

**【表紙】**

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月25日提出
【計算期間】	第6期中(自 2021年1月26日至 2021年7月25日)
【ファンド名】	DCりそな グローバルバランス
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 1【ファンドの運用状況】

## 【DCりそな グローバルバランス】

以下の運用状況は2021年 7月30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	907,174,091	99.69
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,858,204	0.31
合計（純資産総額）		910,032,295	100.00

## (2)【運用実績】

## 【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2017年 1月25日)	44	44	1.0004	1.0004
第2計算期間末 (2018年 1月25日)	117	117	1.0382	1.0382
第3計算期間末 (2019年 1月25日)	273	273	1.0147	1.0147
第4計算期間末 (2020年 1月27日)	529	529	1.0590	1.0590
第5計算期間末 (2021年 1月25日)	740	740	1.0648	1.0648
2020年 7月末日	629		1.0298	
8月末日	650		1.0397	
9月末日	657		1.0368	
10月末日	662		1.0284	
11月末日	686		1.0515	
12月末日	708		1.0606	
2021年 1月末日	757		1.0633	
2月末日	753		1.0638	
3月末日	839		1.0833	
4月末日	857		1.0867	
5月末日	868		1.0914	
6月末日	896		1.0967	
7月末日	910		1.0978	

## 【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金(円)
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.0000
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	0.0000
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.0000
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	0.0000
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.0000
当中間期	2021年 1月26日～2021年 7月25日	

## 【収益率の推移】

期	期間	収益率(%)
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	0.04
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	3.78
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	2.26
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	4.37
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	0.55
当中間期	2021年 1月26日～2021年 7月25日	2.94

(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。

(参考)

## R M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30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	89,876,977,770	83.49
地方債証券	日本	5,646,790,980	5.25
特殊債券	日本	6,588,983,594	6.12
社債券	日本	4,049,357,000	3.76
	フランス	200,508,000	0.19
	オーストラリア	99,929,000	0.09
	小計	4,349,794,000	4.04
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,191,803,339	1.11
合計(純資産総額)		107,654,349,683	100.00

## R M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30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	17,752,922,933	44.66
	カナダ	769,031,356	1.93
	メキシコ	274,103,272	0.69
	ドイツ	2,976,597,152	7.49
	イタリア	3,748,194,365	9.43
	フランス	3,975,015,438	10.00
	オランダ	767,527,152	1.93
	スペイン	2,327,298,714	5.86
	ベルギー	931,067,484	2.34
	オーストリア	584,294,125	1.47
	フィンランド	227,296,238	0.57
	アイルランド	322,083,612	0.81
	イギリス	2,580,101,208	6.49
	スウェーデン	113,804,062	0.29
	ノルウェー	93,586,929	0.24
	デンマーク	190,472,458	0.48
	ポーランド	235,000,963	0.59
	オーストラリア	798,568,290	2.01
	シンガポール	170,245,886	0.43
	マレーシア	178,431,386	0.45
イスラエル	177,105,763	0.45	
	小計	39,192,748,786	98.60
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		555,833,847	1.40
合計（純資産総額）		39,748,582,633	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		99,352,944	0.25

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30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	1,932,199,627	30.53
	アイルランド	4,271,288,921	67.50
	小計	6,203,488,548	98.03
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		124,580,525	1.97
合計(純資産総額)		6,328,069,073	100.00

## R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30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	55,321,421,640	98.72
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		714,981,474	1.28
合計(純資産総額)		56,036,403,114	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	685,800,000	1.22

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

## R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30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	67,198,113,709	62.70
	カナダ	3,507,234,701	3.27
	パナマ	35,522,395	0.03
	ドイツ	2,852,876,607	2.66
	イタリア	567,155,394	0.53
	フランス	3,239,651,423	3.02
	オランダ	1,942,382,759	1.81
	スペイン	747,329,617	0.70
	ベルギー	262,700,451	0.25
	オーストリア	63,532,838	0.06

	ルクセンブルク	97,494,183	0.09
	フィンランド	410,267,562	0.38
	アイルランド	1,832,790,211	1.71
	ポルトガル	48,637,244	0.05
	イギリス	4,182,425,927	3.90
	スイス	3,348,373,873	3.12
	スウェーデン	1,138,007,579	1.06
	ノルウェー	189,459,625	0.18
	デンマーク	822,995,467	0.77
	ケイマン	178,631,226	0.17
	リベリア	30,629,819	0.03
	オーストラリア	1,979,116,420	1.85
	バミューダ	218,857,083	0.20
	ニュージーランド	107,403,933	0.10
	パプアニューギニア	10,320,864	0.01
	香港	711,012,539	0.66
	シンガポール	278,502,936	0.26
	イスラエル	184,481,022	0.17
	キュラソー	74,443,560	0.07
	ジャージー	396,967,620	0.37
	マン島	29,811,077	0.03
	小計	96,687,129,664	90.21
投資証券	アメリカ	1,949,555,474	1.82
	カナダ	8,154,740	0.01
	フランス	46,437,601	0.04
	イギリス	52,036,928	0.05
	オーストラリア	132,481,726	0.12
	香港	40,896,225	0.04
	シンガポール	42,229,537	0.04
	小計	2,271,792,231	2.12
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		8,218,661,255	7.67
合計（純資産総額）		107,177,583,150	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	6,666,062,140	6.22
	買建	ドイツ	1,698,865,778	1.59

