【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2021年10月26日提出
【計算期間】	第4期(自 2020年7月28日至 2021年7月26日)
【ファンド名】	つみたてバランスファンド
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡　明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【事務連絡者氏名】	塚田　光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目５番６５号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

① ファンドの目的

信託財産の長期的な成長を目標として運用を行います。

② ファンドの基本的性格

１）商品分類

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産（　　）	
		資産複合	

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

２）属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年１回	グローバル（含む日本）			
	年２回	日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　　）	年４回	北米	ファミリーファンド	あり	
	年６回（隔月）	欧州			
	年12回（毎月）	アジア			ＴＯＰＩＸ
	日々	オセアニア			
不動産投信		中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
	その他（　）	アフリカ			その他（合成ベンチマーク）
その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）（資産配分固定型）））		中近東（中東）			
		エマージング			
資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型					

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

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

＜商品分類の定義＞

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

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

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

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

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

＜属性区分の定義＞

1. 投資対象資産による属性区分
(1)株式
①一般：次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
②大型株：目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
③中小型株：目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

(2)債券

①一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。

②公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

③社債：目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。

④その他債券：目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。

⑤格付等クレジットによる属性：目論見書又は投資信託約款において、上記①から④の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記①から④に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

①資産配分固定型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

②資産配分変更型：目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

2. 決算頻度による属性区分

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

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

③年4回：目論見書又は投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいう。

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

⑤年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。

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

⑦その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

①グローバル：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

②日本：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

③北米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

④欧州：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑤アジア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑥オセアニア：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑦中南米：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑧アフリカ：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑨中近東(中東)：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

⑩エマージング：目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

4. 投資形態による属性区分

①ファミリーファンド：目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資され

るものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
②ファンド・オブ・ファンズ：「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

5. 為替ヘッジによる属性区分
①為替ヘッジあり：目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
②為替ヘッジなし：目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分
①日経225
②TOPIX
③その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型
①ブル・ベア型：目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
②条件付運用型：目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
③ロング・ショート型／絶対収益追求型：目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
④その他型：目論見書又は投資信託約款において、上記①から③に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

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

③ ファンドの特色

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

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

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

*1 合成ベンチマークは、合成ベンチマークを構成する指数および基本的資産配分をもとに委託会社が計算したものです。
*2 合成ベンチマークを構成する指数については、「合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について」をご参照ください。

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

● 各マザーファンドは、以下の対象指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

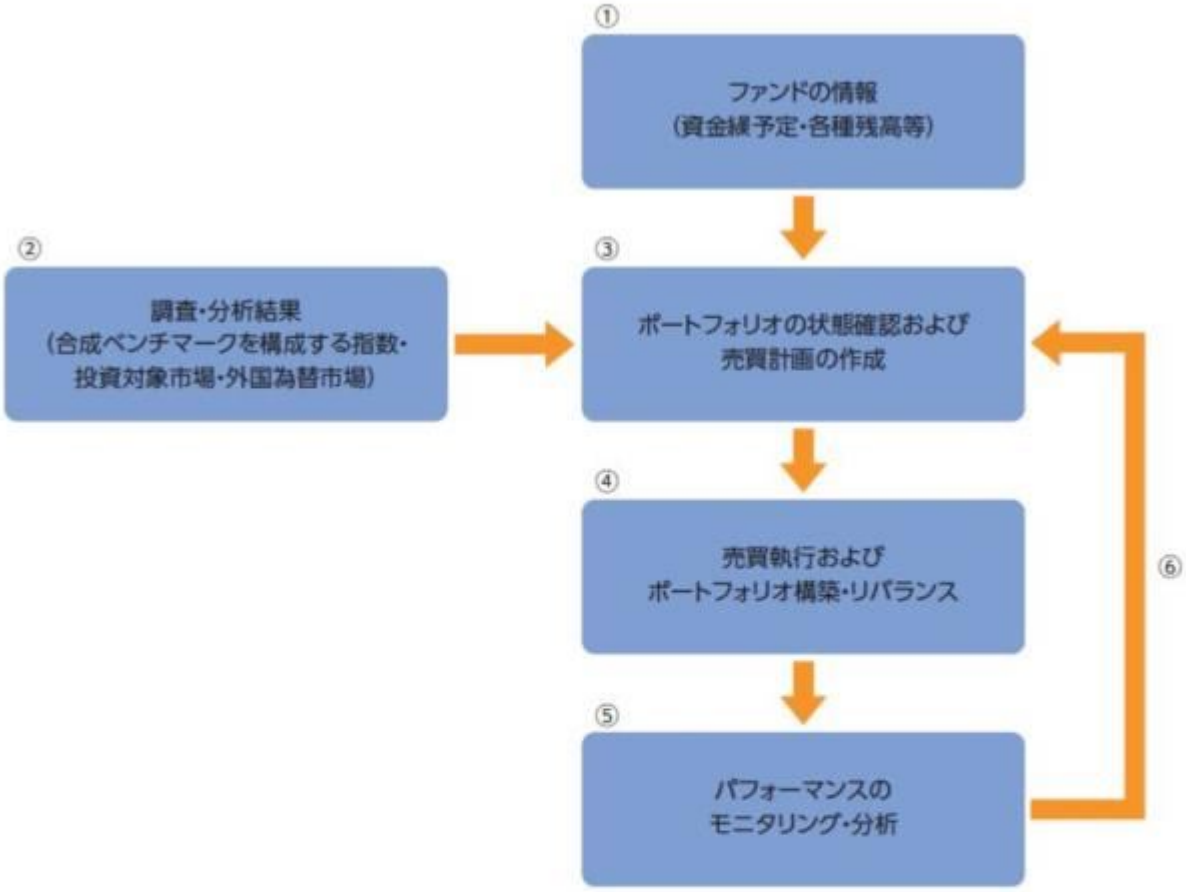
		投資対象地域		
		国内	先進国	新興国
実質的な投資対象	株式	**RM国内株式マザーファンド** 【主要投資対象】 国内の株式 【対象指数】 東証株価指数(TOPIX、配当込み)	**RM先進国株式マザーファンド** 【主要投資対象】 先進国(日本を除く)の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)	**RM新興国株式マザーファンド** 【主要投資対象】 新興国の株式およびETF(上場投資信託証券) 【対象指数】 MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)
	債券	**RM国内債券マザーファンド** 【主要投資対象】 国内の債券 【対象指数】 NOMURA-BPI総合	**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)	**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)
	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)	―

3 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

4 購入時手数料のないノーロード型のファンドです。

● 換金時手数料、信託財産留保額もかかりません。

運用プロセスのイメージ



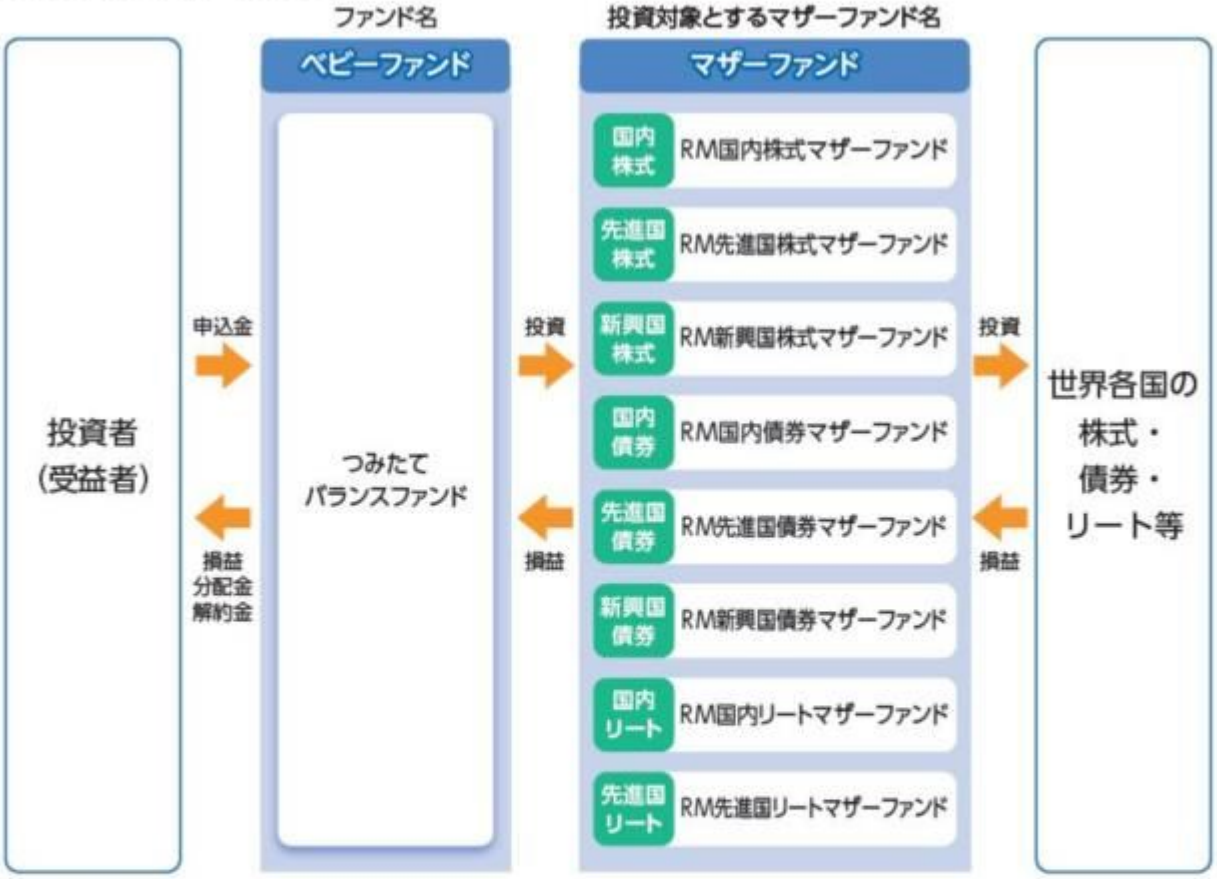
①設定・解約による資金繰予定のほか、各マザーファンド・現金等の残高・取引履歴情報を確認します。
②合成ベンチマークを構成する指数、投資対象となる市場および外国為替市場に関する調査・分析を行います。
③各種情報を基にポートフォリオの状態を確認し、必要に応じてマザーファンドの売買計画を作成します。
④売買執行（マザーファンドの売買）により、ポートフォリオの構築・リバランスを行います。
⑤運用パフォーマンスや合成ベンチマークとの連動性について、モニタリング・分析を行います。
⑥上記⑤の分析結果を反映し、継続的な運用の改善につなげます。

※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

原則、毎年7月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。
①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。
②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
③留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

合成ベンチマークを構成する指数の著作権等について

- 「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。
- 「MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、日本を除く世界の先進国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。
- 「MSCIエマージング・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。MSCIエマージング・マーケット指数(米ドルベース)は、MSCI Inc.が開発した、世界の新興国の株式を対象として算出した指数で、配当を考慮したものであり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はMSCI Inc.に帰属します。
- 「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。野村證券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- 「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円換算ベース)」は、FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。FTSE世界国債インデックス(除く日本、米ドルベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- 「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(J.P. Morgan Securities LLC)が算出し公表している指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数であり、指数に関する著作権はJ.P. Morgan Securities LLCに帰属します。
- 「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場している不動産投資信託(REIT)全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。
- 「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)をもとに委託会社が円換算して計算したものです。S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み)は、S&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが有するS&Pグローバル株価指数の採用銘柄の中から、不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて算出される指数であり、指数に関する著作権、知的財産権その他の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCに帰属します。

④　信託金限度額

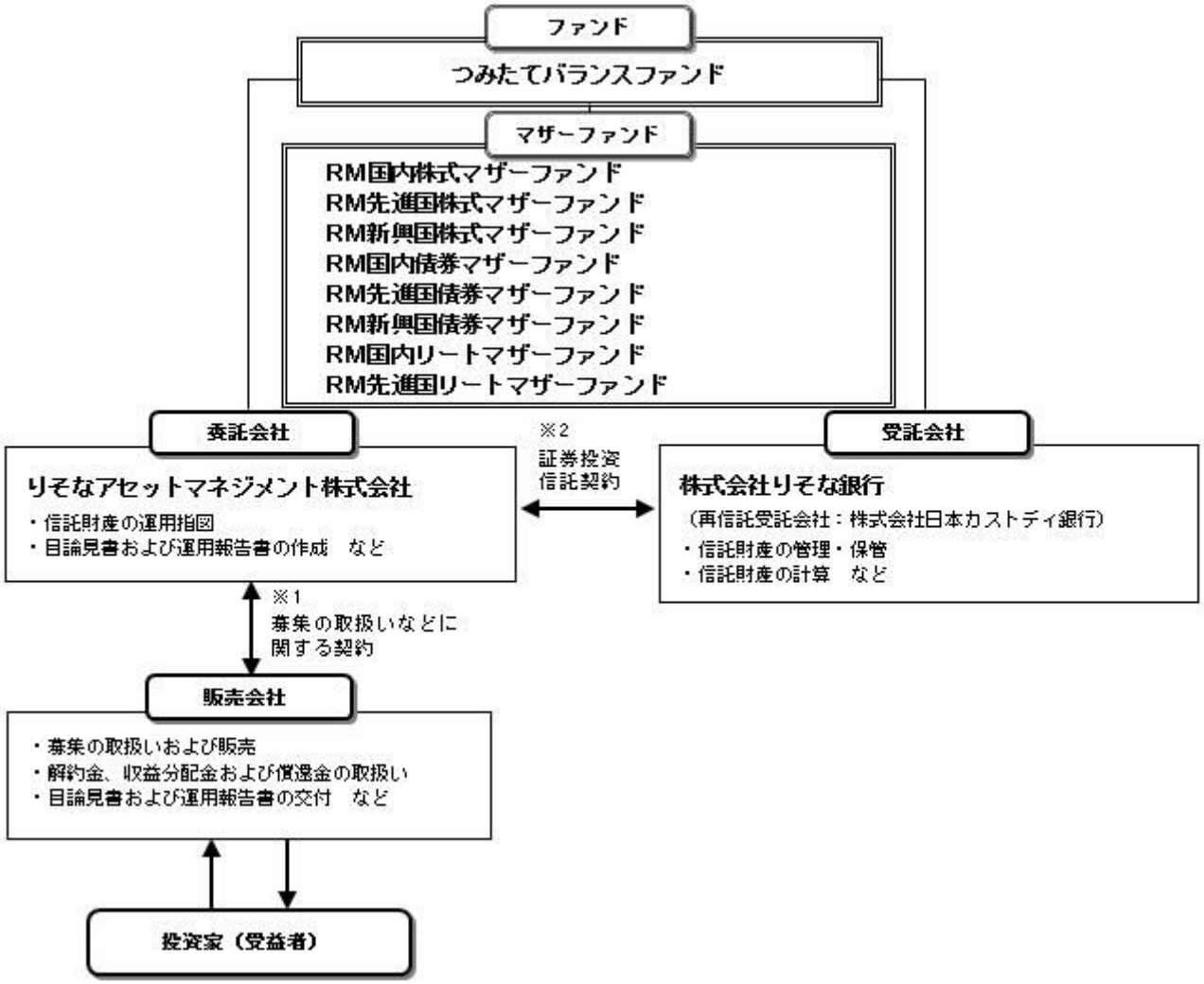
・1兆円を限度として信託金を追加することができます。
・委託会社は受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

（2）【ファンドの沿革】

2017年10月26日
・ファンドの信託契約締結、運用開始

（3）【ファンドの仕組み】

①　ファンドの仕組み



※1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したもの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。

※2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したもの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

② 委託会社の概況（2021年7月末現在）

1）資本金

1,000百万円

2）沿革

2015年8月3日：　りそなアセットマネジメント株式会社設立

2020年1月1日：　株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継

3）大株主の状況

名　　称	住　　所	所有株数	所有比率
株式会社りそなホールディングス	東京都江東区木場一丁目5番65号	3,960,000株	100%

2【投資方針】

（1）【投資方針】

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

① 主として各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の株式・債券ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券等への分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目標とした運用を行います。

② 以下の指数を「基本的資産配分」で組合わせたものを合成ベンチマークとし、当該合成ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

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

③ 合成ベンチマークへの連動性を高めるため、株価指数先物取引、債券先物取引、不動産投信指数先物取引、ＥＴＦ（上場投資信託証券）を活用することがあります。

④ 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

⑤ 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

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

（２）【投資対象】

① 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ）有価証券

ロ）デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限ります。）

ハ）約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ）金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）

２）次に掲げる特定資産以外の資産

イ）為替手形

② 有価証券の指図範囲

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

１）株券または新株引受権証書

２）国債証券

３）地方債証券

４）特別の法律により法人の発行する債券

５）社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

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

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

③　金融商品の指図範囲

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

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

上記②の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときには、委託者は、信託金を、③に掲げる金融商品により運用することを指図することができます。

④　その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

◆投資対象とするマザーファンドの概要

＜RM国内株式マザーファンド＞

運用の基本方針

基本方針	この投資信託は、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている株式
投資方針	①　主として、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み）に採用されている株式に投資し、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み)の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ、配当込み)への連動性を高めるため、国内株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または国内株式を対象とした株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式（指数先物取引、ＥＴＦ（上場投資信託証券）を含みます。）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行いません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM先進国株式マザーファンド＞

