料	1,050,201	1,166,440
広告宣伝費	63,238	37,315

調査費		
調査費	500,578	1,297,321
委託調査費	128,044	98,375
委託計算費	188,413	207,635
事務委託費	-	23,815
営業雑経費		
印刷費	68,686	75,269
協会費	5,690	9,101
販売促進費	5,255	3,264
その他	55,169	55,514
営業費用計	2,065,279	2,974,056
一般管理費		
給料		
役員報酬	82,651	110,648
給料・手当	490,014	1,104,231
賞与	3,982	143,217
賞与引当金繰入額	132,198	224,862
旅費交通費	13,634	4,372
租税公課	48,964	73,538
不動産賃借料	48,771	97,751
固定資産減価償却費	16,096	21,729
諸経費	119,502	256,552
一般管理費計	955,815	2,036,904
営業利益	2,516,831	3,993,191
営業外収益		
受取配当金	23	189
投資有価証券売却益	73	-
雑収入	46	1,694
営業外収益計	142	1,883
営業外費用		
投資有価証券売却損	-	277
雑損失	13	273
営業外費用計	13	550
経常利益	2,516,960	3,994,525
税引前当期純利益	2,516,960	3,994,525
法人税、住民税及び事業税	1	769,705
法人税等調整額	38,032	57,337
法人税等計	731,672	1,224,226
当期純利益	1,785,287	2,770,298

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当期変動額						
当期純利益	-	-	-	2,770,298	2,770,298	2,770,298
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	2,770,298	2,770,298	2,770,298
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350

	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
当期変動額			
当期純利益	-	-	2,770,298
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	2,238	2,238	2,238
当期変動額合計	2,238	2,238	2,772,537
当期末残高	1,804	1,804	6,040,155

(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）

### 1．収益認識に関する会計基準等

- ・「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

当財務諸表に与える影響はありません。

## 2．時価の算定に関する会計基準等



- ・「時価の算定に関する会計基準(企業会計基準第30号 2019年7月4日)
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日)
- ・「棚卸資産の評価に関する会計基準」(企業会計基準第9号 2019年7月4日)
- ・「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 2019年7月4日)
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日)

## (1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(以下「時価算定会計基準等」という。)が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品
  - ・「棚卸資産の評価に関する会計基準」におけるトレーディング目的で保有する棚卸資産
- また、「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

## (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

当財務諸表に与える影響はありません。

## 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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	885千円	1,346千円
器具備品	11,323千円	22,447千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
流動負債		
その他未払金	616,704千円	1,030,722千円

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
法人税、住民税及び事業税	616,720千円	1,029,080千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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（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	-

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
預金	4,261,664	4,261,664	-
未収委託者報酬	768,778	768,778	-
未収運用受託報酬	2,597,734	2,597,734	-
未収投資助言報酬	437,046	437,046	-
資産計	8,065,223	8,065,223	-
未払手数料	256,287	256,287	-
その他未払金	1,255,082	1,255,082	-
負債計	1,511,370	1,511,370	-

## 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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	29,592千円	68,830千円
未払事業所税	655千円	1,246千円
未払事業税	33,577千円	54,775千円
未確定債務	757千円	757千円
減価償却超過額	3,944千円	3,840千円
税務上の繰越欠損金(*1)	3,586千円	-
その他有価証券評価差額金	191千円	51千円
繰延税金資産小計	72,304千円	129,502千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	72,304千円	129,502千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	848千円
繰延税金負債合計	-	848千円
繰延税金資産の純額	72,304千円	128,654千円

(\*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(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

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 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 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%

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	0.06%
その他	0.03%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.65%

## （セグメント情報等）

前事業年度（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。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	5,083,778

## 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 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）

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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)	1,029,080	その他 未払金	1,030,722

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)	4,459,201	未収運用 受託報酬	2,531,968
							投資助言 報酬 (注1)	624,314	未収投資 助言報酬	358,053
							支払手数料 (注3)	746,352	未払 手数料	164,487

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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	825円15銭	1,525円29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( )	450円83銭	699円57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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

当期純利益又は当期純損失( ) (千円)	1,785,287	2,770,298
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)	1,785,287	2,770,298
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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31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って、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 (2021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（2021年3月末現在）

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

再信託の目的 : 原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（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 (2021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 (2021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
2021年 3月12日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月21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2021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7月1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2020-06の2020年6月15日から2021年5月17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2020-06の2021年5月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する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。