(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		563,921,831	0.53

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

## R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 7月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### 投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	54,277,188	0.33
	アルゼンチン	911,176	0.01
	メキシコ	258,557,568	1.59
	ブラジル	751,292,805	4.62
	チリ	61,204,744	0.38
	コロンビア	20,776,242	0.13
	ペルー	3,059,014	0.02
	オランダ	42,214,444	0.26
	ルクセンブルク	34,048,722	0.21
	ギリシャ	24,155,883	0.15
	トルコ	36,144,862	0.22
	チェコ	16,172,849	0.10
	キプロス	21,321,645	0.13
	ハンガリー	31,849,601	0.20
	ポーランド	92,025,755	0.57
	ロシア	401,565,920	2.47
	ケイマン	3,077,389,142	18.91
	バミューダ	86,387,600	0.53
	香港	154,163,594	0.95
	シンガポール	2,899,722	0.02
	マレーシア	174,647,515	1.07
	タイ	220,575,757	1.36
	フィリピン	81,622,738	0.50
	インドネシア	160,808,593	0.99
	韓国	1,863,828,151	11.45
	台湾	1,947,039,581	11.96
	中国	1,490,845,646	9.16
	インド	1,470,308,806	9.03
	カタール	93,118,788	0.57
	エジプト	8,283,884	0.05
南アフリカ	496,777,404	3.05	
ジャージー	12,253,070	0.08	
英ヴァージン諸島	3,847,367	0.02	

	アラブ首長国連邦	102,177,182	0.63
	マン島	4,411,892	0.03
	クウェート	76,661,995	0.47
	サウジアラビア	420,605,954	2.58
	小計	13,798,232,799	84.77
投資証券	メキシコ	5,431,039	0.03
	南アフリカ	5,375,580	0.03
	小計	10,806,619	0.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,468,494,143	15.17
合計(純資産総額)		16,277,533,561	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	2,542,751,943	15.62

(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		434,539,426	2.67
	売建		99,028	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。

## RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年7月30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	31,364,835,500	98.75
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		397,520,722	1.25
合計(純資産総額)		31,762,356,222	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	369,542,000	1.16

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

## RM先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年7月30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	62,295,470	0.25
	オーストラリア	21,787,397	0.09
	小計	84,082,867	0.33
投資証券	アメリカ	18,683,169,437	74.24
	カナダ	485,309,284	1.93
	ドイツ	73,085,565	0.29
	イタリア	3,717,062	0.01
	フランス	561,781,234	2.23
	オランダ	48,971,371	0.19
	スペイン	108,786,558	0.43
	ベルギー	349,914,779	1.39
	アイルランド	31,719,183	0.13
	イギリス	1,388,924,790	5.52
	オーストラリア	1,617,922,287	6.43
	ニュージーランド	103,965,953	0.41
	香港	374,576,873	1.49
	シンガポール	914,118,178	3.63
	韓国	41,020,942	0.16
	イスラエル	15,418,404	0.06
	ガーンジー	62,899,302	0.25
小計	24,865,301,202	98.81	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		214,967,219	0.85
合計（純資産総額）		25,164,351,288	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		81,200,952	0.32

(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。

## 2【設定及び解約の実績】

## 【DCりそな グローバルバランス】

期	期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	2016年 5月12日～2017年 1月25日	47,045,838	2,987,019
第2期	2017年 1月26日～2018年 1月25日	94,737,024	26,010,237
第3期	2018年 1月26日～2019年 1月25日	234,142,892	77,862,922
第4期	2019年 1月26日～2020年 1月27日	314,458,168	83,848,056
第5期	2020年 1月28日～2021年 1月25日	295,744,267	99,995,699
当中間期	2021年 1月26日～2021年 7月25日	191,230,217	74,241,703

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

### 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6期中間計算期間(2021年 1月26日から2021年 7月25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。