運用の基本方針

基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社

受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM新興国株式マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）新興国株式（*） （*）ＤＲ（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、新興国の株式または新興国株式の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、ＭＳＣＩエマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。 ②　株式またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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

＜RM国内債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券
投資方針	①　主として、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合に採用されている国内の債券に投資し、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資は、行いません。 ④　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。

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

＜ＲＭ先進国債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券
投資方針	①　主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円換算ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④　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。 ⑤　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。

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

＜RM新興国債券マザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、ＪＰモルガンＧＢＩ－ＥＭグローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。 ②　債券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	① 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限ります。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ② 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③ 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ④ 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。 ⑤ 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑥ 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM国内リートマザーファンド＞

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。）

投資方針	①　主として、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券に投資し、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）への連動性を高めるため、東証ＲＥＩＴ指数（配当込み）を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）または不動産投信指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資は、行いません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

＜RM先進国リートマザーファンド＞

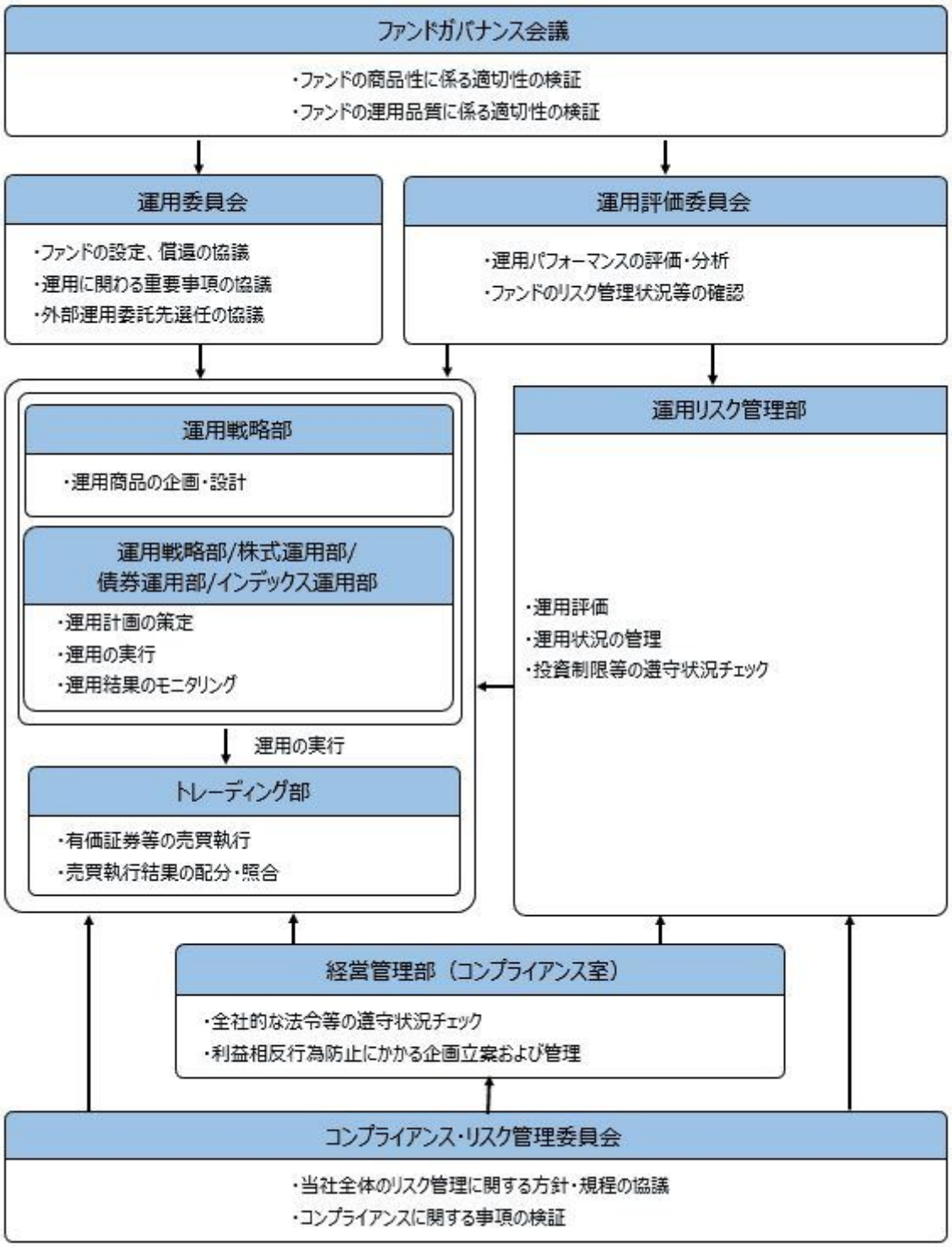
運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に規定する不動産投資信託証券をいいます。） ・先進国（除く日本）の金融商品取引所に上場（上場予定を含みます。）されているまたは店頭登録されている（登録予定を含みます。）不動産関連株式 ・先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）
投資方針	①　主として、先進国の不動産投資信託証券および不動産関連株式または先進国の不動産投資信託証券に関する指数を対象指数としたＥＴＦ（上場投資信託証券）に投資し、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、Ｓ＆Ｐ先進国ＲＥＩＴ指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する指数先物取引を活用することがあります。 ②　不動産投資信託証券またはＥＴＦ（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で高位に維持することを基本とします。 ③　為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。 ④　資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	①　不動産投資信託証券および株式への投資割合には、制限を設けません。 ②　新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ③　投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ④　外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 ⑤　デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 ⑥　一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 ⑦　一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 ※上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

（３）【運用体制】

① ファンドの運用体制は以下のとおりです。



※ファンドガバナンス会議は3名程度、運用委員会は5名程度、運用評価委員会は5名程度、コンプライアンス・リスク管理委員会は3名程度で構成されています。

② 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。

③　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7月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

①　収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

１）分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

２）原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

３）留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

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

②　収益分配金の支払い

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

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

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

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

（５）【投資制限】

①　約款に定める投資制限

１）株式への実質投資割合には、制限を設けません。

２）新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

３）投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

４）外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

５）デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

６）一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

７）一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

８）投資する株式等の範囲

１．委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

２．前記１．の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。

９）信用取引の指図範囲

１．委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

２．前記１．の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

イ）信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券

ロ）株式分割により取得する株券

ハ）有償増資により取得する株券

ニ）売出しにより取得する株券

ホ）信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券

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

10）先物取引等の運用指図および範囲

１．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券（以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額（組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額）に信託財産が限月までに受け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等（株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。）ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。

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

２．委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額（信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。）との合計額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。

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

３．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれ

らの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。

イ）先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品（信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額の範囲内とします。

ロ）先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第16条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額（以下ロ）において「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

11）スワップ取引の運用指図および範囲

1．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

2．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

4．前記３．においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

6．委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12）金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1．委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下３．において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった

場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

4．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4．において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5．前記3．および4．においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

6．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

7．委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13）直物為替先渡取引の運用指図

1．委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

2．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

3．直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3．において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する直物為替先渡取引の一部の解約（反対の売買による解消を含む。）を指図するものとします。

4．前記3．においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

5．直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。

6．委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

14）有価証券の貸付けの指図および範囲

1．委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

イ）株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

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

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

15）特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16）外国為替予約取引の指図および範囲

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

17）資金の借入れ

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

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

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

４．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

②　法令による投資制限

同一法人の発行する株式（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

3【投資リスク】

（1）ファンドのリスク

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

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

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

①　市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利（債券価格）変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

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

② 資産配分リスク
複数資産（国内・外の株式、債券、リート等）への投資を行うため、投資割合が高い資産の価格が下落した場合、当ファンドの基準価額はより大きく影響を受け損失を被ることがあります。

③ 信用リスク
実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合またはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。

④ 流動性リスク
時価総額や取引量が少ない市場で流動性が低い場合、市場の混乱・取引規制等の理由から流動性が低下している場合、急激かつ多量の売買により市場が大きな影響を受けた場合等、市場実勢から期待できる価格よりも大幅に不利な価格で売買せざるを得ないことがあり、この場合、基準価額が下落する要因となります。

⑤ カントリーリスク
投資対象国・地域（特に新興国）において、政治や経済、社会情勢等の変化または金融取引等に関する規制の新設や変更により、実質的に組み入れている有価証券等の価格が大きく変動することがあります。そのため基準価額が予想以上に下落することや、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

※基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

（その他の留意点）

①当ファンドは合成ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用しますが、主として以下の理由から、当ファンドの投資成果は合成ベンチマークの動きから乖離する場合があります。
- **組入資産の時価変動等の理由により、基本的資産配分から実際の資産配分比率が乖離する場合があること。**
- **合成ベンチマークを構成する指数の全ての銘柄を指数の算出方法どおりに組み入れない場合や、構成銘柄以外の銘柄や先物を組み入れる場合があること。**
- **有価証券等の売買価格や基準価額算出に使用される有価証券等の時価が、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される有価証券等の時価と一致しない場合があること。**
- **外貨取引時の為替レートや基準価額算出に使用される為替レートが、合成ベンチマークを構成する指数の算出に使用される為替レートと一致しない場合があること。**
- **運用管理費用（信託報酬）、監査費用および有価証券等の売買にかかる売買委託手数料等の費用負担が発生すること。**

②ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。

③当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドの追加設定・解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響をおよぼすことがあります。

④分配金はファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後は純資産が減少し、基準価額が下落する要因となります。収益分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

⑤ファンドは、預金や保険契約ではなく、預金保険機構、保険契約者保護機構の対象ではありません。また、登録金融機関で取扱う場合、投資者保護基金の補償対象ではありません。

（2）リスク管理体制

○委託会社における投資リスクに対する管理体制

①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。

②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7月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

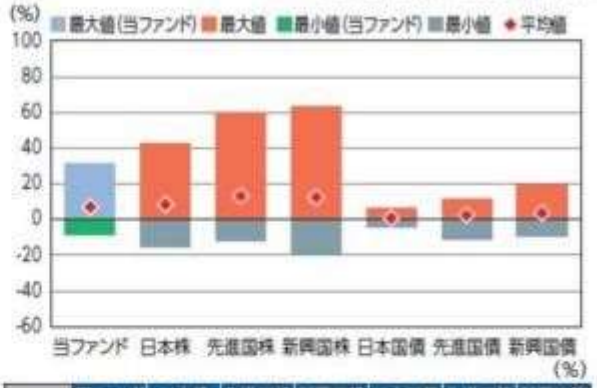
〔参考情報〕

ファンドの年間騰落率及び分配金再投資基準価額の推移

＊分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
＊年間騰落率は、2016年8月から2021年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。
なお、2018年9月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

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	31.3	42.1	59.8	62.7	6.5	11.4	19.3
最小値	△8.2	△16.0	△12.4	△19.4	△4.0	△11.4	△9.4
平均値	6.8	8.3	13.0	12.3	0.5	2.3	3.5

＊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8月から2021年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
＊決算日に対応した数値とは異なります。
＊当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※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問題について、何ら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、商標権、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】

（1）【申込手数料】

ありません。

（2）【換金（解約）手数料】

① 換金手数料
ありません。
② 信託財産留保額
ありません。

（３）【信託報酬等】

① 信託報酬
信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.2145%（税抜0.195%）の率を乗じて得た額とします。
※ただし、RM新興国債券マザーファンドがＥＴＦ（上場投資信託証券）を保有した場合に受益者が負担する実質的な信託報酬率の合計値は年率0.237%程度（税込）
② 信託報酬の配分
信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

信託報酬＝日々の純資産総額×信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.075%	0.100%	0.020%

※表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

③ 支払時期
信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに、信託財産から支払います。

（４）【その他の手数料等】

① 監査法人に支払うファンドの監査費用および当該監査費用にかかる消費税等に相当する金額は、計算期間を通じて日々計上され毎計算期間の最初の６ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合は翌営業日）、および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支払われます。
② 有価証券等の売買の際に発生する売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用は証券会社等に信託財産中から都度支払われます。また、外貨建資産の保管等に要する費用は海外の保管機関に信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）
③ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から都度支払われます。信託財産において資金借入れを行った場合、当該借入金の利息は信託財産中から都度支払われます。
④ 信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支払われます。
⑤ その他諸費用（法律・税務顧問への報酬、法定書類の作成・印刷・交付費用、公告費用等）および当該諸費用にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁することができます（現在、その他諸費用として受益者負担項目はありません。）。
※これらのその他の手数料等は、信託財産の運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額またはその計算方法の概要等を記載することができません。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

① 個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

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

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

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

※少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「愛称：ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。なお、他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

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

② 法人受益者の場合

１）収益分配金、解約金、償還金に対する課税

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

※買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

③ 個別元本

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

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

④ 普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

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

２）受益者が収益分配金を受け取る際

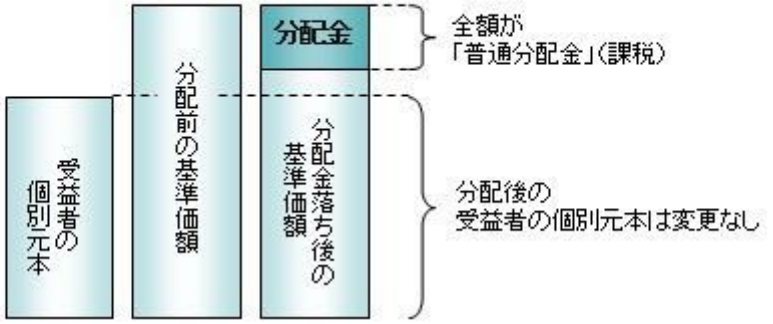
イ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

ロ）収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の１口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。

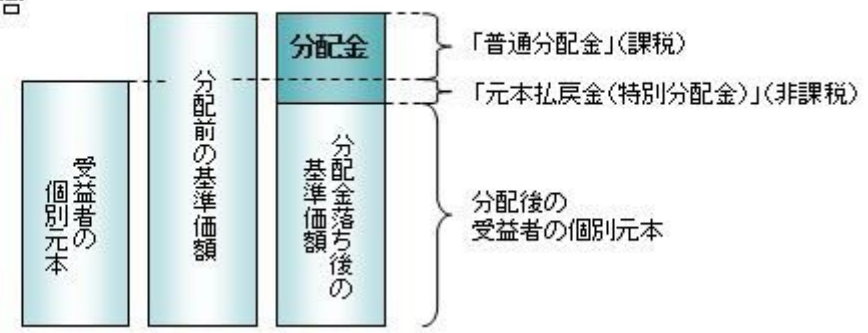
ハ）収益分配金発生時に、その個別元本から元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。

＜分配金に関するイメージ図＞

イ）の場合



ロ）、ハ）の場合



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

※上記は2021年7月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

【つみたてバランスファンド】

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。

（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	15,687,910,655	99.64
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)	―	56,809,326	0.36
合計（純資産総額）		15,744,719,981	100.00

（2）【投資資産】

①【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	RM国内株式マザーファンド	3,405,110,167	1.3949	4,749,788,171	1.3773	4,689,858,233	29.79
日本	親投資信託受益証券	RM先進国株式マザーファンド	1,694,161,055	1.9133	3,241,438,346	1.9039	3,225,513,232	20.49
日本	親投資信託受益証券	RM国内債券マザーファンド	2,953,197,211	1.0562	3,119,166,894	1.0564	3,119,757,533	19.81
日本	親投資信託受益証券	RM国内リートマザーファンド	1,006,436,019	1.5300	1,539,847,109	1.5511	1,561,082,909	9.91
日本	親投資信託受益証券	RM先進国リートマザーファンド	589,245,476	1.3456	792,888,712	1.3360	787,231,955	5.00
日本	親投資信託受益証券	RM新興国債券マザーファンド	700,909,161	1.1053	774,714,895	1.1062	775,345,713	4.92
日本	親投資信託受益証券	RM先進国債券マザーファンド	704,961,559	1.1019	776,797,141	1.0988	774,611,761	4.92
日本	親投資信託受益証券	RM新興国株式マザーファンド	458,556,776	1.6792	770,008,538	1.6454	754,509,319	4.79

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.64
合　　計	99.64

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末　(2018年 7月25日)	556	556	1.0211	1.0211
第2計算期間末　(2019年 7月25日)	3,291	3,291	1.0322	1.0322
第3計算期間末　(2020年 7月27日)	7,744	7,744	1.0317	1.0317
第4計算期間末　(2021年 7月26日)	15,835	15,835	1.2671	1.2671
2020年 7月末日	7,620	—	1.0163	—

8月末日	8,425	—	1.0650	—
9月末日	8,783	—	1.0546	—
10月末日	9,035	—	1.0331	—
11月末日	10,159	—	1.1089	—
12月末日	10,892	—	1.1355	—
2021年 1月末日	11,468	—	1.1500	—
2月末日	12,195	—	1.1769	—
3月末日	13,149	—	1.2247	—
4月末日	13,754	—	1.2345	—
5月末日	14,437	—	1.2479	—
6月末日	15,212	—	1.2665	—
7月末日	15,744	—	1.2609	—

②【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	0.0000
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	0.0000
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	0.0000
第4期	2020年 7月28日～2021年 7月26日	0.0000

