

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年6月24日提出
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【電話番号】	03-6704-3821
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	(1)当初申込額 1,000億円を上限とします。 (2)継続申込額 1兆円を上限とします。 該当事項はありません。
【縦覧に供する場所】	

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

半期報告書を提出しましたので2020年7月28日付をもって提出しました有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を新たな情報に訂正するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部_____は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書が更新されます。なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」および「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載しています。

第一部【証券情報】

(1 2) 【その他】

< 訂正前 >

該当事項はありません。

< 訂正後 >

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

新名称	旧名称
<u>R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）</u>	<u>R A M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）</u>
<u>R M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)</u>	<u>R A M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)</u>
<u>R M先進国債券マザーファンド</u>	<u>R A M先進国債券マザーファンド</u>
<u>R M新興国債券マザーファンド</u>	<u>R A M新興国債券マザーファンド</u>
<u>R M国内株式E S Gマザーファンド</u>	<u>R A M国内株式E S Gマザーファンド</u>
<u>R M先進国株式E S Gマザーファンド</u>	<u>R A M先進国株式E S Gマザーファンド</u>
<u>R M新興国株式マザーファンド</u>	<u>R A M新興国株式マザーファンド</u>
<u>R M国内リートマザーファンド</u>	<u>R A M国内リートマザーファンド</u>
<u>R M先進国リートマザーファンド</u>	<u>R A M先進国リートマザーファンド</u>

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの特色

<訂正前>

1 各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの8つの資産に分散投資します。

- 各マザーファンドは、以下の対象指数(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。(RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)を除きます。)

		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
投資対象資産	債券	RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型) 【主要投資対象】 わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債 【対象指数】 なし	RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	RAM新興国債券マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPMオルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
		RAM先進国債券マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)		
	株式	RAM国内株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)	RAM先進国株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)	RAM新興国株式マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIEマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	リート	RAM国内リートマザーファンド 【主要投資対象】 不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	RAM先進国リートマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資信託証券、不動産関連株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	—

*各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

(略)

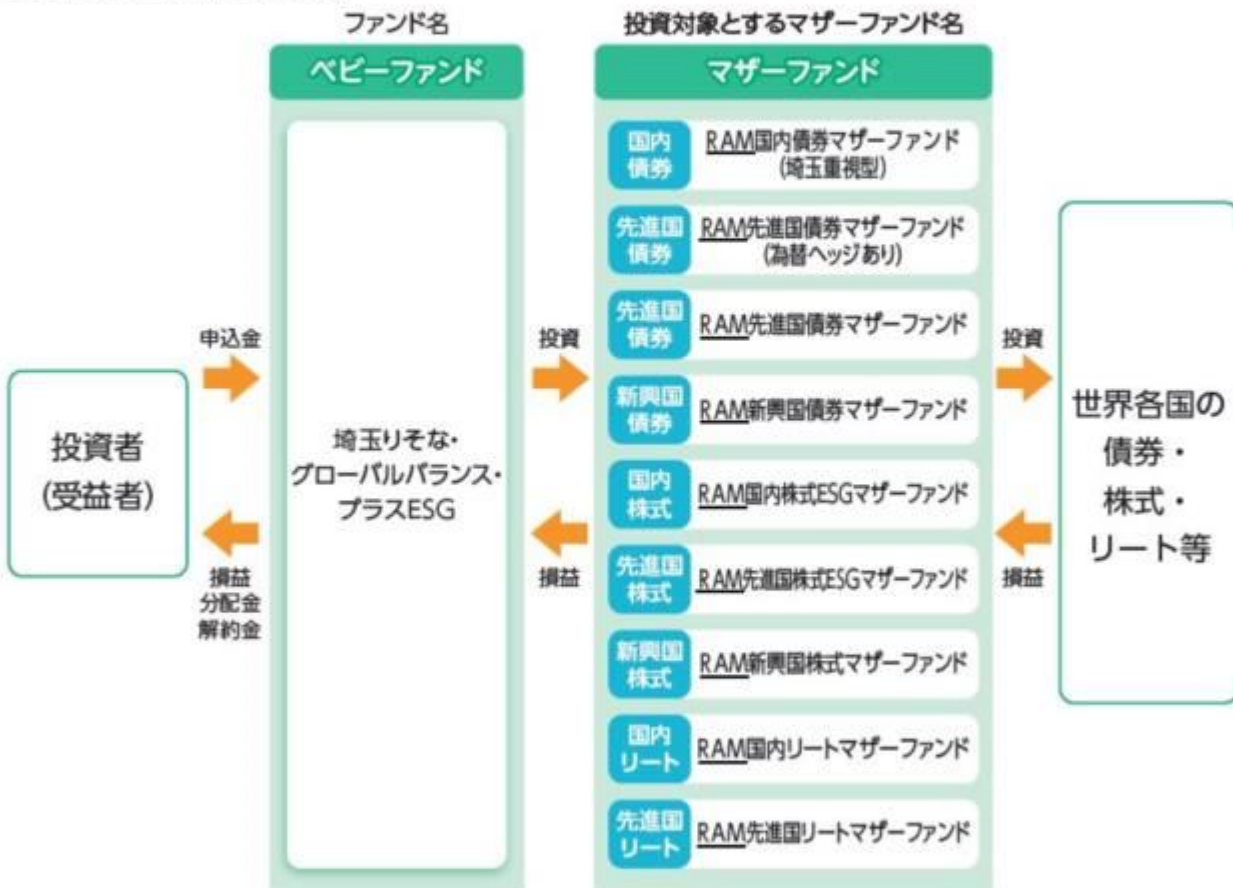
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 外貨建資産として組み入れるRAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)において為替ヘッジを行います。

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RAM先進国債券マザーファンド

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

●RAM新興国債券マザーファンド

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

●RAM国内株式ESGマザーファンド

MSCI Inc.が開発した「MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)」は、国内株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

●RAM先進国株式ESGマザーファンド

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

●RAM新興国株式マザーファンド

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

●RAM国内リートマザーファンド

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

●RAM先進国リートマザーファンド

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

< 訂正後 >

1 各マザーファンドを通じて、世界各国の債券、株式およびリートなどの8つの資産に分散投資します。

- 各マザーファンドは、以下の対象指数(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。(RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)を除きます。)

		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
投資対象資産	債券	RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型) 【主要投資対象】 わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債 【対象指数】 なし	RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり) 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)	RM新興国債券マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の債券およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)
			RM先進国債券マザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の債券 【対象指数】 FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)	
	株式	RM国内株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)	RM先進国株式ESGマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)	RM新興国株式マザーファンド 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIEマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	リート	RM国内リートマザーファンド 【主要投資対象】 不動産投資信託証券 【対象指数】 東証REIT指数(配当込み)	RM先進国リートマザーファンド 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の不動産投資信託証券、不動産関連株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	—

*各対象指数については、「各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について」をご参照ください。

(略)

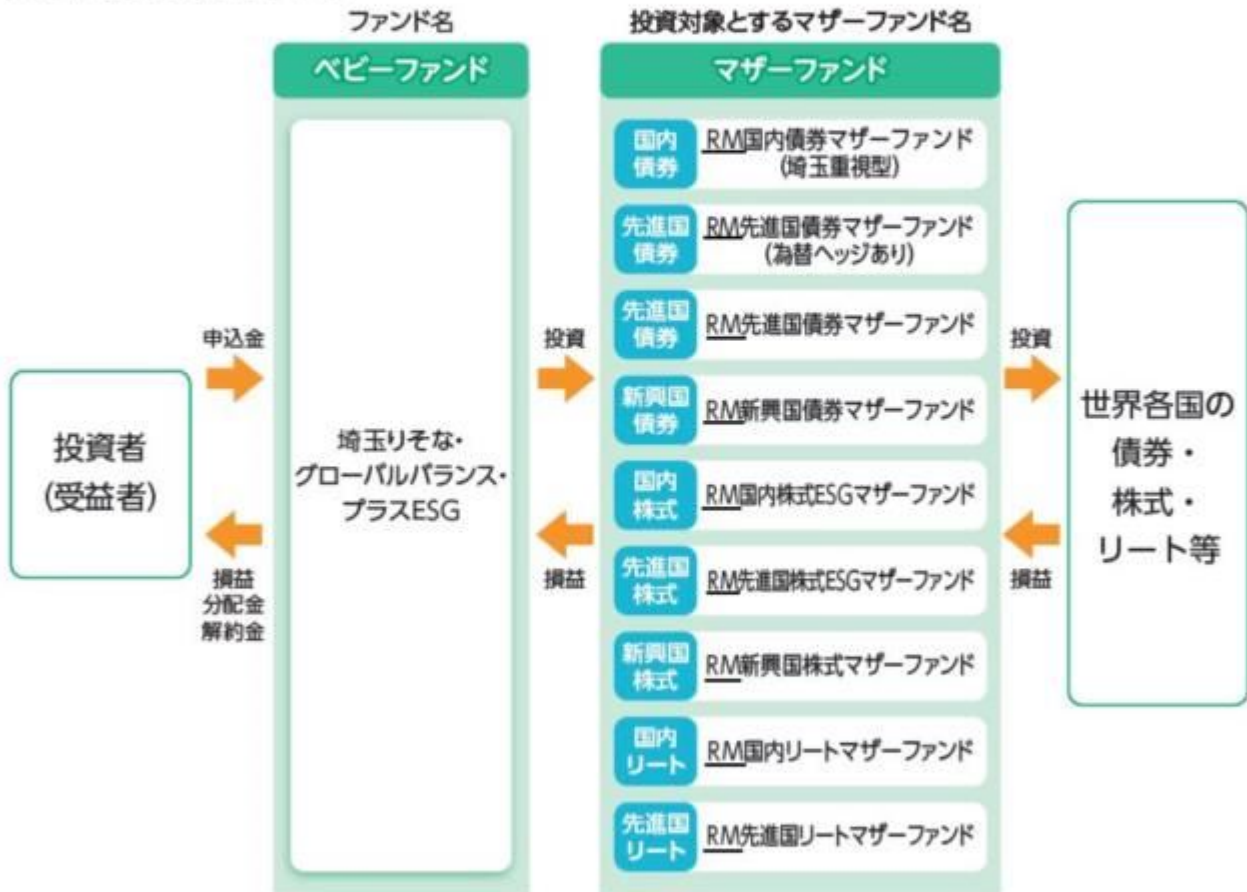
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

- 外貨建資産として組み入れるRM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)において為替ヘッジを行います。

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年8月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RM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先進国債券マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内株式ESGマザーファンド

MSCI Inc.が開発した「MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)」は、国内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先進国株式ESGマザーファンド

[MSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)]は、MSCI Inc.が開発したMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(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 ESG リーダーズ指数(米ドルベース)は、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