## 【DCりそな グローバルバランス】

## (1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 2021年 1月25日現在	第6期中間計算期間末 2021年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,878,235	7,024,617
親投資信託受益証券	738,330,183	886,306,892
流動資産合計	743,208,418	893,331,509
資産合計	743,208,418	893,331,509
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	496,865	118,438
未払受託者報酬	146,965	177,536
未払委託者報酬	2,057,415	2,485,429
未払利息	13	19
その他未払費用	28,567	34,531
流動負債合計	2,729,825	2,815,953
負債合計	2,729,825	2,815,953
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	695,424,256	812,412,770
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	45,054,337	78,102,786
（分配準備積立金）	20,308,107	18,409,081
元本等合計	740,478,593	890,515,556
純資産合計	740,478,593	890,515,556
負債純資産合計	743,208,418	893,331,509

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期中間計算期間 自 2020年 1月28日 至 2020年 7月27日	第6期中間計算期間 自 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
営業収益		
有価証券売買等損益	11,720,032	26,236,709
営業収益合計	11,720,032	26,236,709
営業費用		
支払利息	1,267	2,336
受託者報酬	123,382	177,536
委託者報酬	1,727,240	2,485,429
その他費用	24,330	34,531
営業費用合計	1,876,219	2,699,832
営業利益又は営業損失( )	13,596,251	23,536,877
経常利益又は経常損失( )	13,596,251	23,536,877
中間純利益又は中間純損失( )	13,596,251	23,536,877
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( )	1,407,317	1,206,260
期首剰余金又は期首欠損金( )	29,467,801	45,054,337
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,675,305	15,636,182
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,675,305	15,636,182
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,987,271	4,918,350
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,987,271	4,918,350
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	18,966,901	78,102,786

## (3)【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(中間貸借対照表に関する注記)

第5期 2021年 1月25日現在	第6期中間計算期間末 2021年 7月25日現在
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況
期首元本額 499,675,688円	期首元本額 695,424,256円
期中追加設定元本額 295,744,267円	期中追加設定元本額 191,230,217円
期中一部解約元本額 99,995,699円	期中一部解約元本額 74,241,703円
2. 計算期間の末日における受益権の総数 695,424,256口	2. 中間計算期間の末日における受益権の総数 812,412,770口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0648円	3. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1.0961円
1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,648円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たり純資産額) (10,961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5期 2021年 1月25日現在	第6期中間計算期間末 2021年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

<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>	<p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</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「RM国内債券マザーファンド」、「RM先進国債券マザーファンド」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内株式マザーファンド」、「RM先進国株式マザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」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。

RM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	875,564
コール・ローン	1,178,189,275
国債証券	89,351,886,870
地方債証券	5,529,768,580
特殊債券	6,587,889,589
社債券	4,351,226,000
未収入金	181,586,000
未収利息	148,806,018
前払費用	12,737,668

2021年 7月25日現在	
流動資産合計	107,342,965,564
資産合計	107,342,965,564
負債の部	
流動負債	
未払金	722,350,500
未払解約金	25,384,000
未払利息	3,195
流動負債合計	747,737,695
負債合計	747,737,695
純資産の部	
元本等	
元本	100,964,856,095
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,630,371,774
元本等合計	106,595,227,869
純資産合計	106,595,227,869
負債純資産合計	107,342,965,564

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	78,237,277,839円
期中追加設定元本額	30,313,318,738円
期中一部解約元本額	7,585,740,482円
期末元本額	100,964,856,095円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,619,840,630円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,820,030,505円
りそなラップ型ファンド(成長型)	187,191,798円
DCりそな グローバルバランス	558,132,789円
つみたてバランスファンド	2,953,197,211円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,562,553,095円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	598,453,572円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	171,204,364円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	143,103,590円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	42,892,201円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,060,223円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,600,370円
リスクコントロール・オープン	84,136,510円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,042,802,434円
FWりそな国内債券インデックスファンド	57,397,605,610円
Smart-i 国内債券インデックス	1,245,428,054円
Smart-i 8資産バランス 安定型	822,161,183円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	559,424,439円
Smart-i 8資産バランス 成長型	213,136,627円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,349,246,666円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	4,346,227,797円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	2,562,521,731円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,771,031,008円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,126,554,058円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	364,663,913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)	13,566,527円
りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,018,273,318円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,375,645,713円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	127,595円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	37,136円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	5,428円
2. 計算日における受益権の総数	100,964,856,095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	1.0558円
(10,000口当たり純資産額)	(10,558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 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	
	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
	コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。

## （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 M先進国債券マザーファンド

## 貸借対照表

（単位：円）

2021年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	290,003,580
コール・ローン	161,604,434
国債証券	38,778,261,190
派生商品評価勘定	380,296
未収利息	187,126,268
前払費用	17,207,827
流動資産合計	39,434,583,595
資産合計	39,434,583,595
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,995
未払金	245,311,464
未払利息	438
流動負債合計	245,313,897
負債合計	245,313,897
純資産の部	
元本等	
元本	35,711,917,341
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,477,352,357
元本等合計	39,189,269,698
純資産合計	39,189,269,698
負債純資産合計	39,434,583,595