③【収益率の推移】

期	期間	収益率（%）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	2.11
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	1.09
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	△0.05
第4期	2020年 7月28日～2021年 7月26日	22.82

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

（４）【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2017年10月26日～2018年 7月25日	548,362,039	3,063,179
第2期	2018年 7月26日～2019年 7月25日	2,744,605,538	101,031,481
第3期	2019年 7月26日～2020年 7月27日	4,603,201,837	284,995,956
第4期	2020年 7月28日～2021年 7月26日	5,615,036,613	624,482,362

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

（参考）

RM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。

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	215,100	8,018.46	1,724,772,746	9,805.00	2,109,055,500	3.76
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	133,000	10,640.77	1,415,223,713	11,375.00	1,512,875,000	2.70
日本	株式	キーエンス	電気機器	20,800	55,683.60	1,158,218,896	60,740.00	1,263,392,000	2.25
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	165,300	8,825.66	1,458,882,397	6,837.00	1,130,156,100	2.02
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	1,432,300	520.17	745,043,497	578.50	828,585,550	1.48
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	145,300	4,918.02	714,588,695	5,629.00	817,893,700	1.46
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	243,700	2,773.51	675,904,814	2,802.50	682,969,250	1.22
日本	株式	任天堂	その他製品	12,100	63,066.36	763,102,968	56,400.00	682,440,000	1.22
日本	株式	信越化学工業	化学	38,400	19,041.61	731,198,024	17,750.00	681,600,000	1.22
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	176,600	3,741.84	660,810,196	3,682.00	650,241,200	1.16
日本	株式	日立製作所	電気機器	102,100	4,799.51	490,030,953	6,258.00	638,941,800	1.14
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	41,400	13,527.72	560,047,842	15,405.00	637,767,000	1.14
日本	株式	日本電産	電気機器	51,100	13,951.10	712,901,467	12,240.00	625,464,000	1.12
日本	株式	ダイキン工業	機械	27,000	22,700.31	612,908,565	22,665.00	611,955,000	1.09

日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	167,200	2,987.12	499,447,188	3,493.00	584,029,600	1.04
日本	株式	村田製作所	電気機器	62,400	9,944.92	620,563,442	9,040.00	564,096,000	1.01
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	12,400	44,455.35	551,246,350	44,920.00	557,008,000	0.99
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	167,100	3,314.22	553,806,249	3,332.00	556,777,200	0.99
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	144,900	3,522.53	510,414,980	3,695.00	535,405,500	0.96
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	146,200	3,204.32	468,472,315	3,232.00	472,518,400	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	18,600	26,880.15	499,970,862	24,380.00	453,468,000	0.81
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	284,500	1,467.57	417,524,934	1,565.50	445,384,750	0.79
日本	株式	三井物産	卸売業	166,800	2,149.63	358,558,862	2,499.50	416,916,600	0.74
日本	株式	ＳＭＣ	機械	6,200	66,621.85	413,055,526	64,800.00	401,760,000	0.72
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	81,800	4,213.09	344,631,242	4,868.00	398,202,400	0.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	127,300	2,828.34	360,048,761	3,062.00	389,792,600	0.70
日本	株式	第一三共	医薬品	166,800	3,312.92	552,596,197	2,159.50	360,204,600	0.64
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	69,000	5,348.40	369,040,223	5,210.00	359,490,000	0.64
日本	株式	富士通	電気機器	19,100	16,889.80	322,595,318	18,565.00	354,591,500	0.63
日本	株式	デンソー	輸送用機器	46,700	6,430.99	300,327,646	7,482.00	349,409,400	0.62

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.33
		食料品	3.33
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.03
		医薬品	5.00
		石油・石炭製品	0.42
		ゴム製品	0.71
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.79
		非鉄金属	0.72
		金属製品	0.62
		機械	5.45
		電気機器	18.23
		輸送用機器	7.99
		精密機器	2.76
		その他製品	2.27
		電気・ガス業	1.19
		陸運業	3.24

		海運業	0.35
		空運業	0.45
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.40
		卸売業	4.82
		小売業	4.53
		銀行業	4.86
		証券、商品先物取引業	0.74
		保険業	1.87
		その他金融業	1.11
		不動産業	1.96
		サービス業	5.61
合　　計			98.72

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	36	日本円	701,604,800	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。

ＲＭ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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	274,583	15,292.78	4,199,137,486	15,946.12	4,378,534,456	4.09
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	117,207	25,623.71	3,003,278,649	31,368.88	3,676,652,904	3.43
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	7,004	366,393.96	2,566,223,339	394,155.24	2,760,663,307	2.58
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	39,442	31,404.93	1,238,673,320	39,232.45	1,547,406,561	1.44
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	4,933	218,634.99	1,078,526,430	297,325.56	1,466,707,034	1.37
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	4,835	220,451.47	1,065,882,898	298,996.38	1,445,647,531	1.35
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	12,627	88,693.77	1,119,936,298	74,163.05	936,456,851	0.87
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	40,620	16,024.98	650,934,756	21,527.92	874,464,265	0.82
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	50,058	15,066.27	754,187,604	16,751.96	838,570,114	0.78
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	43,153	18,024.05	777,792,096	18,851.98	813,519,847	0.76
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	27,845	22,790.29	634,595,699	27,144.76	755,845,864	0.71
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	15,604	39,219.91	611,987,621	45,118.63	704,031,246	0.66
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	22,554	26,432.57	596,160,242	30,630.92	690,849,824	0.64
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	47,407	12,471.52	591,237,462	13,740.64	651,402,757	0.61
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	17,689	31,796.38	562,446,240	35,850.31	634,156,146	0.59
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	14,571	36,816.69	536,456,103	42,570.80	620,299,227	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	40,358	14,362.59	579,645,712	15,271.66	616,333,864	0.58
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	29,933	19,007.89	568,963,389	19,527.54	584,517,900	0.55
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	6,910	62,846.40	434,268,678	83,621.69	577,825,926	0.54
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	18,289	28,292.22	517,436,452	31,004.28	567,037,337	0.53
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	127,733	3,607.59	460,808,775	4,235.07	540,958,605	0.50

アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	7,875	53,864.76	424,185,052	68,069.93	536,050,722	0.50
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	11,592	39,029.82	452,433,773	42,007.45	486,950,476	0.45
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	75,524	5,501.58	415,501,706	6,362.46	480,518,724	0.45
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	69,779	5,428.35	378,785,350	6,452.24	450,231,253	0.42
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	91,947	4,066.12	373,867,850	4,685.07	430,778,784	0.40
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	16,008	24,958.12	399,529,648	26,719.93	427,732,793	0.40
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	67,469	5,431.07	366,429,011	6,246.40	421,438,665	0.39
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	69,587	5,064.80	352,444,837	6,029.61	419,582,770	0.39
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	68,124	6,267.71	426,981,624	6,129.25	417,549,041	0.39

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	2.86
		素材	4.07
		資本財	5.97
		商業・専門サービス	1.16
		運輸	1.83
		自動車・自動車部品	1.78
		耐久消費財・アパレル	1.92
		消費者サービス	1.71
		メディア・娯楽	6.95
		小売	5.26
		食品・生活必需品小売り	1.26
		食品・飲料・タバコ	3.57
		家庭用品・パーソナル用品	1.60
		ヘルスケア機器・サービス	4.82
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.08
		銀行	5.44
		各種金融	4.36
		保険	2.72
		不動産	0.39
		ソフトウェア・サービス	11.49
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.50
		電気通信サービス	1.53

		公益事業	2.68
		半導体・半導体製造装置	4.26
投資証券	—	—	2.12
合　　計			92.33

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	SP500MIN2109	買建	276	米ドル	59,361,290	6,499,467,641	60,882,840	6,666,062,140	6.22
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002109	買建	565	ユーロ	12,838,125	1,670,368,443	13,057,150	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	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	3,565,000.00	391,038,513	390,316,871	0.36
	カナダドル	買建	237,000.00	20,713,093	20,817,128	0.02
	ユーロ	買建	330,000.00	42,870,886	42,937,707	0.04
	英ポンド	買建	152,000.00	23,182,792	23,218,709	0.02
	スイスフラン	買建	141,000.00	16,975,871	17,040,811	0.02
	スウェーデンクローナ	買建	1,759,000.00	22,469,846	22,515,200	0.02
	ノルウェークローネ	買建	490,000.00	6,108,019	6,139,700	0.01
	デンマーククローネ	買建	888,000.00	15,518,118	15,531,120	0.01
	オーストラリアドル	買建	264,000.00	21,348,922	21,347,040	0.02
	香港ドル	買建	288,000.00	4,065,638	4,057,545	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。

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	382,700	2,515.41	962,650,574	2,286.52	875,053,500	5.38
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	235,440	3,437.05	809,219,345	2,779.95	654,513,076	4.02
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	89,500	9,468.90	847,466,924	6,932.28	620,439,060	3.81
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	74,262	8,201.03	609,024,998	7,560.30	561,442,999	3.45
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	56,100	5,152.44	289,052,273	3,218.15	180,538,552	1.11
ブラジル	株式	VALE SA	素材	61,700	2,099.45	129,536,622	2,490.12	153,640,960	0.94
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	6,784	25,962.30	176,128,257	21,475.07	145,686,877	0.90
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	44,465	3,037.68	135,070,664	3,038.81	135,120,687	0.83
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	53,107	2,021.98	107,381,772	2,393.15	127,093,548	0.78
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,495,000	84.74	126,699,666	76.22	113,959,215	0.70
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	13,420	10,074.18	135,195,580	7,875.61	105,690,763	0.65
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	26,702	3,820.64	102,018,992	3,573.90	95,430,385	0.59
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	20,100	6,450.87	129,662,600	4,666.46	93,795,922	0.58
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	98,500	1,317.49	129,773,527	951.77	93,750,281	0.58
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	8,517	12,226.75	104,135,242	10,909.80	92,918,767	0.57
ケイマン	株式	WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	52,500	1,710.81	89,817,654	1,755.61	92,169,735	0.57

韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	12,856	7,350.67	94,500,285	6,947.82	89,321,174	0.55
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	23,500	3,547.81	83,373,684	3,659.22	85,991,811	0.53
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	194,800	471.93	91,933,230	435.34	84,804,622	0.52
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	223,400	415.22	92,761,826	364.93	81,525,585	0.50
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	79,821	819.44	65,409,178	1,017.49	81,217,867	0.50
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,928	33,952.90	65,461,205	42,060.14	81,091,969	0.50
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	92,693	660.05	61,182,684	857.74	79,506,926	0.49
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	41,932	1,604.14	67,264,979	1,818.08	76,235,791	0.47
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,150	26,650.03	110,597,654	18,291.39	75,909,307	0.47
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	6,310	12,721.27	80,271,219	11,047.54	69,709,984	0.43
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	4,858	9,892.04	48,055,573	14,211.44	69,039,224	0.42
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	6,800	17,305.32	117,676,187	10,084.02	68,571,397	0.42
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	14,446	4,868.37	70,328,576	4,729.78	68,326,460	0.42
韓国	株式	SAMSUNG SDI CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	862	74,683.54	64,377,219	73,210.50	63,107,451	0.39

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	4.34
		素材	7.80
		資本財	2.37
		商業・専門サービス	0.25
		運輸	1.53
		自動車・自動車部品	3.19
		耐久消費財・アパレル	1.49
		消費者サービス	0.74
		メディア・娯楽	6.86
		小売	8.48
		食品・生活必需品小売り	1.01
		食品・飲料・タバコ	2.89
		家庭用品・パーソナル用品	0.87
		ヘルスケア機器・サービス	1.04
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.10
		銀行	11.35

		各種金融	2.00
		保険	2.18
		不動産	1.47
		ソフトウェア・サービス	2.23
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.75
		電気通信サービス	2.23
		公益事業	1.71
		半導体・半導体製造装置	7.89
投資証券	—	—	0.07
合　　計			84.83

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 2109	買建	360	米ドル	24,039,335	2,632,066,783	23,223,600	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	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（%）
為替予約取引	米ドル	買建	3,968,905.29	435,338,904	434,539,426	2.67
	オフショア人民元	売建	5,847.30	98,949	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

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ.評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第１３９回利付国債（５年）	1,680,000,000	100.71	1,691,999,800	100.64	1,690,852,800	0.100	2024/3/20	1.57
日本	国債証券	第１４０回利付国債（５年）	1,420,000,000	100.76	1,430,821,600	100.69	1,429,854,800	0.100	2024/6/20	1.33
日本	国債証券	第１３３回利付国債（５年）	1,280,000,000	100.38	1,284,966,400	100.26	1,283,340,800	0.100	2022/9/20	1.19
日本	国債証券	第１３８回利付国債（５年）	1,240,000,000	100.64	1,248,023,600	100.57	1,247,105,200	0.100	2023/12/20	1.16
日本	国債証券	第１３６回利付国債（５年）	1,180,000,000	100.55	1,186,503,400	100.43	1,185,109,400	0.100	2023/6/20	1.10
日本	国債証券	第１４４回利付国債（５年）	1,080,000,000	100.99	1,090,739,200	100.95	1,090,324,800	0.100	2025/6/20	1.01
日本	国債証券	第３４６回利付国債（１０年）	1,070,000,000	101.20	1,082,926,200	101.30	1,083,952,800	0.100	2027/3/20	1.01
日本	国債証券	第１３７回利付国債（５年）	1,070,000,000	100.59	1,076,368,200	100.49	1,075,264,400	0.100	2023/9/20	1.00
日本	国債証券	第１４６回利付国債（５年）	1,050,000,000	100.96	1,060,155,200	101.03	1,060,878,000	0.100	2025/12/20	0.99
日本	国債証券	第３５６回利付国債（１０年）	1,020,000,000	101.08	1,031,112,000	101.51	1,035,453,000	0.100	2029/9/20	0.96
日本	国債証券	第１４５回利付国債（５年）	1,020,000,000	101.00	1,030,225,300	100.99	1,030,169,400	0.100	2025/9/20	0.96
日本	国債証券	第１４３回利付国債（５年）	1,010,000,000	100.93	1,019,456,400	100.89	1,019,029,400	0.100	2025/3/20	0.95
日本	国債証券	第１３５回利付国債（５年）	1,000,000,000	100.49	1,004,940,000	100.38	1,003,830,000	0.100	2023/3/20	0.93
日本	国債証券	第３５９回利付国債（１０年）	990,000,000	100.77	997,680,600	101.29	1,002,800,700	0.100	2030/6/20	0.93
日本	国債証券	第３４５回利付国債（１０年）	970,000,000	101.17	981,389,200	101.24	982,086,200	0.100	2026/12/20	0.91
日本	国債証券	第３４０回利付国債（１０年）	934,000,000	102.47	957,153,860	102.24	954,968,300	0.400	2025/9/20	0.89
日本	国債証券	第３５０回利付国債（１０年）	930,000,000	101.28	941,954,000	101.50	943,987,200	0.100	2028/3/20	0.88
日本	国債証券	第３６１回利付国債（１０年）	900,000,000	100.06	900,564,100	101.08	909,720,000	0.100	2030/12/20	0.85
日本	国債証券	第４２３回利付国債（２年）	880,000,000	100.24	882,148,400	100.24	882,120,800	0.005	2023/4/1	0.82
日本	国債証券	第３５２回利付国債（１０年）	830,000,000	101.24	840,355,900	101.58	843,138,900	0.100	2028/9/20	0.78
日本	国債証券	第３４９回利付国債（１０年）	830,000,000	101.12	839,367,000	101.48	842,284,000	0.100	2027/12/20	0.78
日本	国債証券	第１３４回利付国債（５年）	830,000,000	100.44	833,710,100	100.32	832,697,500	0.100	2022/12/20	0.77

日本	国債証券	第３５３回利付国債（１０年）	810,000,000	101.09	818,867,100	101.60	822,968,100	0.100	2028/12/20	0.76
日本	国債証券	第４２０回利付国債（２年）	820,000,000	100.38	823,138,000	100.34	822,788,000	0.100	2023/1/1	0.76
日本	国債証券	第３４８回利付国債（１０年）	810,000,000	101.18	819,625,600	101.42	821,518,200	0.100	2027/9/20	0.76
日本	国債証券	第３４４回利付国債（１０年）	810,000,000	101.16	819,430,600	101.18	819,622,800	0.100	2026/9/20	0.76
日本	国債証券	第１４２回利付国債（５年）	800,000,000	100.86	806,933,300	100.83	806,664,000	0.100	2024/12/20	0.75
日本	国債証券	第１４７回利付国債（５年）	790,000,000	100.49	793,938,100	100.62	794,961,200	0.005	2026/3/20	0.74
日本	国債証券	第３４３回利付国債（１０年）	780,000,000	101.14	788,965,400	101.13	788,814,000	0.100	2026/6/20	0.73
日本	国債証券	第３６０回利付国債（１０年）	710,000,000	100.66	714,686,000	101.19	718,449,000	0.100	2030/9/20	0.67

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	83.49
地方債証券	5.25
特殊債券	6.12
社債券	4.04
合　　計	98.89