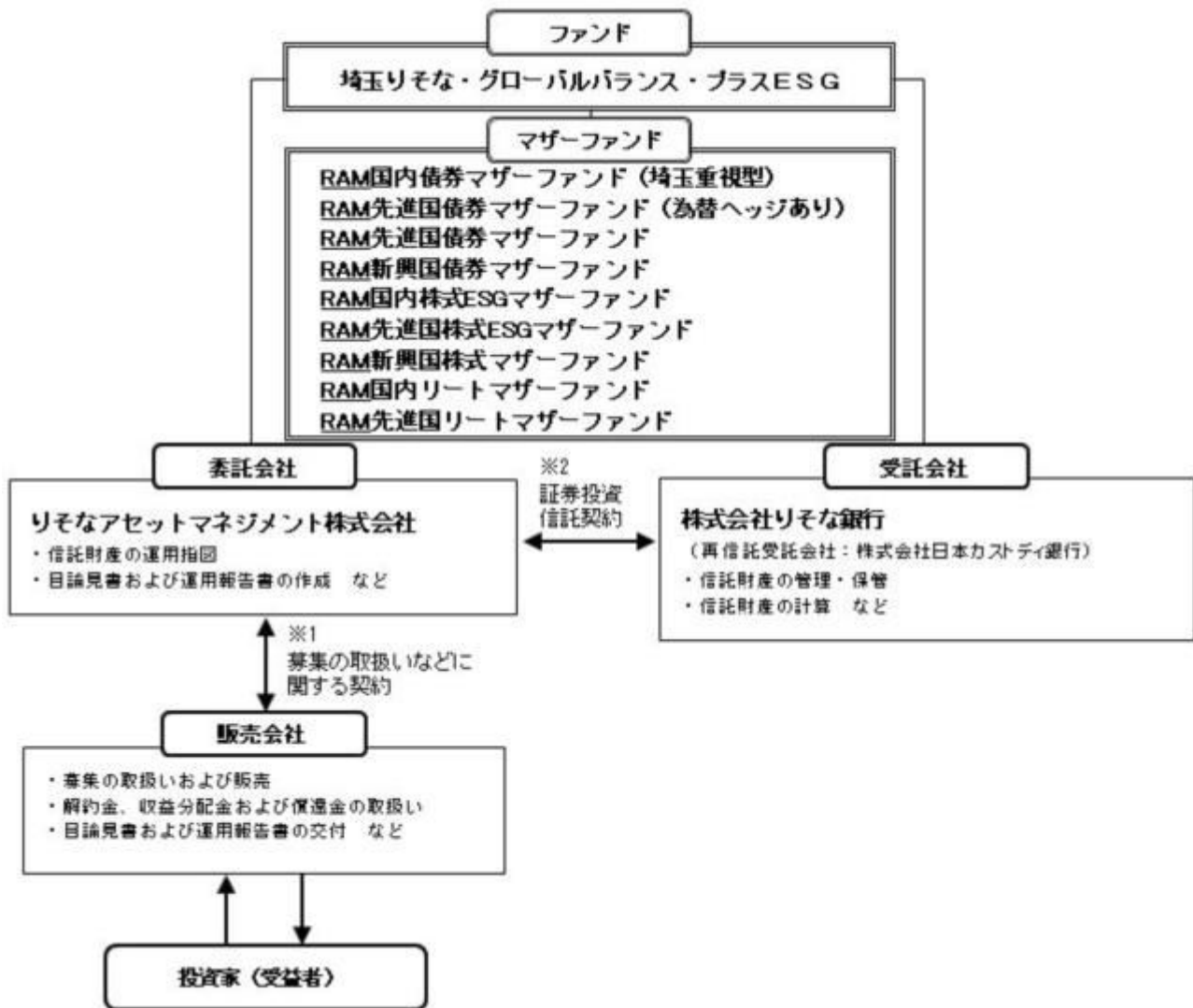
●RM先進国リートマザーファンド

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

(3)【ファンドの仕組み】

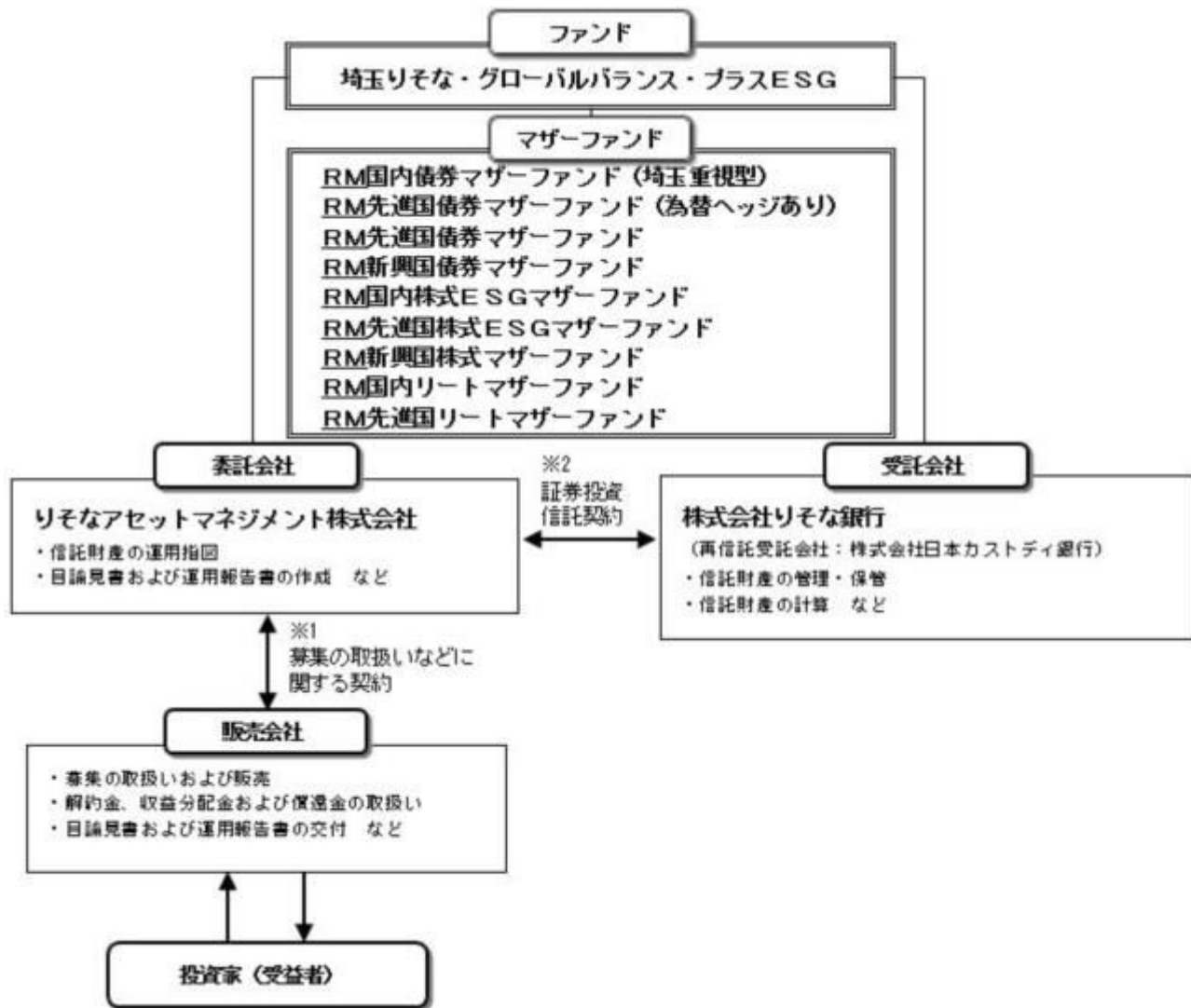
ファンドの仕組み

<訂正前>



(略)

<訂正後>



(略)

<更新後>

委託会社の概況（2021年3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】

<訂正前>

RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)、RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RAM先進国債券マザーファンド、RAM新興国債券マザーファンド、RAM国内株式ESGマザーファンド、RAM先進国株式ESGマザーファンド、RAM新興国株式マザーファンド、RAM国内リートマザーファンド、RAM先進国リートマザーファンド(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

～ (略)

<訂正後>

RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)、RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)、RM先進国債券マザーファンド、RM新興国債券マザーファンド、RM国内株式ESGマザーファンド、RM先進国株式ESGマザーファンド、RM新興国株式マザーファンド、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(以下、各々を「マザーファンド」といいます。)の各受益証券を主要投資対象とします。

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

新名称	旧名称
<u>RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)</u>	<u>RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)</u>
<u>RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)</u>	<u>RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)</u>
<u>RM先進国債券マザーファンド</u>	<u>RAM先進国債券マザーファンド</u>
<u>RM新興国債券マザーファンド</u>	<u>RAM新興国債券マザーファンド</u>
<u>RM国内株式ESGマザーファンド</u>	<u>RAM国内株式ESGマザーファンド</u>
<u>RM先進国株式ESGマザーファンド</u>	<u>RAM先進国株式ESGマザーファンド</u>
<u>RM新興国株式マザーファンド</u>	<u>RAM新興国株式マザーファンド</u>
<u>RM国内リートマザーファンド</u>	<u>RAM国内リートマザーファンド</u>
<u>RM先進国リートマザーファンド</u>	<u>RAM先進国リートマザーファンド</u>

～ (略)

(2)【投資対象】

<訂正前>

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型) >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり) >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用

(略)
その他
(略)

< R A M先進国債券マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R A M新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R A M国内株式E S Gマザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R A M先進国株式E S Gマザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R A M新興国株式マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R A M国内リートマザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R A M先進国リートマザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< 訂正後 >

《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（埼玉重視型） >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M先進国債券マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M国内株式 E S G マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M先進国株式 E S G マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M新興国株式マザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M国内リートマザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)
その他
(略)

< R M先進国リートマザーファンド >

運用の基本方針
(略)
ファンドに係る費用
(略)

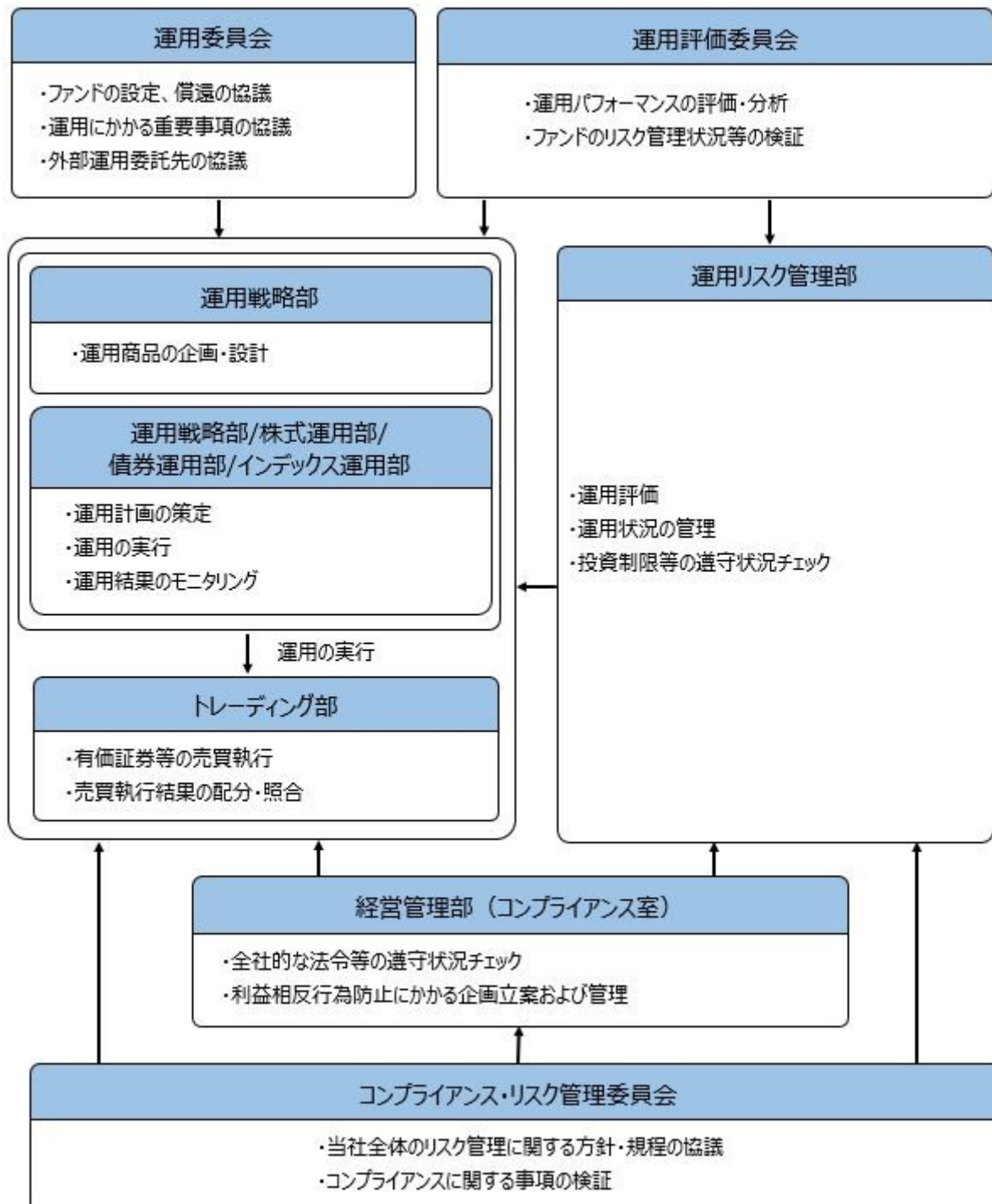
その他

(略)