## 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礎となる事項	<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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	29,857,342,278円
期中追加設定元本額	9,921,848,907円
期中一部解約元本額	4,067,273,844円
期末元本額	35,711,917,341円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,608,322,467円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	665,004,332円
りそなラップ型ファンド(成長型)	368,499,453円
DCりそな グローバルバランス	64,628,244円
つみたてバランスファンド	704,961,559円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	548,247,554円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	127,738,232円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	36,302,749円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	30,461,125円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	9,055,246円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,883,930円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,331,046円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	188,222,763円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	17,950,459円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	17,662,730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)	27,505,561,802円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	786,887,709円
Smart-i 8資産バランス 安定型	175,875,026円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	119,201,843円
Smart-i 8資産バランス 成長型	45,087,571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)	994,673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)	687,951,017円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	49,061円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	18,514円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	18,236円
2. 計算日における受益権の総数	35,711,917,341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	1.0974円
(10,000口当たり純資産額)	(10,974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 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
デリバティブ取引	
(その他の注記)のデリバティブ取引に関する注記に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれてお	
ります。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額	
が異なることもあります。	
また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額	
自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

(2021年 7月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	197,161,635	-	197,539,936	378,301
	米ドル	93,336,516	-	93,533,678	197,162
	カナダドル	3,747,939	-	3,762,992	15,053
	メキシコペソ	820,350	-	818,355	1,995
	ユーロ	80,827,178	-	80,959,580	132,402
	英ポンド	13,552,493	-	13,574,542	22,049
	オーストラリアドル	3,741,409	-	3,751,540	10,131
	シンガポールドル	803,450	-	805,155	1,705
	イスラエルシケル	332,300	-	334,094	1,794
合計		197,161,635	-	197,539,936	378,301

(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 M新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

2021年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	96,622,993
コール・ローン	12,961,447

2021年 7月25日現在

投資信託受益証券	6,120,120,213
未収入金	1,731,000
未収配当金	93,285,671
流動資産合計	6,324,721,324
資産合計	6,324,721,324
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	149,580
未払金	51,261,874
未払解約金	39,012,000
未払利息	35
流動負債合計	90,423,489
負債合計	90,423,489
純資産の部	
元本等	
元本	5,677,965,297
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	556,332,538
元本等合計	6,234,297,835
純資産合計	6,234,297,835
負債純資産合計	6,324,721,324

## 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礎となる事項	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 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	4,721,029,528円
期中追加設定元本額	2,562,534,607円
期中一部解約元本額	1,605,598,838円
期末元本額	5,677,965,297円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	895,217,269円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	659,962,156円
りそなラップ型ファンド(成長型)	364,798,788円
DCりそな グローバルバランス	15,465,702円
つみたてバランスファンド	698,267,995円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	210,824,190円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	115,006,759円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	72,512,727円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	18,455,640円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	12,018,012円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	6,255,774円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	9,236,153円
リスクコントロール・オープン	3,385,159円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	105,656,080円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	31,175,965円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,126,259,636円
Smart-i 8資産バランス 安定型	37,434,922円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	96,860,312円
Smart-i 8資産バランス 成長型	110,015,748円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	189,070,447円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	349,767,361円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	206,228,182円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	142,599,107円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	171,122,629円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,349,642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)	965,026円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	18,062円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	18,062円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	17,792円
2. 計算日における受益権の総数	5,677,965,297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	1.0980円
(10,000口当たり純資産額)	(10,980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 7月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2.時価の算定方法	投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 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 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	39,441,240	-	39,590,820	149,580
	米ドル	39,441,240	-	39,590,820	149,580
	合計	39,441,240	-	39,590,820	149,580

## （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 M国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 7月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	1,348,434,987
株式	54,776,648,330
未収入金	1,854,000
未収配当金	65,763,449
前払金	20,825,000
差入委託証拠金	27,540,000
流動資産合計	56,241,065,766
資産合計	56,241,065,766
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,904,800
未払金	765,807,706
未払解約金	115,325,000
未払利息	3,657
流動負債合計	896,041,163
負債合計	896,041,163
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	40,117,179,939
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	15,227,844,664
元本等合計	55,345,024,603
純資産合計	55,345,024,603
負債純資産合計	56,241,065,766

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式
--------------------	----

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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	30,730,895,014円
期中追加設定元本額	27,970,599,135円
期中一部解約元本額	18,584,314,210円
期末元本額	40,117,179,939円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,899,733,983円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,114,770,619円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,948,813,900円
DCりそな グローバルバランス	68,794,363円
つみたてバランスファンド	3,334,872,416円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	333,471,302円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	181,471,723円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	114,317,419円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	29,269,230円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	19,065,804円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,980,115円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	14,677,640円
リスクコントロール・オープン	10,826,225円
FWりそな国内株式アクティブファンド	32,221,818円
FWりそな国内株式インデックスファンド	20,737,530,266円
Smart-i TOPIXインデックス	1,516,227,585円
Smart-i 8資産バランス 安定型	60,567,779円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	155,835,471円
Smart-i 8資産バランス 成長型	173,433,096円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	302,315,719円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	559,301,709円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	329,761,652円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	228,005,191円