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。

ＲＭ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。

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	3,600,000	10,834.17	390,030,362	10,831.38	389,929,811	0.375	2025/11/30	0.98
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	10,944.28	339,272,704	10,941.30	339,180,320	0.125	2023/4/30	0.85
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	10,936.16	273,404,221	10,915.63	272,890,987	0.125	2023/12/15	0.69
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,380,000	10,950.09	260,612,258	10,951.35	260,642,173	0.125	2022/11/30	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,958.27	241,081,976	11,128.63	244,829,892	1.250	2028/4/30	0.62
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,010,000	10,918.63	219,464,494	10,923.33	219,559,086	0.250	2024/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,960,000	10,777.17	211,232,670	10,723.17	210,174,267	0.500	2027/5/31	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,730,000	10,650.90	184,260,634	10,716.33	185,392,574	0.500	2027/6/30	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	11,541.13	177,733,419	11,478.05	176,762,105	2.125	2024/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	10,985.27	170,271,709	11,121.78	172,387,720	1.250	2028/5/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,560,000	10,922.15	170,385,678	10,937.87	170,630,913	0.125	2023/6/30	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	10,560.76	168,972,205	10,598.28	169,572,629	0.875	2030/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,504.19	169,117,570	10,387.00	167,230,821	0.625	2030/8/15	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,350,000	11,555.15	155,994,565	12,086.66	163,170,029	2.375	2051/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,470,000	10,453.75	153,670,139	10,818.98	159,039,015	1.125	2031/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,090,000	14,107.10	153,767,452	14,399.21	156,951,466	3.375	2048/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	10,950.75	156,595,751	10,949.00	156,570,700	0.125	2022/12/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,010,000	14,915.20	150,643,612	15,080.10	152,309,090	5.375	2031/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	11,908.74	154,813,721	11,711.15	152,244,979	2.250	2025/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	11,159.71	151,772,119	11,116.65	151,186,529	2.000	2050/2/15	0.38
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,130,000	13,262.92	149,871,065	13,259.54	149,832,829	0.000	2024/3/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,245.81	149,569,402	11,164.55	148,488,627	1.625	2022/11/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,894.03	144,890,679	10,905.80	145,047,163	0.125	2024/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	10,712.06	145,684,144	10,662.87	145,015,044	0.500	2027/10/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,170,000	12,586.64	147,263,749	12,325.75	144,211,277	2.875	2028/8/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,050,000	13,733.11	144,197,660	13,599.14	142,791,067	1.750	2023/5/25	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	600,000	24,196.95	145,181,748	23,274.12	139,644,774	4.500	2041/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,220,000	11,165.09	136,214,133	11,307.40	137,950,375	1.625	2031/5/15	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,030,000	13,355.37	137,560,322	13,383.99	137,855,193	0.000	2026/2/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,200,000	11,550.74	138,608,947	11,463.08	137,557,073	2.500	2023/8/15	0.35

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	98.60
合　　計	98.60

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	400,000.00	43,888,000	43,794,840	0.11
	カナダドル	買建	22,500.00	1,971,112	1,976,312	0.00
	ユーロ	買建	300,000.00	38,991,000	39,033,870	0.10
	英ポンド	買建	44,000.00	6,714,180	6,721,268	0.02
	ノルウェークローネ	買建	150,000.00	1,871,100	1,879,500	0.00
	デンマーククローネ	買建	200,000.00	3,494,600	3,498,000	0.01
	イスラエルシュケル	買建	72,400.00	2,447,807	2,449,154	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

ＲＭ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

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	704,547	6,319.01	4,452,046,007	6,062.46	4,271,288,921	67.50
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	564,532	3,515.67	1,984,708,337	3,422.65	1,932,199,627	30.53

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	98.03
合　　計	98.03

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。

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。

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	3,003	628,008.38	1,885,909,165	708,000	2,126,124,000	6.69
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,650	629,400.28	1,667,910,742	687,000	1,820,550,000	5.73
日本	投資証券	ＧＬＰ投資法人	8,582	175,086.02	1,502,588,223	196,500	1,686,363,000	5.31
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,198	337,055.47	1,414,958,863	366,000	1,536,468,000	4.84
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,370	101,156.38	1,352,460,887	114,500	1,530,865,000	4.82
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,569	160,957.7	1,379,246,531	174,100	1,491,862,900	4.70
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,781	283,732.4	1,072,792,204	326,000	1,232,606,000	3.88
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,280	180,742.57	954,320,769	209,000	1,103,520,000	3.47
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,649	323,887.43	857,977,817	373,500	989,401,500	3.12
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,965	143,297.98	854,772,462	161,100	960,961,500	3.03
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,762	193,808.51	729,107,614	211,900	797,167,800	2.51
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	7,794	80,415.01	626,754,587	96,600	752,900,400	2.37
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,741	384,878.75	670,073,911	428,000	745,148,000	2.35
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	820	699,964.45	573,970,849	807,000	661,740,000	2.08
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,328	443,797.48	589,363,053	497,500	660,680,000	2.08
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,244	168,356.23	546,147,610	201,000	652,044,000	2.05
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	915	587,568.84	537,625,488	671,000	613,965,000	1.93
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	985	540,395.7	532,289,766	614,000	604,790,000	1.90
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,731	314,134.18	543,766,265	332,500	575,557,500	1.81
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,118	57,422.32	466,154,393	66,700	541,470,600	1.70
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	11,663	38,193.47	445,450,546	43,050	502,092,150	1.58
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,116	150,084.87	467,664,454	161,100	501,987,600	1.58
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	929	445,445.56	413,818,925	508,000	471,932,000	1.49
日本	投資証券	イオンリート投資法人	2,867	144,044.88	412,976,698	159,500	457,286,500	1.44
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,329	164,758.13	383,721,685	193,800	451,360,200	1.42
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	560	694,956.8	389,175,808	790,000	442,400,000	1.39

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	1,810	195,735.17	354,280,657	237,300	429,513,000	1.35
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,193	311,962.31	372,171,035	350,500	418,146,500	1.32
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,466	102,631.16	355,719,600	120,400	417,306,400	1.31
日本	投資証券	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	16,839	16,513.88	278,077,225	22,750	383,087,250	1.21

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
投資証券	98.75
合　　計	98.75

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	172	日本円	363,454,920	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。

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	108,954	11,492.61	1,252,166,826	14,002.67	1,525,647,572	6.06
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	13,198	79,267.28	1,046,169,601	86,100.74	1,136,357,648	4.52
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	22,455	25,976.16	583,294,674	34,140.07	766,615,427	3.05
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	41,545	15,610.64	648,544,117	16,477.15	684,543,201	2.72
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	48,478	11,252.25	545,487,002	13,786.98	668,365,255	2.66
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	61,625	7,339.00	452,266,474	9,605.55	591,942,493	2.35
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,625	19,112.68	394,199,146	25,173.94	519,212,529	2.06
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	50,854	7,175.56	364,905,944	9,248.62	470,329,337	1.87
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	247,033	1,465.18	361,948,602	1,819.35	449,439,489	1.79
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,283	18,808.90	381,501,042	21,870.62	443,601,938	1.76
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	55,244	6,766.52	373,810,068	7,688.38	424,737,296	1.69
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	84,055	3,429.16	288,238,601	4,449.67	374,017,314	1.49
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	19,545	13,552.61	264,885,822	19,022.79	371,800,481	1.48
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	54,968	5,573.08	306,341,490	6,529.98	358,940,138	1.43
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,936	15,349.62	259,961,277	21,132.66	357,902,813	1.42
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	16,387	16,536.49	270,983,492	21,419.52	351,001,817	1.39
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,523	28,063.48	267,248,585	36,197.39	344,707,783	1.37
香港	投資証券	LINK REIT	309,200	985.41	304,689,809	1,056.75	326,747,100	1.30
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	79,034	3,395.63	268,370,332	4,066.45	321,388,489	1.28
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	175,815	1,502.16	264,102,310	1,825.48	320,947,118	1.28

アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	54,950	4,533.37	249,109,014	5,574.13	306,298,768	1.22
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	20,792	10,493.18	218,174,221	12,964.71	269,562,269	1.07
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	78,827	2,979.35	234,853,912	3,393.09	267,467,507	1.06
アメリカ	投資証券	UDR INC	43,422	4,498.07	195,315,407	6,086.54	264,290,135	1.05
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,294	11,796.27	168,615,885	16,286.63	232,801,196	0.93
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	26,421	7,579.26	200,251,809	8,809.56	232,757,527	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,814	7,106.51	176,341,062	9,119.42	226,289,340	0.90
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	42,954	3,637.59	156,249,166	4,756.24	204,299,773	0.81
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	86,537	2,343.38	202,789,184	2,280.67	197,362,920	0.78
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,388	8,033.20	163,781,004	9,488.92	193,460,148	0.77

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	0.33
投資証券	―	―	98.81
合　　計			99.15

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	457,000.00	50,101,838	50,035,331	0.20
	カナダドル	買建	62,000.00	5,445,460	5,445,838	0.02
	ユーロ	買建	20,000.00	2,601,920	2,602,278	0.01
	英ポンド	買建	69,000.00	10,528,695	10,540,123	0.04
	オーストラリアドル	買建	108,000.00	8,733,117	8,732,880	0.03
	香港ドル	買建	204,000.00	2,873,544	2,874,094	0.01
	シンガポールドル	買建	12,000.00	970,428	970,408	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。

≪参考情報≫

運用実績

2021年7月30日現在

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,609円	純資産総額	157.4億円

※基準価額は1万口当たり、運用管理費用(信託報酬)控除後の価額です。
※分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を再投資したものとして計算しております。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2018年7月25日	0円
2019年7月25日	0円
2020年7月27日	0円
2021年7月26日	0円
－	－
設定来累計	0円

主要な資産の状況

■資産の組入比率

資産	比率(%)
RM国内株式マザーファンド	29.8
RM先進国株式マザーファンド	20.5
RM新興国株式マザーファンド	4.8
RM国内債券マザーファンド	19.8
RM先進国債券マザーファンド	4.9
RM新興国債券マザーファンド	4.9
RM国内リートマザーファンド	9.9
RM先進国リートマザーファンド	5.0
現金等	0.4
合計	100.0

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

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	60.0
米ドル	22.1
ユーロ	4.5
英ポンド	1.5
香港ドル	1.2
その他	10.7
合計	100.0

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

■各マザーファンドにおける組入上位銘柄

	国・地域	銘柄名	償還期限	比率(%)
国内株式	日本	トヨタ自動車	－	3.76
	日本	ソニーグループ	－	2.70
	日本	キーエンス	－	2.25
先進国株式	アメリカ	APPLE INC	－	4.09
	アメリカ	MICROSOFT CORP	－	3.43
	アメリカ	AMAZON.COM INC	－	2.58
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	－	5.38
	ケイマン	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	－	4.02
	ケイマン	TENCENT HOLDINGS LTD	－	3.81
国内債券	日本	第139回利付国債(5年)	2024/3/20	1.57
	日本	第140回利付国債(5年)	2024/6/20	1.33
	日本	第133回利付国債(5年)	2022/9/20	1.19
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/11/30	0.98
	アメリカ	US TREASURY N/B	2023/4/30	0.85
	アメリカ	US TREASURY N/B	2023/12/15	0.69
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	－	67.50
	アメリカ	VANECK VECTORS JP. MORGAN E	－	30.53
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	－	6.69
	日本	ジャパンリアルエステイト投資法人	－	5.73
	日本	GLP投資法人	－	5.31
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	－	6.06
	アメリカ	EQUINIX INC	－	4.52
	アメリカ	PUBLIC STORAGE	－	3.05

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

・2012年から2016年までは、対象インデックス(合成ベンチマーク)の年間騰落率です。
・対象インデックスはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
・2017年は10月26日から12月末までの騰落率です。2021年は7月末までの騰落率です。
・年間収益率は、分配金再投資基準価額をもとに計算したものです。

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

（１）申込方法

販売会社所定の方法でお申し込みください。

（２）コースの選択

収益分配金の受取方法によって、＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞と＜分配金受取りコース（一般コース）＞の２通りがあります。ただし、販売会社によって取扱コースは異なります。

＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞

収益分配金を自動的に再投資するコースです。

＜分配金受取りコース（一般コース）＞

収益分配金を再投資せず、その都度受け取るコースです。

（３）申込みの受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（４）取扱時間

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

（５）取得申込不可日

販売会社の営業日であっても、取得申込日が下記のいずれかに該当する場合は、取得の申込みの受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

（６）申込金額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額に取得申込口数を乗じて得た額です。

（７）申込単位

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

（８）申込代金の支払い

取得申込者は、申込金額を販売会社が指定する日までに販売会社へお支払いください。

（９）受付の中止および取消

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

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

２【換金（解約）手続等】

（１）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（２）取扱時間

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

（３）解約請求不可日

販売会社の営業日であっても、解約請求日が下記のいずれかに該当する場合は、解約請求の受付は行ないません。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

・ニューヨークの銀行の休業日
・ニューヨーク証券取引所の休業日
・ロンドンの銀行の休業日
・ロンドン証券取引所の休業日

（４）解約制限

ファンドの規模および商品性格などに基づき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の解約には受付時間制限および金額制限を行なう場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

（５）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

（６）手取額

１口当たりの手取額は、解約価額から解約に係る所定の税金を差し引いた金額となります。
※税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。
詳しくは、「課税上の取扱い」をご覧ください。

（７）解約単位

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

（８）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（９）受付の中止および取消

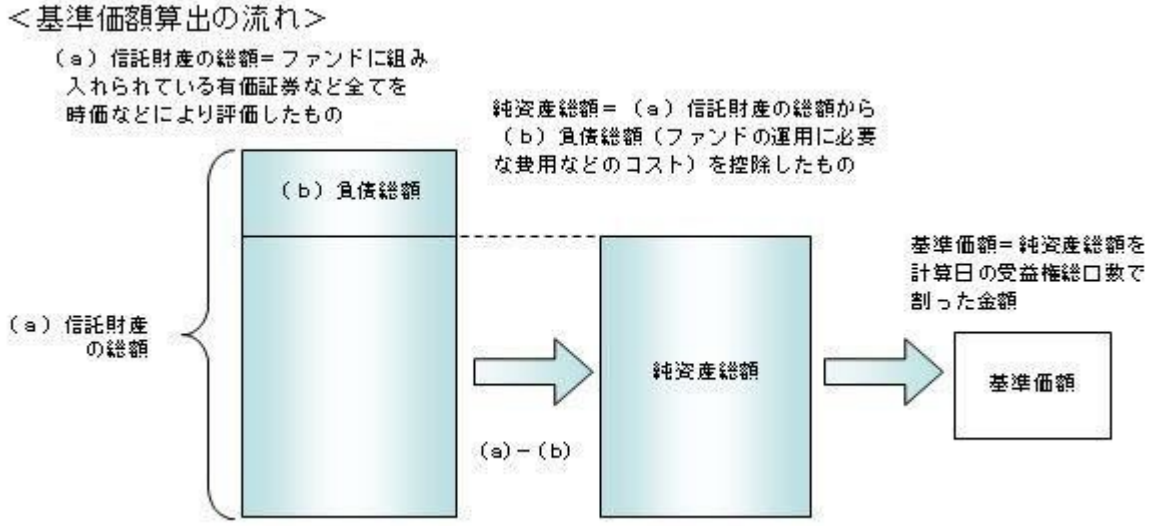
・委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止すること、および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。
・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約請求を受け付けることができる日とします。）に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①　基準価額の算出

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



②　有価証券などの評価基準

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

す。
＜主な資産の評価方法＞
◇マザーファンド受益証券
基準価額計算日の基準価額で評価します。
◇国内上場株式
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇外国株式
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
◇公社債（国内・外国）

原則として、基準価額計算日*における以下のいずれかの価額で評価します。
・日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
・金融商品取引業者（第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。）、銀行などの提示する価額（売気配相場を除きます。）
・価格情報会社の提供する価額
※残存期間１年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。
＊外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。
◇国内上場不動産投信
原則として、基準価額計算日におけるわが国の金融商品取引所の最終相場で評価します。
◇海外上場不動産投信
原則として、基準価額計算日に知りうる直近の日における外国金融商品市場の最終相場で評価します。
・外貨建資産（外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。）の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客相場の仲値によって計算します。

③ 基準価額の照会方法
販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

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

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限とします（2017年10月26日設定）。ただし、約款の規定に基づき、信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年7月26日から翌年7月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

① 信託の終了（繰上償還）
１）委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
イ）信託財産の純資産総額が20億円を下回ることとなったとき
ロ）繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ）やむを得ない事情が発生したとき

2）この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

3）委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。

イ）信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合

ロ）監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき

ハ）委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）

ニ）受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき

4）繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

② 償還金について

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

・償還金の支払いは、販売会社において行なわれます。

③ 信託約款の変更など

1）委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

2）この変更事項のうち、その内容が重大なものまたは併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）

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

④ 書面決議

1）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の２週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