(3) 【運用体制】

<更新後>

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2021年3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。

3【投資リスク】

<更新後>

(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3月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

<更新後>

〔参考情報〕

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移



- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	—	42.1	59.8	62.7	9.3	11.4	19.3
最小値	—	△22.0	△17.5	△26.3	△4.0	△12.3	△15.0
平均値	—	5.2	8.9	7.7	1.1	1.3	1.9

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2016年4月から2021年3月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

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

東証株価指数(TOPIX, 配当込み)

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

MSCI-KOKUSAIインデックス(配当込み, 円ベース)

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み, 円ベース)

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

NOMURA-BPI国債

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

FTSE世界国債インデックス(除く日本, 円ベース)

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

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

(略)

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

上記は2020年4月末現在のもので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

<訂正後>

(略)

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3月末現在のもので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

以下の運用状況は2021年 3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	4,680,077,415	99.51
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		23,271,591	0.49
合計(純資産総額)		4,703,349,006	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	1,800,883,660	1.0658	1,919,412,565	1.0332	1,860,672,997	39.56
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国株式ESGMザーファンド	807,677,502	1.0447	843,780,687	1.2772	1,031,565,705	21.93
日本	親投資信託受益証券	RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)	798,220,830	0.9990	797,499,716	0.9969	795,746,345	16.92
日本	親投資信託受益証券	RAM国内株式ESGMザーファンド	227,217,336	1.0522	239,078,081	1.2271	278,818,393	5.93
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国リートマザーファンド	159,241,582	1.0532	167,725,639	1.1825	188,303,170	4.00
日本	親投資信託受益証券	RAM新興国株式マザーファンド	108,060,584	1.3740	148,484,109	1.6789	181,422,914	3.86
日本	親投資信託受益証券	RAM先進国債券マザーファンド	148,536,277	1.0610	157,603,794	1.0791	160,285,496	3.41

日本	親投資信託受益証券	R A M国内リートマザーファンド	64,476,921	1.2221	78,802,893	1.4314	92,292,264	1.96
日本	親投資信託受益証券	R A M新興国債券マザーファンド	84,654,878	1.0353	87,646,548	1.0746	90,970,131	1.93

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.51
合 計	99.51

【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
2020年 9月末日	2,353		1.0082	
10月末日	2,932		0.9954	
11月末日	3,151		1.0374	
12月末日	3,414		1.0477	
2021年 1月末日	3,765		1.0547	
2月末日	3,981		1.0542	
3月末日	4,703		1.0773	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
当中間期	2020年 9月25日～2021年 3月24日	

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
当中間期	2020年 9月25日～2021年 3月24日	6.72

(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）
当中間期	2020年 9月25日～2021年 3月24日	4,646,320,057	375,598,840

(注)第1中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

R A M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

以下の運用状況は2021年 3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	221,579,200	27.85
地方債証券	日本	553,277,500	69.53
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		20,853,443	2.62
合計（純資産総額）		795,710,143	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	地方債証券	令和2年度第7回 埼玉県公募公債	150,000,000	100.04	150,073,500	99.54	149,314,500	0.125	2030/10/16	18.76
日本	地方債証券	平成27年度第6 回埼玉県公募公債	100,000,000	102.44	102,445,000	102.17	102,176,000	0.505	2025/9/29	12.84
日本	地方債証券	平成24年度第7 回埼玉県公募公債	100,000,000	101.65	101,651,000	101.33	101,330,000	0.815	2022/11/28	12.73
日本	国債証券	第146回利付国 債（5年）	100,000,000	100.93	100,937,600	100.92	100,924,000	0.100	2025/12/20	12.68
日本	地方債証券	平成29年度第9 回埼玉県公募公債	100,000,000	100.70	100,701,000	100.79	100,798,000	0.200	2028/3/27	12.67
日本	地方債証券	令和2年度第9回 埼玉県公募公債	100,000,000	100.00	100,000,000	99.65	99,659,000	0.140	2031/2/18	12.52
日本	国債証券	第139回利付国 債（5年）	60,000,000	100.85	60,511,050	100.70	60,420,000	0.100	2024/3/20	7.59
日本	国債証券	第419回利付国 債（2年）	60,000,000	100.42	60,255,700	100.39	60,235,200	0.100	2022/12/1	7.57

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	27.85
地方債証券	69.53
合 計	97.38

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2021年 3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	92,558,472,476	44.13
	カナダ	4,297,762,653	2.05
	メキシコ	1,662,208,281	0.79
	ドイツ	16,133,924,519	7.69
	イタリア	20,460,034,051	9.76
	フランス	22,235,018,974	10.60
	オランダ	4,042,036,782	1.93
	スペイン	12,709,224,299	6.06
	ベルギー	5,304,727,147	2.53
	オーストリア	3,168,956,285	1.51
	フィンランド	1,303,414,886	0.62
	アイルランド	1,791,209,546	0.85
	イギリス	14,135,642,897	6.74
	スウェーデン	699,011,734	0.33
	ノルウェー	530,650,267	0.25
	デンマーク	1,064,939,389	0.51
	ポーランド	1,305,552,627	0.62
	オーストラリア	4,935,703,917	2.35
	シンガポール	879,349,776	0.42
	マレーシア	976,993,189	0.47
イスラエル	929,865,776	0.44	

	小計	211,124,699,471	100.66
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,386,260,862	0.66
合計(純資産総額)		209,738,438,609	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		213,507,453,350	101.80

(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	11,170,000	10,845.22	1,211,411,633	10,250.18	1,144,946,032	0.875	2030/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,150,000	10,763.08	1,092,453,412	10,043.47	1,019,412,490	0.625	2030/8/15	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,100,000	10,999.69	1,000,972,035	10,569.34	961,810,424	0.625	2027/11/30	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,590,000	12,623.19	958,100,321	12,192.58	925,417,308	2.875	2028/8/15	0.44
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,720,000	24,323.58	904,837,346	22,935.66	853,206,552	4.500	2041/4/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,480,000	13,085.83	847,962,077	12,396.06	803,264,708	3.125	2028/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,870,000	11,074.57	760,823,135	11,076.40	760,949,013	0.125	2022/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,090,000	12,808.62	780,045,430	12,186.09	742,133,484	2.875	2028/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,320,000	10,792.49	790,010,605	10,086.28	738,316,097	0.625	2030/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,110,000	11,930.73	728,967,712	11,790.39	720,393,318	2.375	2024/8/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,590,000	15,899.74	729,798,069	15,637.91	717,780,280	3.500	2026/4/25	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,440,000	16,644.50	739,016,057	16,092.29	714,497,726	2.500	2030/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	12,676.72	741,588,516	12,090.52	707,295,781	2.750	2028/2/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,720,000	15,540.21	733,498,107	14,970.50	706,608,023	1.500	2031/5/25	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,160,000	13,791.78	711,655,961	13,657.76	704,740,606	1.750	2023/5/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,300,000	11,680.33	735,861,217	10,946.45	689,626,429	1.500	2030/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,840,000	11,925.97	696,476,915	11,807.26	689,544,256	2.500	2024/5/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,850,000	11,800.08	690,305,159	11,671.25	682,768,431	2.000	2025/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,640,000	12,681.05	715,211,281	11,989.54	676,210,420	2.625	2029/2/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,280,000	16,030.37	686,099,957	15,666.86	670,541,608	2.750	2027/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,190,000	10,872.85	673,029,442	10,806.33	668,912,033	0.375	2026/1/31	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,100,000	22,484.60	697,022,833	21,540.19	667,745,989	5.750	2032/10/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	11,066.67	664,000,474	11,075.32	664,519,460	0.125	2022/7/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,120,000	10,483.28	746,410,239	9,253.79	658,870,440	1.625	2050/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,600,000	10,251.91	779,145,597	8,663.05	658,392,370	1.375	2050/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,570,000	12,070.84	672,346,327	11,802.29	657,387,579	2.250	2025/11/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,950,000	11,011.32	655,173,563	11,014.77	655,379,365	0.125	2024/2/15	0.31
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	3,440,000	19,661.19	676,345,122	19,046.16	655,188,044	5.500	2029/4/25	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,550,000	12,249.45	679,844,803	11,748.01	652,014,949	2.250	2027/8/15	0.31
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	5,480,000	11,900.02	652,121,505	11,797.10	646,481,162	2.750	2023/11/15	0.31

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	100.66
合 計	100.66

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	849,014,000.00	93,331,854,315	93,951,889,240	44.79
	カナダドル	売建	49,486,000.00	4,321,275,875	4,342,396,500	2.07
	メキシコペソ	売建	329,190,000.00	1,751,672,660	1,761,166,500	0.84
	ユーロ	売建	677,420,000.00	87,659,164,130	87,949,438,600	41.93
	英ポンド	売建	92,996,000.00	14,082,800,902	14,151,201,320	6.75
	スウェーデンクローナ	売建	55,943,000.00	708,120,899	709,357,240	0.34
	ノルウェークローネ	売建	41,618,000.00	535,041,008	538,953,100	0.26
	デンマーククローネ	売建	61,518,000.00	1,070,032,403	1,073,489,100	0.51
	ポーランドズロチ	売建	47,538,000.00	1,318,124,156	1,323,933,300	0.63
	オーストラリアドル	売建	58,459,000.00	4,917,395,703	4,929,847,470	2.35
	シンガポールドル	売建	10,994,000.00	896,352,913	903,816,740	0.43
	マレーシアリングット	売建	35,410,000.00	928,439,577	943,322,400	0.45
	イスラエルシェケル	売建	27,988,000.00	922,974,270	928,641,840	0.44

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	13,929,736,937	43.16
	カナダ	638,612,377	1.98
	メキシコ	250,581,956	0.78
	ドイツ	2,420,479,262	7.50
	イタリア	3,079,870,763	9.54
	フランス	3,343,789,080	10.36

	オランダ	602,721,416	1.87
	スペイン	1,911,743,237	5.92
	ベルギー	796,794,168	2.47
	オーストリア	483,649,637	1.50
	フィンランド	200,332,593	0.62
	アイルランド	272,415,746	0.84
	イギリス	2,126,575,593	6.59
	スウェーデン	109,505,160	0.34
	ノルウェー	84,089,063	0.26
	デンマーク	159,548,467	0.49
	ポーランド	203,691,044	0.63
	オーストラリア	734,849,031	2.28
	シンガポール	136,447,600	0.42
	マレーシア	159,019,206	0.49
	イスラエル	147,176,640	0.46
	小計	31,791,628,976	98.50
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		482,781,398	1.50
合計(純資産総額)		32,274,410,374	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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,580,000	11,072.10	285,660,363	11,071.00	285,631,800	0.125	2022/11/30	0.89
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	11,058.02	276,450,648	11,025.59	275,639,780	0.125	2023/12/15	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,100,000	11,012.51	231,262,850	10,840.93	227,659,534	0.375	2025/11/30	0.71
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,960,000	10,897.26	213,586,344	10,595.94	207,680,446	0.500	2027/5/31	0.64
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,621.24	171,001,974	10,043.47	161,699,912	0.625	2030/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	11,072.77	158,340,630	11,069.26	158,290,555	0.125	2022/12/31	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	12,041.44	156,538,743	11,802.29	153,429,776	2.250	2025/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,371.12	151,235,989	11,340.85	150,833,380	1.625	2022/11/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,015.42	146,505,134	11,014.77	146,496,564	0.125	2024/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	12,726.89	148,904,645	12,192.58	142,653,260	2.875	2028/8/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,390,000	10,829.68	150,532,633	10,250.18	142,477,617	0.875	2030/11/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	11,284.06	153,463,250	10,152.88	138,079,239	2.000	2050/2/15	0.43
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	950,000	13,706.93	130,215,853	13,657.76	129,748,755	1.750	2023/5/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,992.72	129,714,137	10,810.00	127,558,103	0.250	2025/9/30	0.40
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	850,000	15,347.83	130,456,638	14,970.50	127,249,327	1.500	2031/5/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,100,000	11,551.59	127,067,573	11,525.29	126,778,293	2.375	2023/1/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,140,000	11,098.67	126,524,923	11,069.70	126,194,608	0.250	2023/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,180,000	10,980.82	129,573,677	10,569.34	124,718,274	0.625	2027/11/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	11,885.32	125,984,422	11,677.95	123,786,362	2.000	2025/8/15	0.38

フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	780,000	15,888.30	123,928,757	15,666.86	122,201,508	2.750	2027/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,130,000	10,970.23	123,963,669	10,616.69	119,968,702	0.500	2027/4/30	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	520,000	24,355.67	126,649,495	22,935.66	119,265,432	4.500	2041/4/25	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	620,000	19,452.86	120,607,772	19,046.16	118,086,217	5.500	2029/4/25	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,701.54	117,015,433	11,632.33	116,323,339	2.000	2024/5/31	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	880,000	13,320.14	117,217,278	13,124.53	115,495,884	0.000	2029/11/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	710,000	16,478.59	116,997,992	16,092.29	114,255,265	2.500	2030/5/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,060,000	10,898.01	115,518,966	10,498.42	111,283,264	0.500	2027/10/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	890,000	12,960.42	115,347,748	12,396.06	110,324,936	3.125	2028/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	980,000	11,713.32	114,790,568	11,214.57	109,902,847	1.750	2029/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,000,000	11,000.50	110,005,087	10,824.71	108,247,134	0.250	2025/8/31	0.34

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	98.50
合計	98.50

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R A M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	1,230,768,911	23.19
	アイルランド	4,066,096,299	76.60
	小計	5,296,865,210	99.78
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,558,048	0.22
合計（純資産総額）		5,308,423,258	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アイルランド	投資信託受益証券	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	675,137	6,402.46	4,322,539,881	6,022.62	4,066,096,299	76.60
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	365,332	3,601.39	1,315,705,313	3,368.90	1,230,768,911	23.19

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.78
合計	99.78

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

該当事項はありません。

R A M国内株式E S Gマザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	1,034,993,740	88.73
投資証券	日本	13,354,900	1.14
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		118,114,460	10.13
合計(純資産総額)		1,166,463,100	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	113,332,000	9.72

(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	8,100	7,369.43	59,692,439	8,616.00	69,789,600	5.98
日本	株式	ソニー	電気機器	4,800	9,910.68	47,571,264	11,595.00	55,656,000	4.77
日本	株式	キーエンス	電気機器	700	51,615.73	36,131,011	50,270.00	35,189,000	3.02
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	5,200	4,604.25	23,942,137	5,401.00	28,085,200	2.41
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	600	35,501.45	21,300,871	46,790.00	28,074,000	2.41
日本	株式	信越化学工業	化学	1,400	16,596.81	23,235,537	18,610.00	26,054,000	2.23
日本	株式	任天堂	その他製品	400	55,160.00	22,064,000	61,810.00	24,724,000	2.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	1,000	23,551.38	23,551,387	22,320.00	22,320,000	1.91
日本	株式	KDDI	情報・通信業	6,200	3,040.45	18,850,836	3,395.00	21,049,000	1.80
日本	株式	第一三共	医薬品	6,500	3,636.78	23,639,130	3,225.00	20,962,500	1.80
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	5,000	3,247.59	16,237,958	4,007.00	20,035,000	1.72
日本	株式	村田製作所	電気機器	2,200	8,741.24	19,230,730	8,842.00	19,452,400	1.67
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	5,200	2,798.43	14,551,850	3,587.00	18,652,400	1.60
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	200	83,680.00	16,736,000	88,130.00	17,626,000	1.51
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	11,000	1,298.99	14,288,890	1,438.50	15,823,500	1.36
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	4,900	2,507.41	12,286,316	2,842.00	13,925,800	1.19
日本	株式	花王	化学	1,900	7,863.15	14,939,998	7,313.00	13,894,700	1.19
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	800	17,876.51	14,301,212	16,625.00	13,300,000	1.14
日本	株式	富士通	電気機器	800	13,843.87	11,075,097	16,000.00	12,800,000	1.10
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	2,400	5,496.25	13,191,018	5,265.00	12,636,000	1.08
日本	株式	デンソー	輸送用機器	1,700	5,334.73	9,069,054	7,347.00	12,489,900	1.07
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	7,200	1,611.24	11,600,938	1,702.00	12,254,400	1.05
日本	株式	パナソニック	電気機器	8,500	1,146.79	9,747,748	1,423.50	12,099,750	1.04
日本	株式	三菱電機	電気機器	7,000	1,550.63	10,854,472	1,686.50	11,805,500	1.01
日本	株式	中外製薬	医薬品	2,600	4,708.87	12,243,087	4,489.00	11,671,400	1.00
日本	株式	小松製作所	機械	3,400	2,683.28	9,123,158	3,419.00	11,624,600	1.00
日本	株式	資生堂	化学	1,500	7,421.33	11,132,005	7,422.00	11,133,000	0.95
日本	株式	クボタ	機械	3,900	2,152.33	8,394,117	2,519.50	9,826,050	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	1,200	6,760.65	8,112,787	7,839.00	9,406,800	0.81
日本	株式	オリックス	その他金融業	5,000	1,632.57	8,162,868	1,868.00	9,340,000	0.80

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.05
		鉱業	0.25
		建設業	2.69
		食料品	2.25
		繊維製品	0.44
		パルプ・紙	0.10

	化学	8.09
	医薬品	6.62
	石油・石炭製品	0.68
	ガラス・土石製品	0.61
	鉄鋼	0.17
	非鉄金属	0.50
	機械	5.49
	電気機器	19.44
	輸送用機器	7.26
	精密機器	0.45
	その他製品	2.73
	電気・ガス業	1.30
	陸運業	3.79
	海運業	0.19
	情報・通信業	5.31
	卸売業	2.38
	小売業	3.60
	銀行業	2.76
	保険業	2.95
	その他金融業	1.66
	不動産業	1.86
	サービス業	5.09
投資証券		1.14
合計		89.87

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	ミニTOPIX先物	買建	58	日本円	111,710,230	113,332,000	9.72

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

RAM先進国株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	874,742,174	61.90
	カナダ	57,807,177	4.09
	ドイツ	43,306,114	3.06
	イタリア	8,231,912	0.58
	フランス	45,604,378	3.23
	オランダ	32,288,301	2.28
	スペイン	12,025,954	0.85
	ベルギー	2,991,519	0.21
	オーストリア	1,178,864	0.08
	ルクセンブルク	337,416	0.02
	フィンランド	4,640,855	0.33
	アイルランド	37,311,988	2.64
	ポルトガル	366,210	0.03
	イギリス	51,809,055	3.67
	スイス	43,911,768	3.11
	スウェーデン	16,199,376	1.15
	ノルウェー	2,552,792	0.18
	デンマーク	15,776,899	1.12
	ケイマン	146,672	0.01
	リベリア	907,113	0.06
	オーストラリア	29,712,683	2.10
	バミューダ	4,542,914	0.32
	ニュージーランド	1,972,728	0.14
	香港	7,794,651	0.55
	シンガポール	5,623,933	0.40
	イスラエル	1,138,431	0.08
	キュラソー	2,181,793	0.15
ジャージー	5,723,541	0.41	
小計	1,310,827,211	92.76	
投資証券	アメリカ	25,565,693	1.81
	カナダ	137,310	0.01
	フランス	1,691,342	0.12
	イギリス	1,308,112	0.09
	オーストラリア	3,088,600	0.22
	シンガポール	1,256,008	0.09
小計	33,047,065	2.34	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		69,238,490	4.90
合計（純資産総額）		1,413,112,766	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	39,334,485	2.78
	買建	ドイツ	11,058,960	0.78

(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		1,107,000	0.08
	売建		16,750,830	1.19

(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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3,628	24,019.11	87,141,362	25,668.11	93,123,916	6.59
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	152	199,973.79	30,396,017	226,564.69	34,437,833	2.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	150	200,814.96	30,122,245	227,568.83	34,135,325	2.42
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	384	63,881.75	24,530,592	70,369.48	27,021,884	1.91
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	1,333	16,191.83	21,583,714	18,268.25	24,351,587	1.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	857	23,266.45	19,939,354	23,459.44	20,104,748	1.42
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	919	17,432.69	16,020,645	20,540.02	18,876,284	1.34
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,257	15,056.09	18,925,516	14,995.66	18,849,557	1.33
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	547	30,002.05	16,411,122	33,746.62	18,459,402	1.31
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	451	38,092.41	17,179,678	39,656.32	17,885,001	1.27
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	313	57,993.26	18,151,891	57,001.25	17,841,394	1.26
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	2,069	5,403.86	11,180,598	7,059.97	14,607,092	1.03
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	215	48,730.77	10,477,117	67,015.73	14,408,384	1.02
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	2,109	6,615.69	13,952,503	6,486.49	13,680,026	0.97
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	356	35,248.42	12,548,440	35,687.18	12,704,637	0.90
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	244	51,167.40	12,484,847	51,531.07	12,573,583	0.89

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	2,153	4,763.85	10,256,582	5,731.45	12,339,826	0.87
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,081	5,811.60	12,093,945	5,884.23	12,245,096	0.87
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	706	15,639.45	11,041,454	15,780.60	11,141,106	0.79
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,286	8,742.32	11,242,625	8,520.24	10,957,031	0.78
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	462	28,038.69	12,953,878	23,249.09	10,741,084	0.76
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	897	11,577.64	10,385,152	11,822.72	10,604,981	0.75
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	322	27,697.44	8,918,578	30,838.27	9,929,923	0.70
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	464	17,911.26	8,310,826	20,585.41	9,551,634	0.68
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	379	24,048.30	9,114,307	24,907.53	9,439,956	0.67
アメリカ	株式	NIKE INC -CL B	耐久消費財・アパレル	641	14,915.52	9,560,853	14,718.89	9,434,811	0.67
アメリカ	株式	UNION PACIFIC CORP	運輸	344	23,052.14	7,929,939	24,481.30	8,421,568	0.60
イギリス	株式	UNILEVER PLC	家庭用品・パーソナル用品	1,350	6,434.87	8,687,087	6,183.58	8,347,836	0.59
アイルランド	株式	LINDE PLC	素材	268	28,115.90	7,535,063	30,916.87	8,285,722	0.59
アメリカ	株式	AMGEN INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	297	24,498.71	7,276,118	27,649.82	8,211,997	0.58

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	2.12
		素材	4.64
		資本財	6.44
		商業・専門サービス	1.09
		運輸	2.56
		自動車・自動車部品	2.49
		耐久消費財・アパレル	2.34
		消費者サービス	1.85
		メディア・娯楽	7.15
		小売	4.81
		食品・生活必需品小売り	0.67
		食品・飲料・タバコ	2.61
		家庭用品・パーソナル用品	3.58

	ヘルスケア機器・サービス	3.76
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.97
	銀行	5.04
	各種金融	4.54
	保険	4.49
	不動産	0.26
	ソフトウェア・サービス	14.29
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.35
	電気通信サービス	1.85
	公益事業	2.06
	半導体・半導体製造装置	4.79
投資証券		2.34
合計		95.10

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2106	買建	18	米ドル	350,903.75	38,848,553	355,293	39,334,485	2.78
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002106	買建	4	ユーロ	83,595	10,850,631	85,200	11,058,960	0.78