りそな・リスクコントロールファンド2020-03	273,630,629円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	46,925,774円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	5,003,960円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	526,643,328円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	751,399,936円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	798,144,396円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	539,849,640円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	85,626円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	93,608円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	138,017円
2. 計算日における受益権の総数	40,117,179,939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	1.3796円
(10,000口当たり純資産額)	(13,796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 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2. 時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)の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 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	701,604,800	-	686,700,000	14,904,800
	合計	701,604,800	-	686,700,000	14,904,800

（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 M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 7月25日現在

資産の部	
流動資産	
預金	6,173,001,510
コール・ローン	827,872,470
株式	91,924,995,186
投資証券	2,212,599,753
派生商品評価勘定	81,268,980
未収入金	10,919,639
未収配当金	57,729,358
差入委託証拠金	2,949,901,623
流動資産合計	104,238,288,519
資産合計	104,238,288,519
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	59,261,914
未払解約金	683,650,000
未払利息	2,245
流動負債合計	742,914,159
負債合計	742,914,159
純資産の部	
元本等	
元本	55,624,570,673
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	47,870,803,687

2021年 7月25日現在

元本等合計	103,495,374,360
純資産合計	103,495,374,360
負債純資産合計	104,238,288,519

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	53,970,185,829円
期中追加設定元本額	28,228,534,232円
期中一部解約元本額	26,574,149,388円

期末元本額	55,624,570,673円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,374,712,988円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	5,007,533,001円
りそなラップ型ファンド(成長型)	5,430,157,318円
DCりそな グローバルバランス	23,647,028円
つみたてバランスファンド	1,651,540,394円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,497,839,768円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	813,624,405円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	512,115,887円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	131,754,491円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	85,752,387円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	44,727,841円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	65,854,077円
リスクコントロール・オープン	52,057,830円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	16,196,688円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	7,360,379円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	22,289,688,273円
Smart-i 先進国株式インデックス	5,893,538,622円
Smart-i 8資産バランス 安定型	271,661,479円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	695,569,005円
Smart-i 8資産バランス 成長型	776,799,920円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,341,809,779円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,482,407,834円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,463,631,056円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,012,522,291円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,214,482,761円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	208,266,237円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	4,763,980円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	238,307,845円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	593,725,026円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	422,022,110円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	54,036円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	183,277円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	262,660円
2. 計算日における受益権の総数	55,624,570,673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	1.8606円
(10,000口当たり純資産額)	(18,606円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月25日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

## 2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の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 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	9,759,014,840	-	9,781,819,371	22,804,531
	合計	9,759,014,840	-	9,781,819,371	22,804,531

## （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 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	843,770,413	-	843,860,283	89,870
	米ドル	621,705,491	-	622,015,872	310,381
	カナダドル	27,695,041	-	27,658,738	36,303
	ユーロ	79,457,819	-	79,430,972	26,847
	英ポンド	34,154,400	-	34,048,727	105,673
	スイスフラン	30,097,394	-	30,084,130	13,264
	スウェーデンクローナ	8,348,244	-	8,342,400	5,844
	デンマーククローネ	7,911,408	-	7,909,554	1,854
	オーストラリアドル	20,121,162	-	20,088,856	32,306
	香港ドル	9,931,893	-	9,933,300	1,407
	シンガポールドル	4,347,561	-	4,347,734	173
	売建	238,645,781	-	239,533,116	887,335
	米ドル	183,951,240	-	184,648,864	697,624
	カナダドル	13,584,050	-	13,699,469	115,419
	英ポンド	15,278,682	-	15,299,541	20,859
	スイスフラン	10,259,198	-	10,266,602	7,404
	スウェーデンクローナ	3,026,880	-	3,033,600	6,720
	デンマーククローネ	2,762,784	-	2,770,018	7,234
	オーストラリアドル	6,836,465	-	6,857,672	21,207
香港ドル	2,946,482	-	2,957,350	10,868	
合計		1,082,416,194	-	1,083,393,399	797,465

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

## R M新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

2021年 7月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	919,001,060
コール・ローン	274,923,319
株式	14,039,801,947
投資証券	10,654,093
派生商品評価勘定	430,280
未収入金	6,323,775
未収配当金	32,382,798
差入委託証拠金	1,073,022,729
<b>流動資産合計</b>	<b>16,356,540,001</b>
<b>資産合計</b>	<b>16,356,540,001</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	67,754,651
未払金	19,599,203
未払解約金	310,891,000
未払利息	745
<b>流動負債合計</b>	<b>398,245,599</b>
<b>負債合計</b>	<b>398,245,599</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,540,235,884
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	6,418,058,518
<b>元本等合計</b>	<b>15,958,294,402</b>
<b>純資産合計</b>	<b>15,958,294,402</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>16,356,540,001</b>