2）受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。

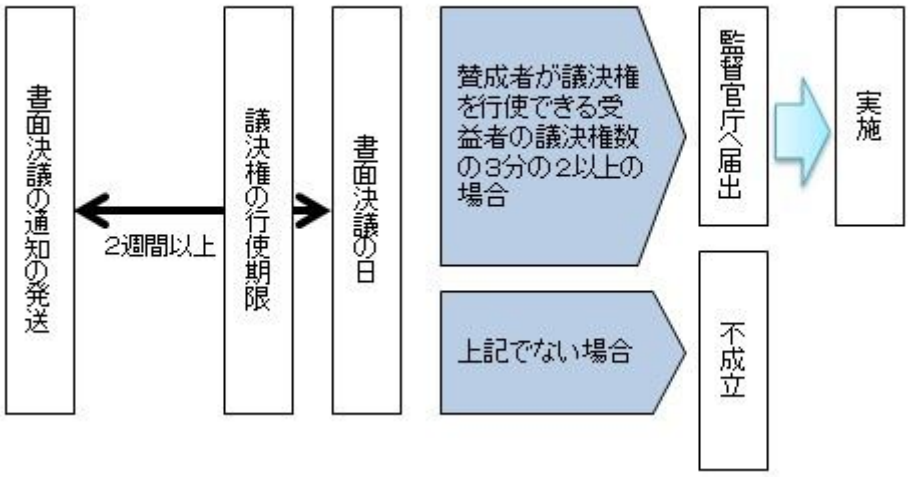
3）書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の３分の２以上にあたる多数をもって行ないます。

4）繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。

5）当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。

6）当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

＜書面決議の主な流れ＞



⑤ 公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

⑥ 運用報告書の作成

・委託会社は、毎期決算後および償還後に期中の運用経過、組入有価証券の内容および有価証券の売買状況などを記載した運用報告書を作成します。

・交付運用報告書は、原則として知れている受益者に対して交付されます。

・運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページに掲載されます。ただし、受益者から運用報告書（全体版）の交付請求があった場合には、交付します。

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

⑦ 関係法人との契約について

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

⑧ 他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

１．他の受益者の氏名または名称および住所

２．他の受益者が有する受益権の内容

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

（１）収益分配金・償還金受領権

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

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

（２）解約請求権

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

（３）帳簿閲覧権

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

第３【ファンドの経理状況】

（１）　当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（２）　当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2020年 7月28日から2021年 7月26日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

１【財務諸表】

【つみたてバランスファンド】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 2020年 7月27日現在	第4期 2021年 7月26日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,438,298	88,558,738
親投資信託受益証券	7,713,098,239	15,764,649,806
流動資産合計	7,754,536,537	15,853,208,544
資産合計	7,754,536,537	15,853,208,544
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,733,612	2,840,671
未払受託者報酬	683,592	1,489,852
未払委託者報酬	5,981,382	13,036,199
未払利息	112	240
その他未払費用	290,435	580,952
流動負債合計	9,689,133	17,947,914
負債合計	9,689,133	17,947,914
純資産の部		
元本等		
元本	7,507,078,798	12,497,633,049
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	237,768,606	3,337,627,581
（分配準備積立金）	191,711,824	2,352,990,483
元本等合計	7,744,847,404	15,835,260,630
純資産合計	7,744,847,404	15,835,260,630
負債純資産合計	7,754,536,537	15,853,208,544

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期 自　2019年 7月26日 至　2020年 7月27日	第4期 自　2020年 7月28日 至　2021年 7月26日
営業収益		
有価証券売買等損益	48,942,493	2,335,351,567
営業収益合計	48,942,493	2,335,351,567
営業費用		
支払利息	24,393	64,576
受託者報酬	1,166,627	2,543,096
委託者報酬	10,207,869	22,252,039
その他費用	499,187	991,617
営業費用合計	11,898,076	25,851,328
営業利益又は営業損失（△）	37,044,417	2,309,500,239
経常利益又は経常損失（△）	37,044,417	2,309,500,239
当期純利益又は当期純損失（△）	37,044,417	2,309,500,239
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	△405,406	67,439,896
期首剰余金又は期首欠損金（△）	102,549,182	237,768,606
剰余金増加額又は欠損金減少額	107,624,613	889,010,217
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	107,624,613	889,010,217
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,855,012	31,211,585
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,855,012	31,211,585
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	237,768,606	3,337,627,581

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。
２.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	当ファンドの計算期間は原則として、毎年7月26日から翌年7月25日までとなっております。ただし、前計算期間末日及び当計算期間末日が休業日のため、当計算期間は2020年 7月28日から2021年 7月26日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第3期 2020年 7月27日現在		第4期 2021年 7月26日現在	
１． 投資信託財産に係る元本の状況		１． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	3,188,872,917円	期首元本額	7,507,078,798円
期中追加設定元本額	4,603,201,837円	期中追加設定元本額	5,615,036,613円
期中一部解約元本額	284,995,956円	期中一部解約元本額	624,482,362円
２． 計算期間の末日における受益権の総数	7,507,078,798口	２． 計算期間の末日における受益権の総数	12,497,633,049口
３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.0317円	３． 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	1.2671円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(10,317円)	(10,000口当たり純資産額)	(12,671円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日		第4期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日	
分配金の計算過程		分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	110,914,577円	A 費用控除後の配当等収益額	224,488,166円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	0円	B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	1,948,653,294円
C 収益調整金額	219,159,100円	C 収益調整金額	984,637,098円
D 分配準備積立金額	80,797,247円	D 分配準備積立金額	179,849,023円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	410,870,924円	E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	3,337,627,581円
F 当ファンドの期末残存口数	7,507,078,798口	F 当ファンドの期末残存口数	12,497,633,049口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	547円	G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	2,670円
H 10,000口当たり分配金額	0円	H 10,000口当たり分配金額	0円
I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円	I 収益分配金金額(I=F×H/10,000)	0円

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第4期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	1.金融商品に対する取組方針 同左
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左
3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。	3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

第3期 2020年 7月27日現在	第4期 2021年 7月26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.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左
2.時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	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 同左
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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。	同左

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第4期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2019年 7月26日 至 2020年 7月27日	第4期 自 2020年 7月28日 至 2021年 7月26日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	92,493,244	2,335,351,567
合計	92,493,244	2,335,351,567

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（４）【附属明細表】

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	RM国内株式マザーファンド	3,405,110,167	4,749,788,171	
	RM国内リートマザーファンド	1,006,436,019	1,539,847,109	
	RM先進国株式マザーファンド	1,694,161,055	3,241,438,346	
	RM新興国株式マザーファンド	458,556,776	770,008,538	
	RM先進国リートマザーファンド	589,245,476	792,888,712	
	RM国内債券マザーファンド	2,953,197,211	3,119,166,894	
	RM先進国債券マザーファンド	704,961,559	776,797,141	
	RM新興国債券マザーファンド	700,909,161	774,714,895	
合計		11,512,577,424	15,764,649,806	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「RM国内株式マザーファンド」、「RM先進国株式マザーファンド」、「RM新興国株式マザーファンド」、「RM国内債券マザーファンド」、「RM先進国債券マザーファンド」、「RM新興国債券マザーファンド」、「RM国内リートマザーファンド」および「RM先進国リートマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。
なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	858,417,287
株式	55,548,602,480
未収配当金	65,417,749
前払金	14,885,000
差入委託証拠金	27,540,000
流動資産合計	56,514,862,516
資産合計	56,514,862,516
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,064,800
未払金	282,816,307
未払解約金	120,477,000
未払利息	2,328
流動負債合計	411,360,435
負債合計	411,360,435
純資産の部	
元本等	
元本	40,219,773,446
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	15,883,728,635
元本等合計	56,103,502,081
純資産合計	56,103,502,081
負債純資産合計	56,514,862,516

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26日現在

１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	**2020年 7月28日**
期首元本額	**24,384,590,778円**
期中追加設定元本額	**49,410,877,048円**
期中一部解約元本額	**33,575,694,380円**
期末元本額	**40,219,773,446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	**70,961,658円**
つみたてバランスファンド	**3,405,110,167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	**20,771,453,143円**
Ｓｍａｒｔ－ｉ　ＴＯＰＩＸインデックス	**1,512,493,169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	
	40,219,773,446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	**1.3949円**
(10,000口当たり純資産額)	**(13,949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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,202,808,811
合計	1,202,808,811

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2021年 7月26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	－	693,540,000	△8,064,800
合計		701,604,800	－	693,540,000	△8,064,800

（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。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	900	2,963.00	2,666,700	
日本水産	26,500	555.00	14,707,500	
マルハニチロ	4,500	2,412.00	10,854,000	
雪国まいたけ	2,300	1,687.00	3,880,100	
カネコ種苗	900	1,431.00	1,287,900	
サカタのタネ	3,400	3,710.00	12,614,000	
ホクト	2,400	1,932.00	4,636,800	
ホクリヨウ	400	830.00	332,000	
住石ホールディングス	5,000	128.00	640,000	
日鉄鉱業	700	5,850.00	4,095,000	
三井松島ホールディングス	1,200	1,013.00	1,215,600	
ＩＮＰＥＸ	105,000	766.00	80,430,000	
石油資源開発	3,700	1,828.00	6,763,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	1,400	1,317.00	1,843,800	
ヒノキヤグループ	700	2,400.00	1,680,000	
ショーボンドホールディングス	4,100	4,710.00	19,311,000	
ミライト・ホールディングス	9,900	2,103.00	20,819,700	
タマホーム	1,700	2,663.00	4,527,100	
サンヨーホームズ	300	728.00	218,400	
日本アクア	1,100	528.00	580,800	
ファーストコーポレーション	900	776.00	698,400	
ベステラ	500	1,422.00	711,000	
Ｒｏｂｏｔ　Ｈｏｍｅ	5,300	220.00	1,166,000	
キャンディル	500	572.00	286,000	
スペースバリューホールディングス	3,500	798.00	2,793,000	
ダイセキ環境ソリューション	500	1,338.00	669,000	
第一カッター興業	700	1,336.00	935,200	
安藤・間	18,300	859.00	15,719,700	
東急建設	8,400	807.00	6,778,800	
コムシスホールディングス	10,100	3,085.00	31,158,500	

ビーアールホールディングス	3,800	473.00	1,797,400	
高松コンストラクショングループ	1,800	2,030.00	3,654,000	
東建コーポレーション	900	10,140.00	9,126,000	
ソネック	300	1,084.00	325,200	
ヤマウラ	1,200	902.00	1,082,400	
オリエンタル白石	9,600	280.00	2,688,000	
大成建設	20,500	3,790.00	77,695,000	
大林組	65,900	910.00	59,969,000	
清水建設	61,800	891.00	55,063,800	
飛島建設	1,900	1,131.00	2,148,900	
長谷工コーポレーション	21,600	1,492.00	32,227,200	
松井建設	2,600	779.00	2,025,400	
錢高組	300	4,065.00	1,219,500	
鹿島建設	48,300	1,455.00	70,276,500	
不動テトラ	1,600	1,865.00	2,984,000	
大末建設	800	990.00	792,000	
鉄建建設	1,300	1,910.00	2,483,000	
西松建設	4,700	3,545.00	16,661,500	
三井住友建設	15,900	489.00	7,775,100	
大豊建設	1,400	4,220.00	5,908,000	
前田建設工業	16,500	944.00	15,576,000	
佐田建設	1,500	481.00	721,500	
ナカノフドー建設	1,600	414.00	662,400	
奥村組	3,600	3,015.00	10,854,000	
東鉄工業	2,800	2,349.00	6,577,200	
イチケン	500	1,887.00	943,500	
富士ピー・エス	800	557.00	445,600	
淺沼組	800	4,745.00	3,796,000	
戸田建設	27,400	783.00	21,454,200	
熊谷組	3,100	2,897.00	8,980,700	
北野建設	400	2,316.00	926,400	
植木組	600	1,447.00	868,200	
矢作建設工業	2,900	731.00	2,119,900	
ピーエス三菱	2,200	617.00	1,357,400	
日本ハウスホールディングス	4,500	390.00	1,755,000	
大東建託	7,200	13,060.00	94,032,000	

新日本建設	2,800	867.00	2,427,600	
ＮＩＰＰＯ	5,500	3,130.00	17,215,000	
東亜道路工業	400	4,625.00	1,850,000	
前田道路	4,100	2,137.00	8,761,700	
日本道路	600	8,220.00	4,932,000	
東亜建設工業	1,800	2,494.00	4,489,200	
日本国土開発	6,400	584.00	3,737,600	
若築建設	1,200	1,713.00	2,055,600	
東洋建設	7,400	591.00	4,373,400	
五洋建設	28,000	761.00	21,308,000	
世紀東急工業	3,200	900.00	2,880,000	
福田組	800	4,865.00	3,892,000	
住友林業	16,900	2,106.00	35,591,400	
日本基礎技術	2,000	586.00	1,172,000	
巴コーポレーション	2,900	384.00	1,113,600	
大和ハウス工業	60,900	3,393.00	206,633,700	
ライト工業	3,800	1,941.00	7,375,800	
積水ハウス	71,500	2,249.00	160,803,500	
日特建設	1,600	771.00	1,233,600	
北陸電気工事	1,100	1,315.00	1,446,500	
ユアテック	3,800	739.00	2,808,200	
日本リーテック	1,400	1,783.00	2,496,200	
四電工	400	3,015.00	1,206,000	
中電工	3,000	2,309.00	6,927,000	
関電工	10,700	895.00	9,576,500	
きんでん	13,400	1,824.00	24,441,600	
東京エネシス	2,200	997.00	2,193,400	
トーエネック	700	3,735.00	2,614,500	
住友電設	1,900	2,189.00	4,159,100	
日本電設工業	3,600	1,932.00	6,955,200	
協和エクシオ	10,000	2,738.00	27,380,000	
新日本空調	1,700	2,140.00	3,638,000	
九電工	4,600	3,755.00	17,273,000	
三機工業	4,700	1,505.00	7,073,500	
日揮ホールディングス	22,000	999.00	21,978,000	
中外炉工業	700	1,954.00	1,367,800	

ヤマト	2,100	814.00	1,709,400	
太平電業	1,500	2,696.00	4,044,000	
高砂熱学工業	6,000	1,986.00	11,916,000	
三晃金属工業	300	2,432.00	729,600	
朝日工業社	500	3,235.00	1,617,500	
明星工業	4,300	758.00	3,259,400	
大氣社	3,200	3,515.00	11,248,000	
ダイダン	1,500	2,690.00	4,035,000	
日比谷総合設備	2,100	1,886.00	3,960,600	
フィル・カンパニー	400	2,745.00	1,098,000	
テスホールディングス	1,200	2,412.00	2,894,400	
東洋エンジニアリング	2,800	791.00	2,214,800	
レイズネクスト	3,500	1,148.00	4,018,000	
ニップン	6,200	1,601.00	9,926,200	
日清製粉グループ本社	23,800	1,719.00	40,912,200	
日東富士製粉	200	6,850.00	1,370,000	
昭和産業	1,800	3,040.00	5,472,000	
鳥越製粉	1,900	796.00	1,512,400	
中部飼料	2,600	1,140.00	2,964,000	
フィード・ワン	2,800	764.00	2,139,200	
東洋精糖	400	1,190.00	476,000	
日本甜菜製糖	1,100	1,647.00	1,811,700	
DM三井製糖ホールディングス	1,700	1,892.00	3,216,400	
塩水港精糖	2,500	223.00	557,500	
日新製糖	1,000	1,694.00	1,694,000	
森永製菓	5,000	3,600.00	18,000,000	
中村屋	500	3,770.00	1,885,000	
江崎グリコ	5,800	4,220.00	24,476,000	
名糖産業	900	1,603.00	1,442,700	
井村屋グループ	1,200	2,300.00	2,760,000	
不二家	1,300	2,208.00	2,870,400	
山崎製パン	15,800	1,557.00	24,600,600	
第一屋製パン	400	878.00	351,200	
モロゾフ	300	5,230.00	1,569,000	
亀田製菓	1,200	4,690.00	5,628,000	
寿スピリッツ	2,000	6,830.00	13,660,000	

カルビー	9,600	2,580.00	24,768,000	
森永乳業	3,900	6,160.00	24,024,000	
六甲バター	1,400	1,568.00	2,195,200	
ヤクルト本社	14,500	6,410.00	92,945,000	
明治ホールディングス	14,000	6,930.00	97,020,000	
雪印メグミルク	5,100	2,118.00	10,801,800	
プリマハム	3,000	3,060.00	9,180,000	
日本ハム	8,100	4,460.00	36,126,000	
林兼産業	700	590.00	413,000	
丸大食品	2,100	1,742.00	3,658,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,900	3,520.00	6,688,000	
柿安本店	700	2,553.00	1,787,100	
伊藤ハム米久ホールディングス	13,600	748.00	10,172,800	
サッポロホールディングス	7,200	2,327.00	16,754,400	
アサヒグループホールディングス	46,100	5,032.00	231,975,200	
キリンホールディングス	89,500	2,084.50	186,562,750	
宝ホールディングス	15,600	1,353.00	21,106,800	
オエノンホールディングス	6,000	379.00	2,274,000	
養命酒製造	600	1,824.00	1,094,400	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	16,200	1,876.00	30,391,200	
サントリー食品インターナショナル	14,100	4,005.00	56,470,500	
ダイドーグループホールディングス	1,200	5,060.00	6,072,000	
伊藤園	6,400	6,590.00	42,176,000	
キーコーヒー	2,100	2,117.00	4,445,700	
ユニカフェ	600	991.00	594,600	
ジャパンフーズ	300	1,234.00	370,200	
日清オイリオグループ	2,600	3,100.00	8,060,000	
不二製油グループ本社	5,100	2,563.00	13,071,300	
かどや製油	200	4,045.00	809,000	
Ｊ－オイルミルズ	2,000	1,890.00	3,780,000	
キッコーマン	15,200	7,130.00	108,376,000	
味の素	50,200	2,881.00	144,626,200	
ブルドックソース	1,000	2,422.00	2,422,000	
キユーピー	11,700	2,512.00	29,390,400	
ハウス食品グループ本社	7,900	3,445.00	27,215,500	