(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	10,000.00	1,096,258	1,107,000	0.08
	米ドル	売建	108,000.00	11,955,751	11,955,600	0.85
	カナダドル	売建	17,000.00	1,492,295	1,492,090	0.11
	ユーロ	売建	10,000.00	1,297,820	1,298,000	0.09
	英ポンド	売建	7,000.00	1,065,472	1,065,540	0.08
	スイスフラン	売建	8,000.00	939,496	939,600	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	42,905,456	0.31
	アルゼンチン	1,387,717	0.01
	メキシコ	200,347,783	1.43
	ブラジル	510,621,170	3.64
	チリ	66,558,035	0.47
	コロンビア	18,731,603	0.13
	ペルー	3,563,250	0.03
	オランダ	34,513,677	0.25
	ルクセンブルク	23,649,150	0.17
	ギリシャ	12,082,089	0.09
	トルコ	33,309,535	0.24
	チェコ	11,376,536	0.08
	キプロス	9,964,930	0.07
	ハンガリー	24,421,212	0.17
	ポーランド	66,908,244	0.48
	ロシア	303,949,328	2.17
	ケイマン	2,913,498,851	20.79
	パミュダ	88,892,534	0.63
	香港	143,025,250	1.02
	シンガポール	3,765,412	0.03
	マレーシア	162,350,324	1.16
	タイ	219,021,172	1.56
	フィリピン	75,791,983	0.54
	インドネシア	146,356,999	1.04
	韓国	1,565,940,652	11.17
	台湾	1,605,586,492	11.46
	中国	1,302,826,147	9.30
	インド	1,139,877,408	8.13
	カタール	78,945,801	0.56
	エジプト	7,668,040	0.05
	南アフリカ	430,357,488	3.07
	ジャージー	6,451,469	0.05
	英ヴァージン諸島	4,287,123	0.03
アラブ首長国連邦	67,129,002	0.48	
マン島	4,174,774	0.03	
クウェート	58,808,535	0.42	
サウジアラビア	313,466,845	2.24	
小計		11,702,512,016	83.50
投資証券	メキシコ	5,992,545	0.04
	南アフリカ	4,867,660	0.03
	小計		10,860,205

コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,301,585,860	16.42
合計(純資産総額)		14,014,958,081	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	2,356,661,628	16.82

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

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		889,960,469	6.35
	売建		42,972	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	322,700	2,518.12	812,597,324	2,316.36	747,489,372	5.33
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	75,400	9,839.84	741,923,936	8,679.28	654,417,712	4.67
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	小売	24,830	28,631.82	710,928,095	25,380.26	630,192,042	4.50
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	62,558	8,489.03	531,057,364	8,039.15	502,913,771	3.59
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	47,200	5,414.04	255,543,066	4,180.86	197,336,781	1.41
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	5,730	26,444.87	151,529,162	26,270.50	150,530,022	1.07
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,273,000	86.29	109,852,771	93.98	119,641,632	0.85
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	37,549	3,115.39	116,979,854	3,084.53	115,821,242	0.83
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	11,420	10,507.48	119,995,492	9,188.93	104,937,581	0.75
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	78,500	1,388.40	108,989,400	1,332.15	104,573,932	0.75
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	44,914	2,038.09	91,538,864	2,105.65	94,573,434	0.67
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	7,150	12,567.30	89,856,195	13,154.10	94,051,815	0.67
ブラジル	株式	VALE SA	素材	48,800	1,785.13	87,114,696	1,859.86	90,761,227	0.65
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	22,428	3,935.96	88,275,801	3,960.58	88,828,068	0.63
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	3,550	27,981.95	99,335,932	24,160.24	85,768,864	0.61

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	162,800	471.42	76,747,176	502.46	81,800,488	0.58
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	10,879	7,589.27	82,563,777	7,237.20	78,733,499	0.56
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	5,100	19,028.54	97,045,569	14,994.56	76,472,268	0.55
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	20,000	3,557.96	71,159,200	3,767.48	75,349,600	0.54
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	16,900	6,858.48	115,908,388	4,157.16	70,256,012	0.50
ケイマン	株式	XIAOMI CORP-CLASS B	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	188,000	424.35	79,778,176	364.54	68,534,272	0.49
中国	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	810,000	71.76	58,133,376	79.17	64,131,264	0.46
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	5,510	12,926.49	71,225,013	11,392.05	62,770,245	0.45
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	67,302	811.37	54,607,227	899.00	60,504,767	0.43
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,629	33,594.29	54,725,114	36,821.69	59,982,549	0.43
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	35,132	1,579.83	55,502,648	1,705.48	59,917,189	0.43
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	12,388	5,020.71	62,196,580	4,800.99	59,474,738	0.42
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	42,500	1,710.49	72,695,967	1,399.08	59,460,900	0.42
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	77,193	631.04	48,712,411	652.96	50,404,526	0.36
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	5,418	8,429.45	45,670,811	8,952.01	48,501,993	0.35

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	4.01
		素材	6.68
		資本財	2.16
		商業・専門サービス	0.28
		運輸	1.14
		自動車・自動車部品	2.76
		耐久消費財・アパレル	1.21
		消費者サービス	1.15
		メディア・娯楽	7.71
		小売	9.61
		食品・生活必需品小売り	1.01
		食品・飲料・タバコ	2.83
		家庭用品・パーソナル用品	0.89
		ヘルスケア機器・サービス	1.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.72
銀行	11.08		

	各種金融	1.74
	保険	2.41
	不動産	1.74
	ソフトウェア・サービス	2.08
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.84
	電気通信サービス	2.06
	公益事業	1.67
	半導体・半導体製造装置	7.73
投資証券		0.08
合計		83.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	地域	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等 (各通貨)	契約額等(円)	評価額 (各通貨)	評価額(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIEMG 2106	買建	324	米ドル	21,564,560	2,387,412,442	21,286,800	2,356,661,628	16.82

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

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	8,039,389.97	883,311,310	889,960,469	6.35
	ブラジルリアル	売建	2,242.80	42,613	42,972	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R A M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	27,270,181,180	97.25
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		770,845,712	2.75
合計(純資産総額)		28,041,026,892	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	747,678,500	2.67

(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	2,833	605,789.29	1,716,201,063	651,000	1,844,283,000	6.58
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,517	615,086.32	1,548,172,274	653,000	1,643,601,000	5.86
日本	投資証券	G L P 投資法人	7,865	171,034.84	1,345,189,022	181,800	1,429,857,000	5.10
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	12,537	97,705.66	1,224,935,954	113,100	1,417,934,700	5.06
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3,979	332,919.67	1,324,687,376	355,500	1,414,534,500	5.04
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,139	156,203.74	1,271,342,260	166,400	1,354,329,600	4.83
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,591	274,561.33	985,949,751	297,100	1,066,886,100	3.80
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,015	173,394.82	869,575,052	192,400	964,886,000	3.44
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,391	309,143.04	739,161,030	347,000	829,677,000	2.96
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,383	136,736.66	736,053,451	148,600	799,913,800	2.85
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,403	76,513.88	566,432,319	92,000	681,076,000	2.43
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,558	190,872.55	679,124,556	189,900	675,664,200	2.41
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,567	366,662.4	574,559,989	413,000	647,171,000	2.31
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	779	669,107.9	521,235,061	787,000	613,073,000	2.19
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,261	426,519.04	537,840,522	485,500	612,215,500	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	867	567,324.99	491,870,768	649,000	562,683,000	2.01
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,645	310,780.16	511,233,377	312,000	513,240,000	1.83
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,109	54,797.6	444,353,762	62,300	505,190,700	1.80
日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	878	524,644.11	460,637,535	547,000	480,266,000	1.71
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	2,805	163,387.94	458,303,181	167,800	470,679,000	1.68
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	2,957	146,549.95	433,348,220	153,300	453,308,100	1.62
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	10,525	36,213.79	381,150,207	41,750	439,418,750	1.57
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	536	666,608.12	357,301,955	779,000	417,544,000	1.49
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	835	425,694.87	355,455,219	471,500	393,702,500	1.40
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,132	299,570.96	339,114,335	337,500	382,050,000	1.36
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,553	138,995.96	354,856,694	149,000	380,397,000	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	1,715	185,337.4	317,853,658	216,000	370,440,000	1.32
日本	投資証券	プレミアム投資法人	2,273	131,241	298,310,796	158,100	359,361,300	1.28
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,287	98,410.04	323,473,812	108,600	356,968,200	1.27
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,026	157,906.81	319,919,214	173,300	351,105,800	1.25

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	97.25
合 計	97.25

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	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	373	日本円	701,875,330	747,678,500	2.67

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

RAM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 3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	11,623,387	0.05
	オーストラリア	17,644,737	0.07
	小計	29,268,124	0.12
投資証券	アメリカ	18,042,224,927	73.55
	カナダ	471,121,812	1.92
	ドイツ	66,821,624	0.27
	イタリア	4,925,288	0.02
	フランス	569,227,555	2.32
	オランダ	50,402,342	0.21
	スペイン	112,081,633	0.46
	ベルギー	314,857,007	1.28
	アイルランド	32,236,384	0.13
	イギリス	1,346,953,268	5.49
	オーストラリア	1,695,253,434	6.91
	ニュージーランド	110,917,475	0.45
	香港	401,896,089	1.64
	シンガポール	984,899,904	4.02
	韓国	35,243,449	0.14
	イスラエル	15,006,667	0.06
	ガーナ	63,216,319	0.26
	マン島	8,950,150	0.04

	小計	24,326,235,327	99.17
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		173,472,234	0.71
合計(純資産総額)		24,528,975,685	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		82,897,070	0.34
	売建		1,544,614,040	6.30

(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	120,343	11,279.13	1,357,364,919	11,819.39	1,422,382,006	5.80
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	14,515	79,563.95	1,154,870,817	74,711.53	1,084,437,951	4.42
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	45,672	15,555.86	710,467,334	15,636.68	714,158,467	2.91
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	53,345	10,780.93	575,109,234	12,774.82	681,473,141	2.78
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	24,699	24,883.17	614,589,652	27,348.69	675,485,326	2.75
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	67,767	7,062.19	478,583,491	8,074.08	547,156,200	2.23
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,678	18,479.71	419,082,936	20,743.73	470,426,370	1.92
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	55,722	6,930.44	386,178,312	8,063.00	449,287,004	1.83
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	60,629	6,666.95	404,210,887	7,098.72	430,388,610	1.75
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	273,219	1,494.01	408,193,448	1,521.85	415,799,537	1.70
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,655	18,674.56	385,723,094	18,407.75	380,212,111	1.55
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	60,761	5,472.39	332,508,211	6,058.05	368,093,249	1.50
香港	投資証券	LINK REIT	337,300	980.28	330,648,983	1,033.82	348,708,835	1.42
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	92,142	3,339.01	307,663,391	3,570.39	328,983,566	1.34
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,558	27,350.90	288,770,860	30,790.66	325,087,843	1.33
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,405	12,925.39	276,668,026	14,724.42	315,176,424	1.28
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	87,481	3,353.40	293,359,302	3,540.50	309,726,988	1.26
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,579	14,963.56	278,008,048	16,312.01	303,060,860	1.24
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,128	16,327.51	295,985,116	16,586.57	300,681,381	1.23
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	61,055	4,472.68	273,079,722	4,702.96	287,139,272	1.17
イギリス	投資証券	SEGR0 PLC	192,944	1,473.58	284,319,655	1,437.05	277,270,407	1.13
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	87,062	2,939.35	255,905,733	3,123.12	271,905,866	1.11
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	23,020	10,211.89	235,077,717	11,404.23	262,525,538	1.07
アメリカ	投資証券	UDR INC	48,183	4,380.79	211,079,831	4,915.52	236,844,693	0.97
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	28,449	7,479.56	212,786,219	7,826.08	222,644,432	0.91
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	93,979	2,381.37	223,798,968	2,350.37	220,885,732	0.90
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	114,259	1,624.11	185,569,835	1,915.28	218,838,320	0.89
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,404	7,604.98	170,382,016	8,984.75	201,294,473	0.82

オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	840,769	238.73	200,724,182	237.05	199,305,637	0.81
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	27,506	7,001.30	192,577,769	7,165.15	197,084,649	0.80