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

## (貸借対照表に関する注記)

2021年 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	8,352,954,743円
期中追加設定元本額	3,822,200,204円
期中一部解約元本額	2,634,919,063円
期末元本額	9,540,235,884円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	574,251,504円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,082,320,896円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,245,786,184円
DCりそな グローバルバランス	10,020,278円
つみたてバランスファンド	454,730,626円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	274,509,069円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	149,434,908円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	94,116,844円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	24,096,551円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	15,574,068円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	8,138,222円

りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	12,011,495円
リスクコントロール・オープン	8,773,250円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	132,450,032円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	17,322,032円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,319,172,598円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,387,366,379円
Smart-i 8資産バランス 安定型	49,123,661円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	126,358,018円
Smart-i 8資産バランス 成長型	142,811,253円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	245,135,201円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	453,353,107円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	267,311,706円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	184,922,272円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	221,790,068円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	38,050,508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)	1,187,741円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	11,963円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	41,271円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	64,179円
2. 計算日における受益権の総数	9,540,235,884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	1.6727円
(10,000口当たり純資産額)	(16,727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 7月25日現在	
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	
	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ
	ん。
2.時価の算定方法	
株式、投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)の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 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,994,681,964	-	1,927,494,082	67,187,882
合計		1,994,681,964	-	1,927,494,082	67,187,882

(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 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,304,884	-	23,306,035	1,151
	米ドル	23,304,884	-	23,306,035	1,151
	売建	36,365,984	-	36,503,624	137,640
	米ドル	36,154,800	-	36,291,915	137,115

ブラジルリアル	23,848	-	23,977	129
オフショア人民元	72,826	-	73,183	357
サウジアラビアリアル	114,510	-	114,549	39
合計	59,670,868	-	59,809,659	136,489

## (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 M国内リートマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

2021年 7月25日現在

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	634,558,350
投資証券	30,904,172,200
派生商品評価勘定	2,303,080
未収配当金	162,613,079
差入委託証拠金	19,608,000
流動資産合計	31,723,254,709
<b>資産合計</b>	<b>31,723,254,709</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	2,236,000
未払金	319,710,720
未払解約金	134,221,000
未払利息	1,721
流動負債合計	456,169,441
<b>負債合計</b>	<b>456,169,441</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	20,360,761,139
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	10,906,324,129
<b>元本等合計</b>	<b>31,267,085,268</b>

2021年 7月25日現在

純資産合計	31,267,085,268
負債純資産合計	31,723,254,709

## 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 7月25日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	19,216,952,787円
期中追加設定元本額	11,979,534,017円
期中一部解約元本額	10,835,725,665円
期末元本額	20,360,761,139円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	823,711,149円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	675,947,413円
りそなラップ型ファンド(成長型)	579,659,799円
DCりそな グローバルバランス	17,233,388円
つみたてバランスファンド	1,006,110,434円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	149,791,594円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	81,762,519円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	51,524,087円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	13,112,391円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	8,494,912円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	4,445,009円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	6,563,009円
リスクコントロール・オープン	2,423,222円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	75,083,060円

FWりそな国内リートインデックスオープン	4,237,103,490円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,327,884,855円
Smart-i Jリートインデックス	2,539,655,770円
Smart-i 8資産バランス 安定型	26,792,761円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	69,319,112円
Smart-i 8資産バランス 成長型	78,176,281円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	135,334,975円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	250,378,115円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	147,622,813円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	102,058,041円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	122,506,744円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	21,008,060円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	2,799,364,166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)	1,518,770円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	653,074,314円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	17,079円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	25,960円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	43,176円
J-REITインデックスファンド202102(適格機関投資家専用)	2,353,014,671円
2. 計算日における受益権の総数	20,360,761,139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	1.5357円
(10,000口当たり純資産額)	(15,357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 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
デリバティブ取引	(その他の注記)の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 7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	363,454,920	-	365,758,000	2,303,080
	合計	363,454,920	-	365,758,000	2,303,080

(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 M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 7月25日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	364,756,563
コール・ローン	42,857,965
株式	84,055,443
投資証券	24,804,084,807
未収入金	26,070,491
未収配当金	42,035,039
流動資産合計	25,363,860,308

2021年 7月25日現在

資産合計	25,363,860,308
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	432,666
未払金	230,204,033
未払解約金	156,447,000
未払利息	116
流動負債合計	387,083,815
負債合計	387,083,815
純資産の部	
元本等	
元本	18,749,308,785
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,227,467,708
元本等合計	24,976,776,493
純資産合計	24,976,776,493
負債純資産合計	25,363,860,308