カゴメ	8,600	2,920.00	25,112,000	
焼津水産化学工業	1,000	965.00	965,000	
アリアケジャパン	1,900	6,680.00	12,692,000	
ピエトロ	300	1,734.00	520,200	
エバラ食品工業	500	2,678.00	1,339,000	
やまみ	200	1,850.00	370,000	
ニチレイ	10,100	3,015.00	30,451,500	
東洋水産	10,900	4,285.00	46,706,500	
イートアンドホールディングス	700	1,983.00	1,388,100	
大冷	200	2,002.00	400,400	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,200	800.00	960,000	
日清食品ホールディングス	8,300	7,970.00	66,151,000	
永谷園ホールディングス	1,000	2,168.00	2,168,000	
一正蒲鉾	800	924.00	739,200	
フジッコ	2,300	1,940.00	4,462,000	
ロック・フィールド	2,300	1,467.00	3,374,100	
日本たばこ産業	113,100	2,172.00	245,653,200	
ケンコーマヨネーズ	1,300	1,481.00	1,925,300	
わらべや日洋ホールディングス	1,400	2,439.00	3,414,600	
なとり	1,200	1,934.00	2,320,800	
イフジ産業	300	962.00	288,600	
ピックルスコーポレーション	500	3,585.00	1,792,500	
ファーマフーズ	2,000	3,110.00	6,220,000	
北の達人コーポレーション	7,400	550.00	4,070,000	
ユーグレナ	10,700	1,032.00	11,042,400	
紀文食品	1,200	1,314.00	1,576,800	
ミヨシ油脂	700	1,284.00	898,800	
理研ビタミン	2,000	1,633.00	3,266,000	
片倉工業	2,800	1,509.00	4,225,200	
グンゼ	1,500	4,700.00	7,050,000	
東洋紡	8,100	1,355.00	10,975,500	
ユニチカ	6,000	340.00	2,040,000	
富士紡ホールディングス	1,000	3,935.00	3,935,000	
倉敷紡績	1,800	1,975.00	3,555,000	
シキボウ	1,200	930.00	1,116,000	
日本毛織	6,800	975.00	6,630,000	

ダイトウボウ	3,200	101.00	323,200	
トーア紡コーポレーション	800	427.00	341,600	
ダイドーリミテッド	2,600	176.00	457,600	
帝国繊維	2,300	1,990.00	4,577,000	
帝人	19,400	1,660.00	32,204,000	
東レ	149,100	716.30	106,800,330	
サカイオーベックス	500	3,035.00	1,517,500	
住江織物	500	2,065.00	1,032,500	
日本フエルト	1,200	445.00	534,000	
イチカワ	300	1,297.00	389,100	
日東製網	200	1,505.00	301,000	
アツギ	1,600	624.00	998,400	
ダイニック	800	742.00	593,600	
セーレン	5,100	2,198.00	11,209,800	
ソトー	800	804.00	643,200	
東海染工	300	1,139.00	341,700	
小松マテーレ	3,400	955.00	3,247,000	
ワコールホールディングス	5,100	2,494.00	12,719,400	
ホギメディカル	2,800	3,530.00	9,884,000	
クラウディアホールディングス	500	290.00	145,000	
ＴＳＩホールディングス	6,200	358.00	2,219,600	
マツオカコーポレーション	700	1,581.00	1,106,700	
ワールド	2,700	1,396.00	3,769,200	
三陽商会	1,100	937.00	1,030,700	
ナイガイ	700	332.00	232,400	
オンワードホールディングス	12,400	314.00	3,893,600	
ルックホールディングス	700	1,432.00	1,002,400	
キムラタン	10,700	23.00	246,100	
ゴールドウイン	3,400	7,070.00	24,038,000	
デサント	3,500	3,135.00	10,972,500	
キング	1,100	448.00	492,800	
ヤマトインターナショナル	1,800	339.00	610,200	
特種東海製紙	1,300	4,460.00	5,798,000	
王子ホールディングス	92,700	633.00	58,679,100	
日本製紙	9,100	1,259.00	11,456,900	
三菱製紙	2,900	358.00	1,038,200	

北越コーポレーション	14,700	626.00	9,202,200	
中越パルプ工業	800	1,265.00	1,012,000	
巴川製紙所	700	959.00	671,300	
大王製紙	9,900	1,850.00	18,315,000	
阿波製紙	500	400.00	200,000	
レンゴー	21,200	922.00	19,546,400	
トーモク	1,300	1,958.00	2,545,400	
ザ・パック	1,600	2,802.00	4,483,200	
クラレ	32,400	1,021.00	33,080,400	
旭化成	136,500	1,189.50	162,366,750	
共和レザー	1,100	715.00	786,500	
昭和電工	15,600	3,055.00	47,658,000	
住友化学	162,100	565.00	91,586,500	
住友精化	1,000	3,740.00	3,740,000	
日産化学	11,300	5,410.00	61,133,000	
ラサ工業	700	1,815.00	1,270,500	
クレハ	1,800	7,250.00	13,050,000	
多木化学	800	5,660.00	4,528,000	
テイカ	1,500	1,238.00	1,857,000	
石原産業	3,700	1,141.00	4,221,700	
片倉コープアグリ	500	1,215.00	607,500	
日本曹達	2,900	3,390.00	9,831,000	
東ソー	31,800	1,893.00	60,197,400	
トクヤマ	6,100	2,269.00	13,840,900	
セントラル硝子	3,900	2,208.00	8,611,200	
東亞合成	12,600	1,137.00	14,326,200	
大阪ソーダ	2,100	2,450.00	5,145,000	
関東電化工業	4,900	1,034.00	5,066,600	
デンカ	7,500	3,760.00	28,200,000	
信越化学工業	38,100	17,735.00	675,703,500	
日本カーバイド工業	800	1,301.00	1,040,800	
堺化学工業	1,400	1,911.00	2,675,400	
第一稀元素化学工業	2,100	1,872.00	3,931,200	
エア・ウォーター	21,000	1,634.00	34,314,000	
日本酸素ホールディングス	17,000	2,411.00	40,987,000	
日本化学工業	600	3,090.00	1,854,000	

東邦アセチレン	300	1,158.00	347,400	
日本パーカライジング	10,400	1,145.00	11,908,000	
高圧ガス工業	3,300	668.00	2,204,400	
チタン工業	300	1,854.00	556,200	
四国化成工業	2,700	1,360.00	3,672,000	
戸田工業	400	2,651.00	1,060,400	
ステラ　ケミファ	1,100	2,851.00	3,136,100	
保土谷化学工業	600	3,985.00	2,391,000	
日本触媒	3,700	5,260.00	19,462,000	
大日精化工業	1,700	2,331.00	3,962,700	
カネカ	5,300	4,425.00	23,452,500	
三菱瓦斯化学	20,600	2,307.00	47,524,200	
三井化学	17,800	3,525.00	62,745,000	
ＪＳＲ	20,700	3,570.00	73,899,000	
東京応化工業	3,500	7,130.00	24,955,000	
大阪有機化学工業	1,900	3,730.00	7,087,000	
三菱ケミカルホールディングス	137,600	919.40	126,509,440	
ＫＨネオケム	3,400	2,539.00	8,632,600	
ダイセル	27,700	893.00	24,736,100	
住友ベークライト	3,200	4,760.00	15,232,000	
積水化学工業	43,100	1,907.00	82,191,700	
日本ゼオン	18,600	1,468.00	27,304,800	
アイカ工業	5,700	4,015.00	22,885,500	
宇部興産	10,400	2,208.00	22,963,200	
積水樹脂	3,100	2,164.00	6,708,400	
タキロンシーアイ	4,500	602.00	2,709,000	
旭有機材	1,200	1,358.00	1,629,600	
ニチバン	1,100	1,782.00	1,960,200	
リケンテクノス	5,000	612.00	3,060,000	
大倉工業	1,000	2,542.00	2,542,000	
積水化成品工業	2,800	617.00	1,727,600	
群栄化学工業	500	2,474.00	1,237,000	
タイガースポリマー	1,100	456.00	501,600	
ミライアル	700	1,255.00	878,500	
ダイキアクシス	800	824.00	659,200	
ダイキョーニシカワ	4,300	713.00	3,065,900	

竹本容器	700	1,036.00	725,200	
森六ホールディングス	1,100	2,259.00	2,484,900	
恵和	400	3,440.00	1,376,000	
日本化薬	12,700	1,129.00	14,338,300	
カーリットホールディングス	2,000	740.00	1,480,000	
日本精化	1,500	1,629.00	2,443,500	
扶桑化学工業	1,600	3,915.00	6,264,000	
トリケミカル研究所	1,900	3,005.00	5,709,500	
ＡＤＥＫＡ	9,500	2,230.00	21,185,000	
日油	7,800	5,610.00	43,758,000	
新日本理化	3,400	265.00	901,000	
ハリマ化成グループ	1,500	897.00	1,345,500	
花王	50,300	6,798.00	341,939,400	
第一工業製薬	700	3,275.00	2,292,500	
石原ケミカル	500	2,148.00	1,074,000	
日華化学	700	1,390.00	973,000	
ニイタカ	400	2,041.00	816,400	
三洋化成工業	1,200	5,750.00	6,900,000	
有機合成薬品工業	1,600	367.00	587,200	
大日本塗料	2,300	858.00	1,973,400	
日本ペイントホールディングス	84,900	1,402.00	119,029,800	
関西ペイント	23,100	2,754.00	63,617,400	
神東塗料	1,600	197.00	315,200	
中国塗料	5,000	886.00	4,430,000	
日本特殊塗料	1,500	1,088.00	1,632,000	
藤倉化成	2,800	507.00	1,419,600	
太陽ホールディングス	1,500	5,050.00	7,575,000	
ＤＩＣ	8,700	2,851.00	24,803,700	
サカタインクス	4,500	1,047.00	4,711,500	
東洋インキＳＣホールディングス	4,400	2,009.00	8,839,600	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	1,400	828.00	1,159,200	
富士フイルムホールディングス	36,900	8,059.00	297,377,100	
資生堂	41,800	7,630.00	318,934,000	
ライオン	27,300	1,946.00	53,125,800	
高砂香料工業	1,300	2,758.00	3,585,400	
マンダム	4,400	1,929.00	8,487,600	

ミルボン	2,800	6,210.00	17,388,000	
ファンケル	7,700	3,520.00	27,104,000	
コーセー	4,000	18,300.00	73,200,000	
コタ	1,300	1,457.00	1,894,100	
シーボン	300	1,957.00	587,100	
ポーラ・オルビスホールディングス	9,000	2,898.00	26,082,000	
ノエビアホールディングス	1,800	5,550.00	9,990,000	
アジュバンコスメジャパン	500	1,069.00	534,500	
新日本製薬	600	2,090.00	1,254,000	
エステー	1,400	1,737.00	2,431,800	
アグロ　カネショウ	800	1,379.00	1,103,200	
コニシ	3,500	1,665.00	5,827,500	
長谷川香料	3,600	2,578.00	9,280,800	
星光ＰＭＣ	1,200	951.00	1,141,200	
小林製薬	5,900	9,450.00	55,755,000	
荒川化学工業	1,800	1,194.00	2,149,200	
メック	1,400	3,310.00	4,634,000	
日本高純度化学	600	3,005.00	1,803,000	
タカラバイオ	5,500	2,824.00	15,532,000	
ＪＣＵ	2,400	3,875.00	9,300,000	
新田ゼラチン	1,300	629.00	817,700	
ＯＡＴアグリオ	400	1,371.00	548,400	
デクセリアルズ	5,900	2,398.00	14,148,200	
アース製薬	1,600	6,750.00	10,800,000	
北興化学工業	2,000	1,028.00	2,056,000	
大成ラミック	600	2,816.00	1,689,600	
クミアイ化学工業	8,700	853.00	7,421,100	
日本農薬	3,700	516.00	1,909,200	
アキレス	1,400	1,399.00	1,958,600	
有沢製作所	2,900	890.00	2,581,000	
日東電工	12,700	8,310.00	105,537,000	
レック	2,500	1,140.00	2,850,000	
三光合成	2,200	517.00	1,137,400	
きもと	3,200	309.00	988,800	
藤森工業	1,900	4,210.00	7,999,000	
前澤化成工業	1,300	1,241.00	1,613,300	

未来工業	800	1,629.00	1,303,200	
ウェーブロックホールディングス	700	698.00	488,600	
ＪＳＰ	1,200	1,642.00	1,970,400	
エフピコ	3,900	4,160.00	16,224,000	
天馬	1,600	2,644.00	4,230,400	
信越ポリマー	3,200	1,074.00	3,436,800	
東リ	5,200	240.00	1,248,000	
ニフコ	7,700	3,750.00	28,875,000	
バルカー	1,700	2,226.00	3,784,200	
ユニ・チャーム	44,600	4,450.00	198,470,000	
ショーエイコーポレーション	500	899.00	449,500	
協和キリン	21,100	3,735.00	78,808,500	
武田薬品工業	174,900	3,700.00	647,130,000	
アステラス製薬	182,300	1,921.50	350,289,450	
大日本住友製薬	15,600	2,282.00	35,599,200	
塩野義製薬	26,400	5,970.00	157,608,000	
わかもと製薬	2,500	314.00	785,000	
日本新薬	6,000	8,690.00	52,140,000	
ビオフェルミン製薬	400	3,155.00	1,262,000	
中外製薬	65,800	4,176.00	274,780,800	
科研製薬	3,600	4,895.00	17,622,000	
エーザイ	23,200	9,456.00	219,379,200	
ロート製薬	10,000	3,025.00	30,250,000	
小野薬品工業	48,300	2,539.50	122,657,850	
久光製薬	6,100	5,140.00	31,354,000	
持田製薬	2,900	3,670.00	10,643,000	
参天製薬	36,600	1,536.00	56,217,600	
扶桑薬品工業	700	2,305.00	1,613,500	
日本ケミファ	300	2,215.00	664,500	
ツムラ	7,000	3,495.00	24,465,000	
日医工	6,000	866.00	5,196,000	
キッセイ薬品工業	3,700	2,270.00	8,399,000	
生化学工業	3,700	1,096.00	4,055,200	
栄研化学	3,700	2,187.00	8,091,900	
日水製薬	800	1,001.00	800,800	
鳥居薬品	1,300	2,557.00	3,324,100	

ＪＣＲファーマ	5,900	3,315.00	19,558,500	
東和薬品	3,000	2,739.00	8,217,000	
富士製薬工業	1,300	1,138.00	1,479,400	
ゼリア新薬工業	3,800	2,103.00	7,991,400	
第一三共	165,200	2,256.50	372,773,800	
キョーリン製薬ホールディングス	4,600	1,820.00	8,372,000	
大幸薬品	2,600	999.00	2,597,400	
ダイト	1,300	3,295.00	4,283,500	
大塚ホールディングス	43,700	4,506.00	196,912,200	
大正製薬ホールディングス	5,000	6,330.00	31,650,000	
ペプチドリーム	11,000	4,740.00	52,140,000	
あすか製薬ホールディングス	2,400	987.00	2,368,800	
サワイグループホールディングス	4,600	4,720.00	21,712,000	
日本コークス工業	17,700	101.00	1,787,700	
ニチレキ	2,500	1,380.00	3,450,000	
ユシロ化学工業	1,200	1,175.00	1,410,000	
ビーピー・カストロール	700	1,349.00	944,300	
富士石油	5,100	248.00	1,264,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	800	1,146.00	916,800	
出光興産	23,300	2,570.00	59,881,000	
ＥＮＥＯＳホールディングス	316,300	454.70	143,821,610	
コスモエネルギーホールディングス	6,600	2,476.00	16,341,600	
横浜ゴム	12,200	2,192.00	26,742,400	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	11,100	2,092.00	23,221,200	
ブリヂストン	55,900	4,772.00	266,754,800	
住友ゴム工業	18,900	1,509.00	28,520,100	
藤倉コンポジット	1,800	498.00	896,400	
オカモト	1,200	4,220.00	5,064,000	
フコク	900	979.00	881,100	
ニッタ	2,200	2,605.00	5,731,000	
住友理工	4,100	800.00	3,280,000	
三ツ星ベルト	2,600	1,844.00	4,794,400	
バンドー化学	3,700	920.00	3,404,000	
日東紡績	3,100	3,355.00	10,400,500	
ＡＧＣ	19,300	4,700.00	90,710,000	
日本板硝子	10,700	628.00	6,719,600	