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	不動産	0.12
投資証券			99.17
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	570,000.00	63,095,979	63,099,000	0.26
	カナダドル	買建	20,000.00	1,755,566	1,755,400	0.01
	ユーロ	買建	31,000.00	4,023,490	4,023,800	0.02
	英ポンド	買建	25,000.00	3,805,125	3,805,500	0.02
	オーストラリアドル	買建	85,000.00	7,169,750	7,169,750	0.03
	シンガポールドル	買建	37,000.00	3,043,312	3,043,620	0.01
	米ドル	売建	10,370,000.00	1,139,144,500	1,147,959,000	4.68
	カナダドル	売建	342,000.00	29,826,504	30,017,340	0.12
	ユーロ	売建	564,000.00	72,902,640	73,207,200	0.30
	英ポンド	売建	650,000.00	98,270,900	98,943,000	0.40
	オーストラリアドル	売建	1,316,000.00	110,300,540	111,004,600	0.45
	香港ドル	売建	1,790,000.00	25,294,490	25,489,600	0.10
	シンガポールドル	売建	705,000.00	57,403,920	57,993,300	0.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

< 更新後 >

運用実績

2021年3月31日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口当たり、税引前)

	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
	-	-
設定来累計		0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RAM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)	16.9
RAM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	39.6
RAM先進国債券マザーファンド	3.4
RAM新興国債券マザーファンド	1.9
RAM国内株式ESGマザーファンド	5.9
RAM先進国株式ESGマザーファンド	21.9
RAM新興国株式マザーファンド	3.9
RAM国内リートマザーファンド	2.0
RAM先進国リートマザーファンド	4.0
その他	0.5
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	65.2
米ドル	20.9
ユーロ	4.3
英ポンド	1.3
カナダドル	1.0
その他	7.3
合計	100.0

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

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期間	比率(%)
国内債券	日本	令和2年度第7回埼玉県公債	2030/10/16	18.8
	日本	平成27年度第6回埼玉県公債	2025/9/29	12.8
	日本	平成24年度第7回埼玉県公債	2022/11/28	12.7
先進国債券(為替ヘッジあり)	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/11/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/8/15	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2027/11/30	0.5
	アメリカ	US TREASURY N/B	2022/11/30	0.9
	アメリカ	US TREASURY N/B	2023/12/15	0.9
	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/11/30	0.7
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	-	76.6
	アメリカ	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	-	23.2
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	-	6.0
	日本	ソニー	-	4.8
	日本	キーエンス	-	3.0
	アメリカ	MICROSOFT CORP	-	6.6
先進国株式ESG	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	-	2.4
	アメリカ	ALPHABET INC-CL C	-	2.4
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	-	5.3
	中国	TENCENT HOLDINGS LTD	-	4.7
	中国	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	-	4.5
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	-	6.6
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	-	5.9
	日本	GLP投資法人	-	5.1
	アメリカ	PROLOGIS INC	-	5.8
先進国リート	アメリカ	EQUINIX INC	-	4.4
	アメリカ	DIGITAL REALTY TRUST INC	-	2.9

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。
※2020年9月25日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は9月25日から12月末までの騰落率です。2021年は3月末までの騰落率です。
※年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3および第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間(2020年9月25日から2021年3月24日まで)の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期中間計算期間末 2021年3月24日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	56,661,705
親投資信託受益証券	4,520,874,636
流動資産合計	4,577,536,341
資産合計	4,577,536,341
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,889,032
未払受託者報酬	556,089
未払委託者報酬	14,272,942
未払利息	153
その他未払費用	144,493
流動負債合計	19,862,709
負債合計	19,862,709
純資産の部	
元本等	
元本	4,270,721,217
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	286,952,415
(分配準備積立金)	-
元本等合計	4,557,673,632
純資産合計	4,557,673,632
負債純資産合計	4,577,536,341

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期中間計算期間 自 2020年9月25日 至 2021年3月24日
営業収益	
有価証券売買等損益	223,109,636
営業収益合計	223,109,636
営業費用	
支払利息	28,783
受託者報酬	556,089

	第1期中間計算期間 自 2020年 9月25日 至 2021年 3月24日
委託者報酬	14,272,942
その他費用	144,493
営業費用合計	15,002,307
営業利益又は営業損失（ ）	208,107,329
経常利益又は経常損失（ ）	208,107,329
中間純利益又は中間純損失（ ）	208,107,329
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	13,036,758
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	94,515,156
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	94,515,156
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,633,312
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,633,312
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	286,952,415

(3) 【中間注記表】

(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	当ファンドの中間計算期間は、信託約款の規定により、設定日（2020年 9月25日）から2021年 3月24日までとなっております。

(中間貸借対照表に関する注記)

	第1期中間計算期間末 2021年 3月24日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	2,185,671,585円
期中追加設定元本額	2,460,648,472円
期中一部解約元本額	375,598,840円
2. 中間計算期間の末日における受益権の総数	4,270,721,217口
3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0672円
(10,000口当たり純資産額)	(10,672円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間末 2021年 3月24日現在
<p>1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額は ありません。</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 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。</p>

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RAM国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

貸借対照表

(単位：円)

2021年 3月24日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	21,162,366
国債証券	211,558,200
地方債証券	554,031,000
未収利息	570,555
前払費用	163,533
流動資産合計	787,485,654
資産合計	787,485,654
負債の部	
流動負債	
未払金	10,092,700
未払利息	57
流動負債合計	10,092,757
負債合計	10,092,757
純資産の部	
元本等	
元本	779,064,205
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,671,308
元本等合計	777,392,897
純資産合計	777,392,897
負債純資産合計	787,485,654

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 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 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	372,063,000円
期中追加設定元本額	421,457,097円
期中一部解約元本額	14,455,892円
期末元本額	779,064,205円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S G	779,064,205円
2. 計算日における受益権の総数	779,064,205口
3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	1,671,308円

4. 計算日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	0.9979円
(10,000口当たり純資産額)	(9,979円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24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	
(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。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

R A M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

貸借対照表

(単位：円)

2021年 3月24日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	194,722,335
コール・ローン	1,807,038,912
国債証券	207,493,037,477

2021年 3月24日現在

派生商品評価勘定	485,552,403
未収入金	1,224,672,468
未収利息	1,116,689,241
前払費用	103,152,799
流動資産合計	212,424,865,635
資産合計	212,424,865,635
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,262,292,994
未払金	1,549,608,172
未払解約金	1,043,959,000
未払利息	4,901
流動負債合計	4,855,865,067
負債合計	4,855,865,067
純資産の部	
元本等	
元本	200,008,430,355
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,560,570,213
元本等合計	207,569,000,568
純資産合計	207,569,000,568
負債純資産合計	212,424,865,635

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 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日

期首元本額	173,656,637,905円
期中追加設定元本額	73,610,449,271円
期中一部解約元本額	47,258,656,821円
期末元本額	200,008,430,355円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	22,738,453,502円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	11,296,944,244円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,674,115,615円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,812,642,008円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	390,358,623円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	93,176,897円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	70,038,726円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	20,406,692円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	3,041,817円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	770,962円
リスクコントロール・オープン	259,138,418円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	1,758,557,264円
FWりそな円建債券アクティブファンド	292,880,523円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	109,243,980,471円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	835,548,924円
Smart-i 8資産バランス 安定型	619,737,142円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	395,332,167円
Smart-i 8資産バランス 成長型	145,934,080円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	10,013,692,905円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	9,272,436,049円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	5,440,920,839円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	3,558,551,594円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	9,099,212,401円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,523,418,098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)	7,274,637,860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)	11,795,843円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,914,615,469円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	248,091,222円
2. 計算日における受益権の総数	200,008,430,355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	1.0378円
(10,000口当たり純資産額)	(10,378円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在

1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2.時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2021年 3月24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	1,525,180,930	-	1,517,613,469	7,567,461
	米ドル	660,062,772	-	659,612,223	450,549
	カナダドル	54,080,448	-	53,805,654	274,794
	ユーロ	665,669,101	-	660,475,836	5,193,265
	英ポンド	92,048,789	-	91,254,145	794,644
	オーストラリアドル	53,319,820	-	52,465,611	854,209
	売建	207,106,567,490	-	208,875,740,620	1,769,173,130
	米ドル	89,398,679,140	-	91,532,770,560	2,134,091,420
	カナダドル	4,186,839,806	-	4,257,437,900	70,598,094
	メキシコペソ	1,646,156,638	-	1,661,463,790	15,307,152
	ユーロ	86,798,465,050	-	86,549,172,600	249,292,450

英ポンド	13,838,182,798	-	13,773,602,880	64,579,918
スウェーデンク ローナ	716,041,869	-	706,560,090	9,481,779
ノルウェークロー ネ	527,573,117	-	522,305,900	5,267,217
デンマーククロー ネ	1,004,997,515	-	1,003,252,980	1,744,535
ポーランドズロチ	1,360,088,801	-	1,323,457,920	36,630,881
オーストラリアド ル	4,909,174,806	-	4,808,232,440	100,942,366
シンガポールドル	882,855,638	-	886,885,980	4,030,342
マレーシアリン ギット	928,439,577	-	929,512,500	1,072,923
イスラエルシケ ル	909,072,735	-	921,085,080	12,012,345
合計	208,631,748,420	-	210,393,354,089	1,776,740,591

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

RAM先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 3月24日現在

資産の部	
流動資産	
預金	100,597,510
コール・ローン	133,346,752
国債証券	32,277,283,858
派生商品評価勘定	4,600,032
未収入金	885,608,134
未収利息	176,230,819
前払費用	18,034,362

2021年 3月24日現在

流動資産合計	33,595,701,467
資産合計	33,595,701,467
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,025,320,000
未払利息	361
流動負債合計	1,025,320,361
負債合計	1,025,320,361
純資産の部	
元本等	
元本	30,489,433,748
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,080,947,358
元本等合計	32,570,381,106
純資産合計	32,570,381,106
負債純資産合計	33,595,701,467

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 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	26,062,017,228円
期中追加設定元本額	7,598,061,655円
期中一部解約元本額	3,170,645,135円
期末元本額	30,489,433,748円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	3,284,832,563円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	553,660,144円
りそなラップ型ファンド(成長型)	304,140,030円
DCりそな グローバルバランス	61,095,653円
つみたてバランスファンド	605,112,957円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	949,546,810円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	204,007,381円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	48,728,190円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	36,740,586円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,748,966円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,628,522円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	281,004円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	126,486,395円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	300,421,338円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	158,329,376円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジなし)	21,931,336,771円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	636,115,741円
Smart-i 8資産バランス 安定型	333,624,411円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	195,578,816円
Smart-i 8資産バランス 成長型	79,818,462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)	873,934円
りそなFT 先進国債券インデックス(適格機関投資家専用)	666,325,698円
2. 計算日における受益権の総数	30,489,433,748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	1.0683円
(10,000口当たり純資産額)	(10,683円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2021年 3月24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	938,857,362	-	934,257,330	4,600,032
	米ドル	414,855,274	-	414,575,532	279,742
	カナダドル	20,169,561	-	20,067,075	102,486
	メキシコペソ	9,170,933	-	9,075,820	95,113
	ユーロ	400,084,061	-	396,952,064	3,131,997
	英ポンド	64,426,626	-	63,870,440	556,186
	スウェーデンクローナ	1,313,342	-	1,300,890	12,452
	デンマーククローネ	296,530	-	294,270	2,260
	ポーランドズロチ	2,933,840	-	2,895,360	38,480
	オーストラリアドル	23,415,049	-	23,039,929	375,120
	シンガポールドル	973,004	-	968,280	4,724
	イスラエルシケル	1,219,142	-	1,217,670	1,472
	合計		938,857,362	-	934,257,330