## 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礎となる事項	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 7月25日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2021年 1月26日
期首元本額	21,976,415,392円
期中追加設定元本額	11,941,222,971円
期中一部解約元本額	15,168,329,578円
期末元本額	18,749,308,785円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,337,255,504円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,142,614,352円
りそなラップ型ファンド(成長型)	930,862,767円
DCりそな グローバルバランス	20,263,738円
つみたてバランスファンド	586,768,184円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	351,835,804円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	191,494,240円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	120,799,104円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	30,880,452円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	20,053,601円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,428,708円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	15,389,761円
リスクコントロール・オープン	11,224,737円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	177,561,420円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,157,916,012円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	3,940,107,444円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,776,585,759円
Smart-i 8資産バランス 安定型	63,234,723円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	162,565,010円
Smart-i 8資産バランス 成長型	183,263,409円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	313,484,934円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	579,987,291円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	341,923,887円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	236,628,758円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	283,744,031円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	48,655,060円
グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	2,815,186円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	710,818,090円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	11,350円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	49,453円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	86,016円
2. 計算日における受益権の総数	18,749,308,785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	1.3321円
(10,000口当たり純資産額)	(13,321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 7月25日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。
2. 時価の算定方法	株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。
デリバティブ取引	（その他の注記）の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 7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	売建	115,994,784	-	116,427,450	432,666
	米ドル	97,508,400	-	97,878,195	369,795
	カナダドル	3,353,025	-	3,381,514	28,489
	ユーロ	4,524,065	-	4,535,163	11,098
	英ポンド	5,542,267	-	5,549,833	7,566

	オーストラリアドル	5,067,027	-	5,082,745	15,718
	合計	115,994,784	-	116,427,450	432,666

(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。

## 4【委託会社等の概況】

## (1)【資本金の額】

2021年7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)【事業の内容及び営業の状況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。

2021年7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	97	1,044,692
単位型株式投資信託	8	104,813
合計	105	1,149,506

## (3)【その他】

## (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

## (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

## 5【委託会社等の経理状況】

- (1) 委託会社であるりそなアセットマネジメント株式会社（以下、「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）により作成しております。
- (2) 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。
- (3) 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期事業年度（自2020年4月1日至2021年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

		(単位：千円)	
		前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部			
流動資産			
預金		2,211,091	4,261,664
前払費用		186,739	245,658
未収入金		247	8,551
未収委託者報酬		810,183	768,778
未収運用受託報酬		1,261,327	2,597,734
未収投資助言報酬		418,494	437,046
流動資産計		4,888,083	8,319,433
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	4,325	5,302
器具備品	1	11,668	18,218
有形固定資産計		15,993	23,520
無形固定資産			
ソフトウェア		18,733	8,588
無形固定資産計		18,733	8,588
投資その他の資産			
投資有価証券		7,975	19,301
長期前払費用		416	-
繰延税金資産		72,304	128,654
投資その他の資産計		80,969	147,956
固定資産計		115,424	180,065
資産合計		5,003,507	8,499,498

		(単位：千円)	
		前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部			
流動負債			
未払金			
未払手数料		311,378	256,287
その他未払金	2	760,759	1,255,082
未払費用		85,094	99,584
未払法人税等		192,367	269,609
未払消費税等		287,966	352,528

預り金	1,648	1,387
賞与引当金	96,675	224,862
流動負債計	1,735,890	2,459,343
負債合計	1,735,890	2,459,343
純資産の部		
株主資本		
資本金	1,000,000	1,000,000
資本剰余金		
資本準備金	490,000	490,000
資本剰余金計	490,000	490,000
利益剰余金		
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	1,778,051	4,548,350
利益剰余金計	1,778,051	4,548,350
株主資本計	3,268,051	6,038,350
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	433	1,804
評価・換算差額等計	433	1,804
純資産合計	3,267,617	6,040,155
負債・純資産合計	5,003,507	8,499,498

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	3,170,025	3,539,887
運用受託報酬	1,201,400	4,624,333
投資助言報酬	1,166,500	839,669
その他営業収益	-	261
営業収益計	5,537,925	9,004,153
営業費用		
支払手数料	1,050,201	1,166,440
広告宣伝費	63,238	37,315
調査費		
調査費	500,578	1,297,321
委託調査費	128,044	98,375
委託計算費	188,413	207,635
事務委託費	-	23,815
営業雑経費		
印刷費	68,686	75,269
協会費	5,690	9,101
販売促進費	5,255	3,264
その他	55,169	55,514
営業費用計	2,065,279	2,974,056
一般管理費		
給料		
役員報酬	82,651	110,648
給料・手当	490,014	1,104,231
賞与	3,982	143,217