石塚硝子	400	1,915.00	766,000	
日本山村硝子	900	959.00	863,100	
日本電気硝子	7,800	2,526.00	19,702,800	
オハラ	800	1,372.00	1,097,600	
住友大阪セメント	3,800	3,080.00	11,704,000	
太平洋セメント	11,900	2,540.00	30,226,000	
日本ヒューム	1,900	729.00	1,385,100	
日本コンクリート工業	4,500	315.00	1,417,500	
三谷セキサン	1,000	4,595.00	4,595,000	
アジアパイルホールディングス	3,200	473.00	1,513,600	
東海カーボン	20,600	1,429.00	29,437,400	
日本カーボン	1,200	4,090.00	4,908,000	
東洋炭素	1,200	2,937.00	3,524,400	
ノリタケカンパニーリミテド	1,200	4,335.00	5,202,000	
ＴＯＴＯ	15,000	5,730.00	85,950,000	
日本碍子	23,100	1,802.00	41,626,200	
日本特殊陶業	16,000	1,620.00	25,920,000	
ダントーホールディングス	1,500	249.00	373,500	
ＭＡＲＵＷＡ	700	10,780.00	7,546,000	
品川リフラクトリーズ	500	4,135.00	2,067,500	
黒崎播磨	400	4,825.00	1,930,000	
ヨータイ	1,500	1,287.00	1,930,500	
イソライト工業	900	684.00	615,600	
東京窯業	2,700	318.00	858,600	
ニッカトー	1,000	670.00	670,000	
フジミインコーポレーテッド	1,700	4,855.00	8,253,500	
クニミネ工業	700	1,133.00	793,100	
エーアンドエーマテリアル	400	1,023.00	409,200	
ニチアス	5,300	2,822.00	14,956,600	
ニチハ	2,900	2,941.00	8,528,900	
日本製鉄	99,200	1,812.00	179,750,400	
神戸製鋼所	38,100	704.00	26,822,400	
中山製鋼所	2,900	395.00	1,145,500	
合同製鐵	1,100	1,631.00	1,794,100	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	60,200	1,290.00	77,658,000	
東京製鐵	8,100	1,169.00	9,468,900	

共英製鋼	2,300	1,420.00	3,266,000	
大和工業	4,400	3,730.00	16,412,000	
東京鐵鋼	800	1,602.00	1,281,600	
大阪製鐵	1,100	1,150.00	1,265,000	
淀川製鋼所	2,700	2,372.00	6,404,400	
丸一鋼管	6,700	2,657.00	17,801,900	
モリ工業	600	2,301.00	1,380,600	
大同特殊鋼	3,400	5,410.00	18,394,000	
日本高周波鋼業	800	388.00	310,400	
日本冶金工業	1,600	2,331.00	3,729,600	
山陽特殊製鋼	2,500	1,713.00	4,282,500	
愛知製鋼	1,200	3,120.00	3,744,000	
日立金属	17,100	2,132.00	36,457,200	
日本金属	500	967.00	483,500	
大平洋金属	1,400	1,657.00	2,319,800	
新日本電工	13,400	302.00	4,046,800	
栗本鐵工所	900	1,667.00	1,500,300	
虹技	300	1,130.00	339,000	
日本鋳鉄管	200	1,253.00	250,600	
三菱製鋼	1,500	1,048.00	1,572,000	
日亜鋼業	3,000	297.00	891,000	
日本精線	300	4,755.00	1,426,500	
エンビプロ・ホールディングス	900	1,272.00	1,144,800	
シンニッタン	2,500	255.00	637,500	
新家工業	500	1,486.00	743,000	
大紀アルミニウム工業所	3,100	1,195.00	3,704,500	
日本軽金属ホールディングス	5,700	1,870.00	10,659,000	
三井金属鉱業	5,600	3,045.00	17,052,000	
東邦亜鉛	1,200	1,857.00	2,228,400	
三菱マテリアル	13,700	2,251.00	30,838,700	
住友金属鉱山	26,600	4,280.00	113,848,000	
ＤＯＷＡホールディングス	5,300	4,215.00	22,339,500	
古河機械金属	3,400	1,272.00	4,324,800	
エス・サイエンス	9,300	38.00	353,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,200	754.00	1,658,800	
東邦チタニウム	3,700	1,036.00	3,833,200	

ＵＡＣＪ	3,200	2,836.00	9,075,200	
ＣＫサンエツ	400	2,903.00	1,161,200	
古河電気工業	6,500	2,734.00	17,771,000	
住友電気工業	72,600	1,569.00	113,909,400	
フジクラ	25,100	551.00	13,830,100	
昭和電線ホールディングス	2,000	1,742.00	3,484,000	
東京特殊電線	300	2,608.00	782,400	
タツタ電線	3,700	575.00	2,127,500	
カナレ電気	300	1,689.00	506,700	
平河ヒューテック	1,200	1,202.00	1,442,400	
リョービ	2,600	1,436.00	3,733,600	
アーレスティ	2,600	475.00	1,235,000	
アサヒホールディングス	7,800	2,160.00	16,848,000	
稲葉製作所	1,200	1,499.00	1,798,800	
宮地エンジニアリンググループ	700	2,563.00	1,794,100	
トーカロ	5,400	1,405.00	7,587,000	
アルファＣｏ	700	1,144.00	800,800	
ＳＵＭＣＯ	26,500	2,635.00	69,827,500	
川田テクノロジーズ	400	3,730.00	1,492,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	700	5,860.00	4,102,000	
ジェイテックコーポレーション	200	3,440.00	688,000	
信和	1,100	702.00	772,200	
東洋製罐グループホールディングス	13,200	1,462.00	19,298,400	
ホッカンホールディングス	1,100	1,402.00	1,542,200	
コロナ	1,100	904.00	994,400	
横河ブリッジホールディングス	3,600	2,048.00	7,372,800	
駒井ハルテック	400	1,714.00	685,600	
高田機工	200	2,812.00	562,400	
三和ホールディングス	19,600	1,343.00	26,322,800	
文化シヤッター	6,100	1,211.00	7,387,100	
三協立山	2,700	819.00	2,211,300	
アルインコ	1,400	1,000.00	1,400,000	
東洋シヤッター	500	655.00	327,500	
ＬＩＸＩＬ	28,600	2,963.00	84,741,800	
日本フイルコン	1,400	502.00	702,800	
ノーリツ	4,300	1,917.00	8,243,100	

長府製作所	2,100	2,063.00	4,332,300	
リンナイ	4,000	10,430.00	41,720,000	
ダイニチ工業	1,000	759.00	759,000	
日東精工	2,600	594.00	1,544,400	
三洋工業	300	1,883.00	564,900	
岡部	4,200	658.00	2,763,600	
ジーテクト	2,600	1,561.00	4,058,600	
東プレ	3,900	1,601.00	6,243,900	
高周波熱錬	4,000	573.00	2,292,000	
東京製綱	1,500	1,118.00	1,677,000	
サンコール	1,800	452.00	813,600	
モリテック　スチール	1,600	475.00	760,000	
パイオラックス	3,100	1,541.00	4,777,100	
エイチワン	2,000	744.00	1,488,000	
日本発條	20,700	853.00	17,657,100	
中央発條	1,000	1,398.00	1,398,000	
アドバネクス	300	1,264.00	379,200	
立川ブラインド工業	900	1,299.00	1,169,100	
三益半導体工業	1,600	2,416.00	3,865,600	
日本ドライケミカル	500	1,862.00	931,000	
日本製鋼所	6,300	2,723.00	17,154,900	
三浦工業	9,000	4,960.00	44,640,000	
タクマ	7,000	1,731.00	12,117,000	
ツガミ	4,300	1,678.00	7,215,400	
オークマ	2,400	5,320.00	12,768,000	
芝浦機械	2,200	2,531.00	5,568,200	
アマダ	30,500	1,135.00	34,617,500	
アイダエンジニアリング	5,400	988.00	5,335,200	
滝澤鉄工所	600	1,117.00	670,200	
ＦＵＪＩ	8,300	2,596.00	21,546,800	
牧野フライス製作所	2,400	4,095.00	9,828,000	
オーエスジー	10,300	2,088.00	21,506,400	
ダイジェット工業	200	1,285.00	257,000	
旭ダイヤモンド工業	5,500	533.00	2,931,500	
DMG森精機	13,200	1,751.00	23,113,200	
ソディック	5,000	1,030.00	5,150,000	

ディスコ	2,800	31,050.00	86,940,000	
日東工器	1,000	1,906.00	1,906,000	
日進工具	1,600	1,510.00	2,416,000	
パンチ工業	1,700	607.00	1,031,900	
冨士ダイス	1,000	690.00	690,000	
豊和工業	1,100	810.00	891,000	
ＯＫＫ	800	409.00	327,200	
石川製作所	500	1,572.00	786,000	
東洋機械金属	1,500	514.00	771,000	
津田駒工業	400	866.00	346,400	
エンシュウ	500	842.00	421,000	
島精機製作所	3,000	1,865.00	5,595,000	
オプトラン	2,600	2,258.00	5,870,800	
ＮＣホールディングス	600	1,200.00	720,000	
イワキポンプ	1,300	927.00	1,205,100	
フリュー	2,000	1,407.00	2,814,000	
ヤマシンフィルタ	4,200	703.00	2,952,600	
日阪製作所	2,600	832.00	2,163,200	
やまびこ	4,000	1,256.00	5,024,000	
平田機工	1,000	6,240.00	6,240,000	
ペガサスミシン製造	2,100	474.00	995,400	
マルマエ	900	2,198.00	1,978,200	
タツモ	900	1,727.00	1,554,300	
ナブテスコ	12,300	4,295.00	52,828,500	
三井海洋開発	2,200	1,885.00	4,147,000	
レオン自動機	2,000	1,480.00	2,960,000	
ＳＭＣ	6,200	65,790.00	407,898,000	
ホソカワミクロン	700	6,300.00	4,410,000	
ユニオンツール	800	4,095.00	3,276,000	
オイレス工業	2,900	1,621.00	4,700,900	
日精エー・エス・ビー機械	700	4,820.00	3,374,000	
サトーホールディングス	2,700	2,786.00	7,522,200	
技研製作所	1,800	4,615.00	8,307,000	
日本エアーテック	700	1,281.00	896,700	
カワタ	600	883.00	529,800	
日精樹脂工業	1,600	1,391.00	2,225,600	

オカダアイヨン	700	1,313.00	919,100	
ワイエイシイホールディングス	800	1,145.00	916,000	
小松製作所	95,300	2,757.50	262,789,750	
住友重機械工業	12,000	3,055.00	36,660,000	
日立建機	9,800	3,190.00	31,262,000	
日工	3,100	693.00	2,148,300	
巴工業	800	2,291.00	1,832,800	
井関農機	2,100	1,486.00	3,120,600	
ＴＯＷＡ	2,000	2,057.00	4,114,000	
丸山製作所	400	1,819.00	727,600	
北川鉄工所	900	1,682.00	1,513,800	
ローツェ	900	8,490.00	7,641,000	
タカキタ	700	583.00	408,100	
クボタ	110,400	2,285.50	252,319,200	
荏原実業	1,100	2,873.00	3,160,300	
三菱化工機	700	2,522.00	1,765,400	
月島機械	3,900	1,165.00	4,543,500	
帝国電機製作所	1,500	1,234.00	1,851,000	
東京機械製作所	900	901.00	810,900	
新東工業	5,000	807.00	4,035,000	
澁谷工業	1,800	3,110.00	5,598,000	
アイチ　コーポレーション	3,600	850.00	3,060,000	
小森コーポレーション	5,300	845.00	4,478,500	
鶴見製作所	1,600	1,767.00	2,827,200	
住友精密工業	300	2,792.00	837,600	
日本ギア工業	800	322.00	257,600	
酒井重工業	400	2,608.00	1,043,200	
荏原製作所	8,700	5,360.00	46,632,000	
石井鐵工所	300	3,015.00	904,500	
酉島製作所	2,100	868.00	1,822,800	
北越工業	2,200	1,122.00	2,468,400	
ダイキン工業	26,800	22,645.00	606,886,000	
オルガノ	700	5,990.00	4,193,000	
トーヨーカネツ	800	2,412.00	1,929,600	
栗田工業	11,400	5,600.00	63,840,000	
椿本チエイン	3,000	3,440.00	10,320,000	

大同工業	1,000	1,125.00	1,125,000	
木村化工機	1,700	883.00	1,501,100	
アネスト岩田	3,500	1,058.00	3,703,000	
ダイフク	11,600	9,980.00	115,768,000	
サムコ	500	3,080.00	1,540,000	
加藤製作所	1,100	972.00	1,069,200	
油研工業	400	1,792.00	716,800	
タダノ	10,100	1,119.00	11,301,900	
フジテック	7,200	2,463.00	17,733,600	
ＣＫＤ	4,900	2,210.00	10,829,000	
キトー	1,800	1,689.00	3,040,200	
平和	5,900	1,997.00	11,782,300	
理想科学工業	1,500	1,800.00	2,700,000	
ＳＡＮＫＹＯ	5,000	2,811.00	14,055,000	
日本金銭機械	2,300	569.00	1,308,700	
マースグループホールディングス	1,300	1,632.00	2,121,600	
フクシマガリレイ	1,400	4,615.00	6,461,000	
オーイズミ	900	377.00	339,300	
ダイコク電機	1,000	910.00	910,000	
竹内製作所	3,500	2,754.00	9,639,000	
アマノ	5,500	2,825.00	15,537,500	
ＪＵＫＩ	2,900	825.00	2,392,500	
サンデンホールディングス	2,900	326.00	945,400	
蛇の目ミシン工業	1,900	775.00	1,472,500	
マックス	2,800	1,866.00	5,224,800	
グローリー	5,400	2,411.00	13,019,400	
新晃工業	2,000	2,067.00	4,134,000	
大和冷機工業	3,400	1,091.00	3,709,400	
セガサミーホールディングス	19,100	1,459.00	27,866,900	
日本ピストンリング	800	1,319.00	1,055,200	
リケン	1,000	2,615.00	2,615,000	
ＴＰＲ	2,800	1,522.00	4,261,600	
ツバキ・ナカシマ	4,100	1,635.00	6,703,500	
ホシザキ	6,600	9,320.00	61,512,000	
大豊工業	1,700	972.00	1,652,400	
日本精工	43,200	932.00	40,262,400	

ＮＴＮ	48,700	291.00	14,171,700	
ジェイテクト	20,200	1,124.00	22,704,800	
不二越	2,000	4,490.00	8,980,000	
日本トムソン	5,800	662.00	3,839,600	
ＴＨＫ	13,100	3,265.00	42,771,500	
ユーシン精機	1,400	876.00	1,226,400	
前澤給装工業	1,500	992.00	1,488,000	
イーグル工業	2,600	1,262.00	3,281,200	
前澤工業	1,300	673.00	874,900	
日本ピラー工業	2,100	2,345.00	4,924,500	
キッツ	6,500	794.00	5,161,000	
マキタ	27,400	5,760.00	157,824,000	
日立造船	16,700	791.00	13,209,700	
三菱重工業	33,000	3,134.00	103,422,000	
ＩＨＩ	14,100	2,498.00	35,221,800	
スター精密	3,200	1,692.00	5,414,400	
日清紡ホールディングス	12,900	942.00	12,151,800	
イビデン	10,100	5,790.00	58,479,000	
コニカミノルタ	42,700	599.00	25,577,300	
ブラザー工業	25,700	2,318.00	59,572,600	
ミネベアミツミ	36,200	3,065.00	110,953,000	
日立製作所	101,100	6,497.00	656,846,700	
東芝	41,600	4,800.00	199,680,000	
三菱電機	210,200	1,502.50	315,825,500	
富士電機	12,700	5,140.00	65,278,000	
東洋電機製造	800	1,146.00	916,800	
安川電機	22,600	5,320.00	120,232,000	
シンフォニアテクノロジー	2,700	1,292.00	3,488,400	
明電舎	3,600	2,347.00	8,449,200	
オリジン	600	1,329.00	797,400	
山洋電気	1,000	7,630.00	7,630,000	
デンヨー	1,800	2,056.00	3,700,800	
東芝テック	2,300	4,520.00	10,396,000	
芝浦メカトロニクス	400	7,470.00	2,988,000	
マブチモーター	5,800	4,145.00	24,041,000	
日本電産	50,600	12,580.00	636,548,000	

ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,100	805.00	885,500	
トレックス・セミコンダクター	1,100	2,962.00	3,258,200	
東光高岳	1,100	1,349.00	1,483,900	
ダブル・スコープ	5,000	759.00	3,795,000	
宮越ホールディングス	800	1,061.00	848,800	
ダイヘン	2,300	4,895.00	11,258,500	
ヤーマン	3,400	1,347.00	4,579,800	
ＪＶＣケンウッド	18,200	239.00	4,349,800	
ミマキエンジニアリング	1,900	781.00	1,483,900	
Ｉ－ＰＥＸ	1,000	2,552.00	2,552,000	
日新電機	4,900	1,346.00	6,595,400	
大崎電気工業	4,200	624.00	2,620,800	
オムロン	17,500	9,270.00	162,225,000	
日東工業	3,100	1,841.00	5,707,100	
ＩＤＥＣ	2,800	2,204.00	6,171,200	
正興電機製作所	700	1,825.00	1,277,500	
不二電機工業	300	1,290.00	387,000	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	7,600	2,825.00	21,470,000	
サクサホールディングス	500	1,332.00	666,000	
メルコホールディングス	700	5,700.00	3,990,000	
テクノメディカ	500	1,610.00	805,000	
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	3,350.00	2,010,000	
日本電気	26,700	5,670.00	151,389,000	
富士通	18,900	20,230.00	382,347,000	
沖電気工業	8,500	1,010.00	8,585,000	
岩崎通信機	900	950.00	855,000	
電気興業	1,000	2,278.00	2,278,000	
サンケン電気	2,500	5,230.00	13,075,000	
ナカヨ	400	1,427.00	570,800	
アイホン	1,200	2,000.00	2,400,000	
ルネサスエレクトロニクス	100,700	1,147.00	115,502,900	
セイコーエプソン	26,100	1,893.00	49,407,300	
ワコム	15,200	660.00	10,032,000	
アルバック	3,900	5,410.00	21,099,000	
アクセル	900	868.00	781,200	