（注）時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 3月24日現在

資産の部	
流動資産	
預金	11,299,029
コール・ローン	55,360,090
投資信託受益証券	5,301,496,467
派生商品評価勘定	118,844
未収入金	68,299,317
流動資産合計	5,436,573,747
資産合計	5,436,573,747
負債の部	
流動負債	
未払解約金	105,612,000
未払利息	150
流動負債合計	105,612,150
負債合計	105,612,150
純資産の部	
元本等	
元本	4,980,907,410
剰余金	
剰余金又は欠損金()	350,054,187
元本等合計	5,330,961,597
純資産合計	5,330,961,597
負債純資産合計	5,436,573,747

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 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	4,968,582,326円
期中追加設定元本額	1,949,359,862円
期中一部解約元本額	1,937,034,778円
期末元本額	4,980,907,410円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	809,803,457円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	542,937,704円
りそなラップ型ファンド(成長型)	297,733,452円
DCりそな グローバルバランス	14,827,478円
つみたてバランスファンド	593,979,734円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	241,654,826円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	126,720,393円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	78,998,453円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	14,937,547円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,390,743円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,344,692円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,107,942円
リスクコントロール・オープン	2,918,139円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	81,315,946円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	85,149,359円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	956,611,742円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,638,101円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	95,161,772円
Smart-i 8資産バランス 成長型	98,740,022円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	225,531,750円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	208,617,613円

りそな・リスクコントロールファンド2019-10	122,541,934円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	80,141,260円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	204,942,939円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,310,684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）	849,728円
2. 計算日における受益権の総数	4,980,907,410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	1.0703円
(10,000口当たり純資産額)	(10,703円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資信託受益証券	（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（通貨関連）

（2021年 3月24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	58,800,770	-	58,681,926	118,844
	米ドル	58,800,770	-	58,681,926	118,844
合計		58,800,770	-	58,681,926	118,844

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R A M国内株式E S Gマザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

2021年 3月24日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	90,557,752
株式	1,015,647,550
投資証券	13,130,100
派生商品評価勘定	435,280
未収入金	15,070
未収配当金	1,008,394
差入委託証拠金	4,653,000
流動資産合計	1,125,447,146
資産合計	
1,125,447,146	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	808,540
前受金	1,960,850
未払解約金	86,000
未払利息	245
流動負債合計	2,855,635
負債合計	
2,855,635	
純資産の部	
元本等	

2021年 3月24日現在

元本	939,764,987
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	182,826,524
元本等合計	1,122,591,511
純資産合計	1,122,591,511
負債純資産合計	1,125,447,146

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 3月24日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	610,917,583円
期中追加設定元本額	385,727,199円
期中一部解約元本額	56,879,795円
期末元本額	939,764,987円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	218,487,021円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	523,635,423円
国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	197,642,543円
2. 計算日における受益権の総数	939,764,987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	1.1945円

(10,000口当たり純資産額)

(11,945円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

(2021年 3月24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	97,936,260	-	97,563,000	373,260
合計		97,936,260	-	97,563,000	373,260

(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。

R A M先進国株式 E S G マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
2021年 3月24日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	96,565,914
コール・ローン	25,039,346
株式	1,270,085,396
投資証券	31,838,401
派生商品評価勘定	6,324
未収入金	24,184
未収配当金	1,684,293
差入委託証拠金	30,741,646
流動資産合計	1,455,985,504
資産合計	1,455,985,504
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,655,833
未払利息	67
流動負債合計	1,655,900
負債合計	1,655,900
純資産の部	
元本等	
元本	1,175,746,201
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	278,583,403
元本等合計	1,454,329,604
純資産合計	1,454,329,604
負債純資産合計	1,455,985,504

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	先物取引

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	211,282,109円
期中追加設定元本額	1,158,416,260円
期中一部解約元本額	193,952,168円
期末元本額	1,175,746,201円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	882,060,461円
Smart-i 先進国株式ESGインデックス	293,685,740円
2. 計算日における受益権の総数	1,175,746,201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	1.2369円
(10,000口当たり純資産額)	(12,369円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

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

ん。

2.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2021年 3月24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	157,239,565	-	155,701,158	1,538,407
	合計	157,239,565	-	155,701,158	1,538,407

（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 3月24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	29,018,792	-	28,907,690	111,102
	米ドル	19,702,378	-	19,662,030	40,348
	カナダドル	1,739,914	-	1,726,200	13,714
	ユーロ	3,365,746	-	3,345,680	20,066
	英ポンド	2,109,441	-	2,089,220	20,221
	スイスフラン	813,848	-	813,890	42
	デンマーククローネ	698,780	-	692,400	6,380
	オーストラリアドル	588,685	-	578,270	10,415
合計	29,018,792	-	28,907,690	111,102	

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

R A M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 3月24日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,801,275,144
コール・ローン	65,144,993
株式	11,499,331,123
投資証券	10,261,445
派生商品評価勘定	657,338
未収入金	19,124,590
未収配当金	22,697,886

2021年 3月24日現在

差入委託証拠金	626,350,666
流動資産合計	14,044,843,185
資産合計	14,044,843,185
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	56,120,318
未払金	2,624,426
未払解約金	391,403,000
未払利息	176
流動負債合計	450,147,920
負債合計	450,147,920
純資産の部	
元本等	
元本	8,243,038,191
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,351,657,074
元本等合計	13,594,695,265
純資産合計	13,594,695,265
負債純資産合計	14,044,843,185

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	7,627,636,469円
期中追加設定元本額	3,119,785,783円
期中一部解約元本額	2,504,384,061円
期末元本額	8,243,038,191円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	527,505,948円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	895,409,236円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,024,643,606円
DCりそな グローバルバランス	9,655,393円
つみたてバランスファンド	386,572,362円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	300,369,527円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	160,767,565円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	98,567,696円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,909,622円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,943,531円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,741,821円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	8,705,572円
リスクコントロール・オープン	7,605,479円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	102,596,524円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	59,782,475円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	1,986,112,614円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,216,806,472円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,456,249円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	108,708,500円
Smart-i 8資産バランス 成長型	128,319,759円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	293,875,361円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	272,061,681円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	159,671,491円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	104,433,850円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	267,038,707円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	44,708,122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)	1,069,028円
2. 計算日における受益権の総数	8,243,038,191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	1.6492円
(10,000口当たり純資産額)	(16,492円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（株式関連）

（2021年 3月24日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,177,768,107	-	2,121,677,275	56,090,832
合計		2,177,768,107	-	2,121,677,275	56,090,832

（注）時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2021年 3月24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	60,842,454	-	60,814,828	27,626
	米ドル	60,842,454	-	60,814,828	27,626
	売建	324,462,820	-	323,807,342	655,478
	米ドル	324,373,000	-	323,717,400	655,600
	カタールリアル	89,820	-	89,942	122
	合計	385,305,274	-	384,622,170	627,852

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

RAM国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 3月24日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	490,982,864
投資証券	26,294,872,330
派生商品評価勘定	29,653,570

2021年 3月24日現在	
未収入金	1,656,363,457
未収配当金	242,957,484
差入委託証拠金	80,621,500
流動資産合計	28,795,451,205
資産合計	28,795,451,205
負債の部	
流動負債	
前受金	31,993,700
未払解約金	1,534,583,000
未払利息	1,331
流動負債合計	1,566,578,031
負債合計	1,566,578,031
純資産の部	
元本等	
元本	19,461,276,030
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	7,767,597,144
元本等合計	27,228,873,174
純資産合計	27,228,873,174
負債純資産合計	28,795,451,205

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 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	16,103,147,715円
期中追加設定元本額	14,264,563,017円
期中一部解約元本額	10,906,434,702円
期末元本額	19,461,276,030円
期末元本の内訳	

りそなラップ型ファンド(安定型)	311,408,277円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	280,290,643円
りそなラップ型ファンド(成長型)	299,683,482円
DCりそな グローバルバランス	5,689,861円
つみたてバランスファンド	929,668,908円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	228,455,111円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	118,833,805円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	73,678,788円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	14,097,296円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	9,699,915円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,866,585円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,400,501円
リスクコントロール・オープン	2,271,694円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	62,975,160円
FWりそな国内リートインデックスオープン	5,017,682,529円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,271,854,839円
Smart-i Jリートインデックス	2,461,901,495円
Smart-i 8資産バランス 安定型	32,151,887円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	94,355,405円
Smart-i 8資産バランス 成長型	91,890,090円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	175,590,855円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	162,608,283円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	95,411,543円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	62,399,520円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	159,556,112円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	26,713,930円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,182,812,315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)	760,201円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	907,378,654円
J-REITインデックス202102(適格機関投資家専用)	2,370,188,346円
2. 計算日における受益権の総数	19,461,276,030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	1.3991円
(10,000口当たり純資産額)	(13,991円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

デリバティブ取引に関する注記

（投資証券関連）

（2021年 3月24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	720,643,430	-	750,297,000	29,653,570
	合計	720,643,430	-	750,297,000	29,653,570

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

R A M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 3月24日現在

資産の部

流動資産

2021年 3月24日現在

預金	32,113,211
コール・ローン	28,263,642
株式	27,955,593
投資証券	25,359,495,281
派生商品評価勘定	2,140
未収入金	2,509,641,064
未収配当金	51,788,516
流動資産合計	28,009,259,447
資産合計	28,009,259,447
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	6,553,140
未払金	1,233,813,650
未払解約金	994,922,000
未払利息	76
流動負債合計	2,235,288,866
負債合計	2,235,288,866
純資産の部	
元本等	
元本	22,620,460,703
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,153,509,878
元本等合計	25,773,970,581
純資産合計	25,773,970,581
負債純資産合計	28,009,259,447

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	外貨建取引等の処理基準

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 3月24日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	22,332,515,594円
期中追加設定元本額	12,043,324,215円
期中一部解約元本額	11,755,379,106円
期末元本額	22,620,460,703円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,946,478,038円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,482,864,900円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,145,545,931円
DCりそな グローバルバランス	35,664,394円
つみたてバランスファンド	566,156,506円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	319,980,070円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	164,751,927円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	99,932,056円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,882,902円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	13,080,034円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,732,380円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	8,826,441円
リスクコントロール・オープン	11,139,330円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	76,306,656円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	7,842,642,134円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,395,052,746円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,457,147,640円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,957,128円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	114,169,393円
Smart-i 8資産バランス 成長型	132,991,862円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	430,422,400円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	398,590,918円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	233,864,643円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	152,960,863円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	391,116,021円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	65,483,954円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	3,578,152円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,066,141,284円
2. 計算日における受益権の総数	22,620,460,703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	1.1394円

(10,000口当たり純資産額)

(11,394円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 3月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 デリバティブ取引 (その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額 が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額 自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 3月24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	1,519,415,641	-	1,512,863,960	6,551,681
	米ドル	1,127,136,572	-	1,124,863,650	2,272,922
	カナダドル	28,585,428	-	28,395,990	189,438
	ユーロ	74,948,203	-	74,248,360	699,843

英ポンド	89,235,297	-	88,344,160	891,137
オーストラリアドル	112,270,696	-	110,284,350	1,986,346
ニュージーランドドル	6,035,764	-	5,924,880	110,884
香港ドル	24,952,040	-	24,884,400	67,640
シンガポールドル	56,251,641	-	55,918,170	333,471
売建	174,387,571	-	174,386,890	681
米ドル	128,183,400	-	128,183,400	-
ユーロ	7,848,992	-	7,849,480	488
英ポンド	17,160,875	-	17,161,450	575
オーストラリアドル	11,567,220	-	11,565,400	1,820
ニュージーランドドル	6,077,120	-	6,076,800	320
シンガポールドル	3,549,964	-	3,550,360	396
合計	1,693,803,212	-	1,687,250,850	6,551,000

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 3月31日現在です。

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

【純資産額計算書】

資産総額	4,705,147,963円
------	----------------

負債総額	1,798,957円
純資産総額（ - ）	4,703,349,006円
発行済口数	4,365,850,667口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0773円

（参考）

R A M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

純資産額計算書

資産総額	805,807,425円
負債総額	10,097,282円
純資産総額（ - ）	795,710,143円
発行済口数	798,220,830口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9969円

R A 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	216,985,423,829円
負債総額	7,246,985,220円
純資産総額（ - ）	209,738,438,609円
発行済口数	202,997,041,085口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0332円