賞与引当金繰入額		132,198	224,862
旅費交通費		13,634	4,372
租税公課		48,964	73,538
不動産賃借料		48,771	97,751
固定資産減価償却費		16,096	21,729
諸経費		119,502	256,552
一般管理費計		955,815	2,036,904
営業利益		2,516,831	3,993,191
営業外収益			
受取配当金		23	189
投資有価証券売却益		73	-
雑収入		46	1,694
営業外収益計		142	1,883
営業外費用			
投資有価証券売却損		-	277
雑損失		13	273
営業外費用計		13	550
経常利益		2,516,960	3,994,525
税引前当期純利益		2,516,960	3,994,525
法人税、住民税及び事業税	1	769,705	1,281,563
法人税等調整額		38,032	57,337
法人税等計		731,672	1,224,226
当期純利益		1,785,287	2,770,298

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

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

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

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051
当期変動額						
当期純利益	-	-	-	2,770,298	2,770,298	2,770,298
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	2,770,298	2,770,298	2,770,298
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	4,548,350	4,548,350	6,038,350

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	433	433	3,267,617
当期変動額			
当期純利益	-	-	2,770,298
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	2,238	2,238	2,238
当期変動額合計	2,238	2,238	2,772,537
当期末残高	1,804	1,804	6,040,155

## （重要な会計方針）

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 2．固定資産の減価償却の方法

## （1）有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

## （2）無形固定資産

定額法を採用しております。

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

## 3．引当金の計上基準

## 賞与引当金

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

## 4．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## （1）消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

## （２）連結納税制度の適用

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

## （３）連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

## （未適用の会計基準等）

### 1．収益認識に関する会計基準等

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 2020年3月31日）

#### （１）概要

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

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

#### （２）適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

#### （３）当該会計基準等の適用による影響

当財務諸表に与える影響はありません。

### 2．時価の算定に関する会計基準等

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

#### （１）概要

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

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

## (2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

## (3) 当該会計基準等の適用による影響

当財務諸表に与える影響はありません。

## 注記事項

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社に対する資産及び負債

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

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社に対する主な取引

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

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

## 2 配当に関する事項

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 1 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度(2020年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(2021年3月31日)

(単位:千円)

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

## 金融商品の時価の算定方法に関する事項

### 資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

### 負債

未払手数料、その他未払金

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

(税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
繰延税金資産		
賞与引当金	29,592千円	68,830千円
未払事業所税	655千円	1,246千円

未払事業税	33,577千円	54,775千円
未確定債務	757千円	757千円
減価償却超過額	3,944千円	3,840千円
税務上の繰越欠損金(*1)	3,586千円	-
その他有価証券評価差額金	191千円	51千円
繰延税金資産小計	72,304千円	129,502千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	72,304千円	129,502千円
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	-	848千円
繰延税金負債合計	-	848千円
繰延税金資産の純額	72,304千円	128,654千円

(\*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2020年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

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

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

法定実効税率	30.61%
(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.01%
住民税均等割	0.06%
その他	0.03%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.65%

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

### 1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

### 2. 関連情報

#### (1) 製品及びサービスごとの情報

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

#### (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

## 1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

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

## (2) 地域ごとの情報

## 営業収益

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

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,083,778

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（2）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2．親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．関連当事者との取引

（1）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	株式会社 りそなホールディングス	東京都 江東区	50,472	持株会社 としての 経営管理	(直接) 100%	連結納税	連結納税 に係る 個別帰属額 (注1)	1,029,080	その他 未払金	1,030,722

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（2）兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円) (注4)
親会社 の 子会社	株式会社 りそな銀行	大阪市 中央区	279,928	銀行業務 及び 信託業務	-	投資信託の 販売委託 投資助言 投資一任	運用受託 報酬 (注2)	4,459,201	未収運用 受託報酬	2,531,968
							投資助言 報酬 (注1)	624,314	未収投資 助言報酬	358,053
							支払手数料 (注3)	746,352	未払 手数料	164,487

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2. 親会社に関する注記

### 親会社情報

株式会社りそなホールディングス(東京証券取引所に上場)

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	825円15銭	1,525円29銭
1株当たり当期純利益金額又は 1株当たり当期純損失( )	450円83銭	699円57銭

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
当期純利益又は当期純損失( )(千円)	1,785,287	2,770,298
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益又は 当期純損失( )(千円)	1,785,287	2,770,298
普通株式の期中平均株式数(株)	3,960,000	3,960,000

### (重要な後発事象)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

## 独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中有限責任監査法人トーマツ  
東京事務所指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 山田 信之 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 畑中 建二 印

### 監査意見

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそなアセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 監査意見の根拠

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

### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

### 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

# 独立監査人の中間監査報告書

2021年9月10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DCりそな グローバルバランスの2021年1月26日から2021年7月25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、DCりそな グローバルバランスの2021年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年1月26日から2021年7月25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、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。