R A M先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	32,274,856,697円
負債総額	446,323円
純資産総額（ - ）	32,274,410,374円
発行済口数	29,909,324,297口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0791円

R A M新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	6,404,029,279円
負債総額	1,095,606,021円
純資産総額（ - ）	5,308,423,258円
発行済口数	4,940,097,658口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0746円

RAM国内株式ESGマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	1,166,816,003円
負債総額	352,903円
純資産総額（ - ）	1,166,463,100円
発行済口数	950,595,315口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2271円

RAM先進国株式ESGマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	1,413,128,678円
負債総額	15,912円
純資産総額（ - ）	1,413,112,766円
発行済口数	1,106,455,739口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2772円

RAM新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	14,065,074,855円
負債総額	50,116,774円
純資産総額（ - ）	14,014,958,081円
発行済口数	8,347,689,827口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6789円

RAM国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	29,808,932,737円
負債総額	1,767,905,845円
純資産総額（ - ）	28,041,026,892円
発行済口数	19,589,788,138口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4314円

RAM先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,350,094,132円
負債総額	1,821,118,447円
純資産総額（ - ）	24,528,975,685円
発行済口数	20,743,128,844口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1825円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2021年3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3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】

<更新後>

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3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	87	909,344
単位型株式投資信託	7	106,695
合計	94	1,016,040

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

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

また、中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。

(2) 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期事業年度（自2019年4月1日至2020年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受け、第6期事業年度に係る中間会計期間（自2020年4月1日至2020年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
預金	1,344,092	2,211,091
前払費用	21,505	186,739
未収入金	238	247
未収委託者報酬	369,524	810,183
未収運用受託報酬	-	1,261,327
未収投資助言報酬	38,188	418,494
流動資産計	1,773,550	4,888,083

固定資産			
有形固定資産			
建物	1	2,791	4,325
器具備品	1	9,167	11,668
有形固定資産計		11,958	15,993
無形固定資産			
ソフトウェア		29,501	18,733
無形固定資産計		29,501	18,733
投資その他の資産			
投資有価証券		599	7,975
長期前払費用		1,416	416
繰延税金資産		34,080	72,304
投資その他の資産計		36,097	80,969
固定資産計		77,557	115,424
資産合計		1,851,107	5,003,507

(単位：千円)

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

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,786,724	3,170,025
運用受託報酬	-	1,201,400
投資助言報酬	35,360	1,166,500
営業収益計	1,822,084	5,537,925
営業費用		
支払手数料	437,713	1,050,201
広告宣伝費	48,845	63,238
調査費		
調査費	192,459	500,578
委託調査費	199,514	128,044
委託計算費	149,138	188,413
営業雑経費		
印刷費	49,857	68,686
協会費	3,294	5,690
販売促進費	5,915	5,255
その他	42,522	55,169
営業費用計	1,129,261	2,065,279
一般管理費		
給料		
役員報酬	65,787	82,651
給料・手当	216,403	490,014
賞与	18,883	3,982
賞与引当金繰入額	36,596	132,198
旅費交通費	8,181	13,634
租税公課	14,129	48,964
不動産賃借料	23,852	48,771
固定資産減価償却費	15,147	16,096
諸経費	72,402	119,502
一般管理費計	471,383	955,815
営業利益	221,439	2,516,831
営業外収益		
受取配当金	-	23
投資有価証券売却益	176	73
雑収入	2	46
営業外収益計	179	142
営業外費用		
雑損失	-	13
営業外費用計	-	13
経常利益	221,618	2,516,960
税引前当期純利益	221,618	2,516,960
法人税、住民税及び事業税	1	
法人税等調整額	49,931	769,705
法人税等計	7,606	38,032
法人税等計	57,538	731,672
当期純利益	164,079	1,785,287

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)

(単位:千円)

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	171,316	171,316	1,318,683
当期変動額						
当期純利益				164,079	164,079	164,079
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)						
当期変動額合計	-	-	-	164,079	164,079	164,079
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763

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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

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

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

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

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

(未適用の会計基準等)

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

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

(1) 概要

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

ステップ1: 顧客との契約を識別する。

ステップ2: 契約における履行義務を識別する。

ステップ3: 取引価格を算定する。

ステップ4: 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5: 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社に対する資産及び負債

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

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する主な取引

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度(2019年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

負債

未払手数料、その他未払金

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	11,202千円	29,592千円
未払事業所税	341千円	655千円
未払事業税	3,323千円	33,577千円
未確定債務	913千円	757千円
減価償却超過額	5,341千円	3,944千円
税務上の繰越欠損金(*1)	54,381千円	3,586千円

その他有価証券評価差額金	0千円	191千円
その他	1,399千円	-
繰延税金資産小計	76,903千円	72,304千円
税務上の繰越欠損金に係る評価性引当額(*1)	37,635千円	-
将来減算一時差異等の合計に係る評価性引当額	5,186千円	-
評価性引当額小計	42,822千円	-
繰延税金資産合計	34,080千円	72,304千円
繰延税金資産の純額	34,080千円	72,304千円

(*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2019年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2020年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

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

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04%
住民税均等割	0.43%
評価性引当額の増減	3.23%
その他	1.89%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>25.96%</u>

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.01%
住民税均等割	0.09%
その他	1.64%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.07%</u>

(企業結合等関係)

共通支配下の取引等

(1) 取引の概要

対象となった事業の名称及びその事業の内容

事業の名称：株式会社りそな銀行の資産運用事業に関して有する権利義務の一部

事業の内容：法人・機関投資家向け資産運用サービスの提供

企業結合日

2020年1月1日

企業結合の法的形式

株式会社りそな銀行（当社の親会社の連結子会社）を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする吸収分割

結合後の名称

りそなアセットマネジメント株式会社

その他取引の概要に関する事項

法人・機関投資家向けとリテール向けで分かれていた運用機能集約による運用サービスの向上を図ることを目的とし、法人・機関投資家向けに高品質の運用サービスを提供する株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を分割し、バランスファンド・ファンドラップ専用投資信託・インデックスファンド等を中心に、リテール向けに業容拡大を図ってきた当社へ、発展的に統合するものであります。

（2）実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

（2）地域ごとの情報

営業収益

内国籍投資信託からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

（3）主要な顧客ごとの情報

営業収益の10%以上を占める単一の外部顧客がないため、記載を省略しております。

3．報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4．報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5．報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社 りそなホールディングス	東京都 江東区	50,472	持株会社 としての 経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税 に係る 個別帰属額 (注1)	44,766	その他 未払金	44,766

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社 の子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	支払手数料 (注3) 委託調査費 (注1) (注2)	340,304 130,062	未払 手数料 その他 未払金	72,673 51,486

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の費用については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資一任の費用については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社りそなホールディングス	東京都江東区	50,472	持株会社としての経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税に係る個別帰属額（注1）	616,720	その他未払金	616,704

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社の 子会社	株式会社りそな銀行	大阪市中央区	279,928	銀行業務及び信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託報酬（注2） 投資助言報酬（注1） 支払手数料（注3）	1,159,040 1,059,624 706,067	未収運用受託報酬 未収投資助言報酬 未払手数料	1,224,680 350,629 203,372

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注2) 投資一任の収益については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(注3) 投資信託の販売委託については、一般取引条件を基に、協議のうえ決定しております。

(注4) 上記の取引金額には消費税等が含まれておりません。期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

(1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
1株当たり純資産額	374円43銭	825円15銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失()	41円43銭	450円83銭

なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)
当期純利益又は当期純損失() (千円)	164,079	1,785,287
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失() (千円)	164,079	1,785,287
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000	3,960,000

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)

該当事項はありません。

(1)中間貸借対照表

(単位:千円)

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

(単位:千円)

第 6 期中間会計期間 (2020年 9月 30日現在)		
負債の部		
流動負債		
未払金		
未払手数料		274,799

その他未払金		678,644
未払費用		92,385
未払法人税等		153,032
未払消費税等	2	186,565
賞与引当金		167,456
預り金		824
流動負債計		1,553,708
負債合計		1,553,708
純資産の部		
株主資本		
資本金		1,000,000
資本剰余金		
資本準備金		490,000
資本剰余金計		490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		3,082,368
利益剰余金計		3,082,368
株主資本計		4,572,368
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		526
評価・換算差額等計		526
純資産合計		4,572,895
負債・純資産合計		6,126,603

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第6期中間会計期間
(自 2020年4月1日
至 2020年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		1,615,328
運用受託報酬		2,227,738
投資助言報酬		403,885
営業収益計		4,246,952
営業費用		
支払手数料		527,367
広告宣伝費		17,661
調査費		
調査費		597,857
委託調査費		51,583
図書費		270
委託計算費		98,908
事務委託費		11,940
営業雑経費		
印刷費		32,679
協会費		2,573
諸会費		1,510
その他		30,051
営業費用計		1,372,402
一般管理費		

給料		
役員報酬		55,705
給料・手当		533,076
賞与		9,130
賞与引当金繰入額		167,456
旅費交通費		1,630
租税公課		33,348
不動産賃借料		48,858
固定資産減価償却費	1	9,288
諸経費		131,422
一般管理費計		989,916
営業利益		1,884,632
営業外収益		
受取配当金		50
雑収入		311
営業外収益計		361
営業外費用		
投資有価証券売却損		277
営業外費用計		277
経常利益		1,884,716
税引前中間純利益		1,884,716
法人税、住民税及び事業税		596,131
法人税等調整額		15,732
法人税等計		580,399
中間純利益		1,304,317

(3)中間株主資本等変動計算書

第6期中間会計期間（自 2020年4月1日 至 2020年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	資本剰余金合計	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当中間期変動額						
当中間純利益				1,304,317	1,304,317	1,304,317
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)						
当中間期変動額合計	-	-	-	1,304,317	1,304,317	1,304,317
当中間期末残高	1,000,000	490,000	490,000	3,082,368	3,082,368	4,572,368

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	433	433	3,267,617
当中間期変動額			
当中間純利益			1,304,317

株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	960	960	960
当中間期変動額合計	960	960	1,305,277
当中間期末残高	526	526	4,572,895

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

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

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

注記事項

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

第6期中間会計期間

(2020年9月30日)

建物	1,112千円
器具備品	14,674千円

2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額は、次のとおりであります。

第6期中間会計期間
(2020年9月30日)

有形固定資産	3,578千円
無形固定資産	5,710千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第6期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末
普通株式(株)	3,960,000	-	-	3,960,000

2 配当に関する事項

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1 金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

第6期中間会計期間(2020年9月30日現在)

(単位:千円)

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

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

(1) 預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬、(4) 未収投資助言報酬

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金

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

(セグメント情報等)

第6期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

1 セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

単一の商品・サービスの区分の外部顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超える

ため、記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。なお、営業収益の地域区分は、契約相手方の所在地（ファンドの場合は組成地）を基礎として分類しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,445,827

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(1 株当たり情報)

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

(注) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

(重要な後発事象)

第6期中間会計期間(自 2020年4月1日 至 2020年9月30日)

該当事項はありません。

5【その他】

<訂正前>

(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

2020年1月1日付で株式会社りそな銀行が資産運用事業に関して有する権利義務の一部を承継する吸収分割を行いました。

(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。

<訂正後>

- (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】

<更新後>

(1) 受託会社

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

<再信託受託会社の概要>

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2020年7月27日現在)

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

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

<更新後>

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2020年3月末現在)	事業の内容
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

独立監査人の中間監査報告書

2021年5月19日

りそなアセットマネジメント株式会社
取締役会御中

有限責任監査法人トーマツ
東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 山田 信之 印
業務執行社員

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2020年9月25日から2021年3月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2021年3月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2020年9月25日から2021年3月24日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事

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

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年5月22日

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

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の中間監査報告書

2020年12月4日

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

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

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられているりそなアセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第6期事業年度の中間会計期間（2020年4月1日から2020年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

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

中間監査意見の根拠

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

中間財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

中間財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは中間監査の対象には含まれておりません。