ＥＩＺＯ	1,800	4,765.00	8,577,000	
ジャパンディスプレイ	71,400	33.00	2,356,200	
日本信号	4,900	916.00	4,488,400	
京三製作所	4,500	423.00	1,903,500	
能美防災	2,800	2,144.00	6,003,200	
ホーチキ	1,500	1,161.00	1,741,500	
星和電機	1,000	525.00	525,000	
エレコム	4,800	1,984.00	9,523,200	
パナソニック	224,200	1,320.50	296,056,100	
シャープ	28,000	1,733.00	48,524,000	
アンリツ	12,600	2,048.00	25,804,800	
富士通ゼネラル	6,400	2,883.00	18,451,200	
ソニーグループ	131,700	10,975.00	1,445,407,500	
ＴＤＫ	10,200	13,180.00	134,436,000	
帝国通信工業	900	1,139.00	1,025,100	
タムラ製作所	7,600	940.00	7,144,000	
アルプスアルパイン	17,200	1,148.00	19,745,600	
池上通信機	700	822.00	575,400	
日本電波工業	2,000	864.00	1,728,000	
鈴木	900	935.00	841,500	
日本トリム	500	3,675.00	1,837,500	
ローランド　ディー．ジー．	1,200	2,782.00	3,338,400	
フォスター電機	2,100	927.00	1,946,700	
ＳＭＫ	500	2,459.00	1,229,500	
ヨコオ	1,700	2,640.00	4,488,000	
ティアック	1,300	123.00	159,900	
ホシデン	5,500	1,021.00	5,615,500	
ヒロセ電機	3,200	16,620.00	53,184,000	
日本航空電子工業	4,800	1,793.00	8,606,400	
ＴＯＡ	2,500	845.00	2,112,500	
マクセルホールディングス	4,200	1,276.00	5,359,200	
古野電気	2,700	1,105.00	2,983,500	
ユニデンホールディングス	500	2,716.00	1,358,000	
スミダコーポレーション	1,800	1,339.00	2,410,200	
アイコム	900	2,407.00	2,166,300	
リオン	900	2,747.00	2,472,300	

本多通信工業	1,600	503.00	804,800	
船井電機	900	917.00	825,300	
横河電機	21,000	1,670.00	35,070,000	
新電元工業	800	4,435.00	3,548,000	
アズビル	14,200	4,505.00	63,971,000	
東亜ディーケーケー	1,000	821.00	821,000	
日本光電工業	8,700	3,310.00	28,797,000	
チノー	700	1,532.00	1,072,400	
共和電業	2,200	380.00	836,000	
日本電子材料	900	1,772.00	1,594,800	
堀場製作所	4,200	7,060.00	29,652,000	
アドバンテスト	15,600	9,270.00	144,612,000	
小野測器	900	604.00	543,600	
エスペック	1,900	2,224.00	4,225,600	
キーエンス	20,600	57,530.00	1,185,118,000	
日置電機	1,000	7,030.00	7,030,000	
シスメックス	16,400	13,300.00	218,120,000	
日本マイクロニクス	3,700	1,393.00	5,154,100	
メガチップス	2,100	3,295.00	6,919,500	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,000	3,855.00	3,855,000	
澤藤電機	200	2,136.00	427,200	
原田工業	900	919.00	827,100	
コーセル	2,600	1,015.00	2,639,000	
イリソ電子工業	1,800	5,260.00	9,468,000	
オプテックスグループ	3,400	1,762.00	5,990,800	
千代田インテグレ	900	1,803.00	1,622,700	
アイ・オー・データ機器	800	1,005.00	804,000	
レーザーテック	9,200	21,720.00	199,824,000	
スタンレー電気	14,700	3,135.00	46,084,500	
岩崎電気	800	2,100.00	1,680,000	
ウシオ電機	10,800	1,990.00	21,492,000	
岡谷電機産業	1,500	377.00	565,500	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1,900	350.00	665,000	
エノモト	600	1,710.00	1,026,000	
日本セラミック	2,100	2,877.00	6,041,700	
遠藤照明	1,100	750.00	825,000	

古河電池	1,500	1,560.00	2,340,000	
双信電機	1,000	576.00	576,000	
山一電機	1,400	1,640.00	2,296,000	
図研	1,400	3,575.00	5,005,000	
日本電子	3,800	7,090.00	26,942,000	
カシオ計算機	16,900	1,792.00	30,284,800	
ファナック	18,500	25,355.00	469,067,500	
日本シイエムケイ	4,500	431.00	1,939,500	
エンプラス	1,000	3,435.00	3,435,000	
大真空	700	3,565.00	2,495,500	
ローム	8,700	10,250.00	89,175,000	
浜松ホトニクス	15,100	6,300.00	95,130,000	
三井ハイテック	2,100	6,420.00	13,482,000	
新光電気工業	7,100	3,835.00	27,228,500	
京セラ	32,000	6,795.00	217,440,000	
太陽誘電	9,300	5,380.00	50,034,000	
村田製作所	61,800	9,022.00	557,559,600	
双葉電子工業	3,600	797.00	2,869,200	
北陸電気工業	800	1,095.00	876,000	
ニチコン	6,600	1,164.00	7,682,400	
日本ケミコン	2,100	2,568.00	5,392,800	
ＫＯＡ	2,900	1,663.00	4,822,700	
市光工業	3,100	706.00	2,188,600	
小糸製作所	12,600	6,790.00	85,554,000	
ミツバ	3,900	814.00	3,174,600	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	3,600	9,550.00	34,380,000	
キヤノン電子	1,900	1,630.00	3,097,000	
キヤノン	104,500	2,620.50	273,842,250	
リコー	53,500	1,205.00	64,467,500	
象印マホービン	5,700	1,564.00	8,914,800	
ＭＵＴＯＨホールディングス	300	1,582.00	474,600	
東京エレクトロン	12,300	45,370.00	558,051,000	
トヨタ紡織	6,100	2,269.00	13,840,900	
芦森工業	400	1,181.00	472,400	
ユニプレス	3,400	954.00	3,243,600	
豊田自動織機	17,000	9,300.00	158,100,000	

モリタホールディングス	3,400	1,647.00	5,599,800	
三櫻工業	2,900	1,180.00	3,422,000	
デンソー	46,300	7,330.00	339,379,000	
東海理化電機製作所	5,500	1,776.00	9,768,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	8,100	505.00	4,090,500	
川崎重工業	16,400	2,280.00	37,392,000	
名村造船所	6,300	201.00	1,266,300	
サノヤスホールディングス	2,500	151.00	377,500	
日本車輌製造	800	2,119.00	1,695,200	
三菱ロジスネクスト	2,800	986.00	2,760,800	
近畿車輛	400	1,198.00	479,200	
日産自動車	247,900	559.80	138,774,420	
いすゞ自動車	55,800	1,401.00	78,175,800	
トヨタ自動車	213,000	9,829.00	2,093,577,000	
日野自動車	26,300	909.00	23,906,700	
三菱自動車工業	77,800	278.00	21,628,400	
エフテック	1,500	785.00	1,177,500	
レシップホールディングス	800	574.00	459,200	
ＧＭＢ	400	1,221.00	488,400	
ファルテック	400	728.00	291,200	
武蔵精密工業	4,700	2,327.00	10,936,900	
日産車体	3,100	738.00	2,287,800	
新明和工業	5,900	951.00	5,610,900	
極東開発工業	3,600	1,568.00	5,644,800	
トピー工業	1,700	1,284.00	2,182,800	
ティラド	700	2,769.00	1,938,300	
曙ブレーキ工業	11,500	168.00	1,932,000	
タチエス	3,200	1,462.00	4,678,400	
ＮＯＫ	10,200	1,447.00	14,759,400	
フタバ産業	5,300	583.00	3,089,900	
ＫＹＢ	2,400	3,645.00	8,748,000	
大同メタル工業	4,300	609.00	2,618,700	
プレス工業	10,400	363.00	3,775,200	
ミクニ	2,700	317.00	855,900	
太平洋工業	4,400	1,215.00	5,346,000	
河西工業	2,800	403.00	1,128,400	

アイシン	15,400	4,725.00	72,765,000	
マツダ	66,000	1,008.00	66,528,000	
今仙電機製作所	1,800	702.00	1,263,600	
本田技研工業	165,500	3,440.00	569,320,000	
スズキ	41,700	4,479.00	186,774,300	
ＳＵＢＡＲＵ	60,200	2,084.00	125,456,800	
安永	1,000	1,142.00	1,142,000	
ヤマハ発動機	29,700	2,733.00	81,170,100	
ＴＢＫ	2,500	412.00	1,030,000	
エクセディ	2,900	1,710.00	4,959,000	
豊田合成	6,800	2,649.00	18,013,200	
愛三工業	3,300	969.00	3,197,700	
盟和産業	300	1,000.00	300,000	
日本プラスト	1,800	701.00	1,261,800	
ヨロズ	1,800	1,223.00	2,201,400	
エフ・シー・シー	3,400	1,571.00	5,341,400	
シマノ	7,900	28,395.00	224,320,500	
テイ・エス　テック	9,800	1,680.00	16,464,000	
ジャムコ	1,200	1,024.00	1,228,800	
テルモ	64,400	4,246.00	273,442,400	
クリエートメディック	700	979.00	685,300	
日機装	6,800	1,134.00	7,711,200	
日本エム・ディ・エム	1,200	2,389.00	2,866,800	
島津製作所	27,100	4,455.00	120,730,500	
ＪＭＳ	1,800	820.00	1,476,000	
クボテック	500	318.00	159,000	
長野計器	1,500	1,037.00	1,555,500	
ブイ・テクノロジー	1,000	4,930.00	4,930,000	
東京計器	1,300	1,059.00	1,376,700	
愛知時計電機	300	4,495.00	1,348,500	
インターアクション	1,100	2,298.00	2,527,800	
オーバル	1,900	285.00	541,500	
東京精密	3,500	4,695.00	16,432,500	
マニー	8,400	2,423.00	20,353,200	
ニコン	32,100	1,029.00	33,030,900	
トプコン	10,600	1,566.00	16,599,600	

オリンパス	116,300	2,240.00	260,512,000	
理研計器	1,900	2,599.00	4,938,100	
タムロン	1,700	2,592.00	4,406,400	
ＨＯＹＡ	41,000	15,120.00	619,920,000	
シード	800	746.00	596,800	
ノーリツ鋼機	1,900	2,441.00	4,637,900	
エー・アンド・デイ	1,800	975.00	1,755,000	
朝日インテック	22,300	2,953.00	65,851,900	
シチズン時計	26,700	419.00	11,187,300	
リズム	700	891.00	623,700	
大研医器	1,700	536.00	911,200	
メニコン	3,200	7,900.00	25,280,000	
シンシア	200	573.00	114,600	
松風	1,000	1,995.00	1,995,000	
セイコーホールディングス	3,000	2,284.00	6,852,000	
ニプロ	15,700	1,347.00	21,147,900	
中本パックス	500	1,770.00	885,000	
スノーピーク	1,200	3,925.00	4,710,000	
パラマウントベッドホールディングス	4,000	2,014.00	8,056,000	
トランザクション	1,200	1,296.00	1,555,200	
粧美堂	600	417.00	250,200	
ニホンフラッシュ	1,800	1,270.00	2,286,000	
前田工繊	2,300	3,670.00	8,441,000	
永大産業	2,700	297.00	801,900	
アートネイチャー	2,000	692.00	1,384,000	
バンダイナムコホールディングス	17,400	7,231.00	125,819,400	
アイフィスジャパン	500	670.00	335,000	
共立印刷	3,500	142.00	497,000	
ＳＨＯＥＩ	2,000	4,360.00	8,720,000	
フランスベッドホールディングス	2,700	928.00	2,505,600	
パイロットコーポレーション	3,500	3,870.00	13,545,000	
萩原工業	1,200	1,469.00	1,762,800	
トッパン・フォームズ	3,800	1,089.00	4,138,200	
フジシールインターナショナル	4,300	2,312.00	9,941,600	
タカラトミー	9,400	989.00	9,296,600	
廣済堂	1,500	835.00	1,252,500	

エステールホールディングス	600	640.00	384,000	
タカノ	700	673.00	471,100	
プロネクサス	1,700	1,017.00	1,728,900	
ホクシン	1,200	158.00	189,600	
ウッドワン	700	1,205.00	843,500	
大建工業	1,400	2,203.00	3,084,200	
凸版印刷	32,000	1,873.00	59,936,000	
大日本印刷	24,800	2,539.00	62,967,200	
共同印刷	600	2,670.00	1,602,000	
ＮＩＳＳＨＡ	4,300	1,586.00	6,819,800	
光村印刷	200	1,571.00	314,200	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	1,000	1,789.00	1,789,000	
アシックス	18,600	2,479.00	46,109,400	
ツツミ	500	2,385.00	1,192,500	
ローランド	1,600	5,460.00	8,736,000	
小松ウオール工業	600	1,951.00	1,170,600	
ヤマハ	12,500	6,130.00	76,625,000	
河合楽器製作所	600	4,220.00	2,532,000	
クリナップ	2,000	540.00	1,080,000	
ピジョン	13,500	3,200.00	43,200,000	
オリバー	400	3,780.00	1,512,000	
兼松サステック	100	1,800.00	180,000	
キングジム	1,700	890.00	1,513,000	
リンテック	4,500	2,413.00	10,858,500	
イトーキ	4,200	355.00	1,491,000	
任天堂	12,000	60,120.00	721,440,000	
三菱鉛筆	3,500	1,434.00	5,019,000	
タカラスタンダード	4,300	1,648.00	7,086,400	
コクヨ	10,100	1,783.00	18,008,300	
ナカバヤシ	2,100	590.00	1,239,000	
グローブライド	1,000	5,560.00	5,560,000	
オカムラ	7,200	1,533.00	11,037,600	
美津濃	2,100	2,633.00	5,529,300	
東京電力ホールディングス	178,300	312.00	55,629,600	
中部電力	64,300	1,327.00	85,326,100	
関西電力	79,700	1,047.50	83,485,750	

中国電力	30,300	1,012.00	30,663,600	
北陸電力	19,200	584.00	11,212,800	
東北電力	49,200	854.00	42,016,800	
四国電力	17,500	764.00	13,370,000	
九州電力	46,400	838.00	38,883,200	
北海道電力	19,700	504.00	9,928,800	
沖縄電力	4,100	1,416.00	5,805,600	
電源開発	16,700	1,626.00	27,154,200	
エフオン	1,300	1,151.00	1,496,300	
イーレックス	3,100	3,115.00	9,656,500	
レノバ	3,600	5,020.00	18,072,000	
東京瓦斯	40,400	2,040.50	82,436,200	
大阪瓦斯	38,100	2,035.00	77,533,500	
東邦瓦斯	10,300	5,440.00	56,032,000	
北海道瓦斯	1,100	1,586.00	1,744,600	
広島ガス	4,300	374.00	1,608,200	
西部ガスホールディングス	2,400	2,426.00	5,822,400	
静岡ガス	6,000	1,099.00	6,594,000	
メタウォーター	2,400	2,039.00	4,893,600	
ＳＢＳホールディングス	1,600	3,375.00	5,400,000	
東武鉄道	21,900	2,840.00	62,196,000	
相鉄ホールディングス	7,200	2,205.00	15,876,000	
東急	53,000	1,503.00	79,659,000	
京浜急行電鉄	27,000	1,330.00	35,910,000	
小田急電鉄	33,700	2,726.00	91,866,200	
京王電鉄	11,700	6,330.00	74,061,000	
京成電鉄	15,800	3,375.00	53,325,000	
富士急行	2,900	5,000.00	14,500,000	
新京成電鉄	500	2,120.00	1,060,000	
東日本旅客鉄道	37,000	7,515.00	278,055,000	
西日本旅客鉄道	18,700	6,099.00	114,051,300	
東海旅客鉄道	17,500	16,155.00	282,712,500	
西武ホールディングス	25,300	1,249.00	31,599,700	
鴻池運輸	3,300	1,263.00	4,167,900	
西日本鉄道	5,800	2,683.00	15,561,400	
ハマキョウレックス	1,600	3,215.00	5,144,000	

サカイ引越センター	1,000	5,820.00	5,820,000	
近鉄グループホールディングス	19,900	3,780.00	75,222,000	
阪急阪神ホールディングス	26,600	3,370.00	89,642,000	
南海電気鉄道	9,400	2,351.00	22,099,400	
京阪ホールディングス	8,900	3,165.00	28,168,500	
神戸電鉄	500	3,485.00	1,742,500	
名古屋鉄道	16,400	1,932.00	31,684,800	
山陽電気鉄道	1,400	1,940.00	2,716,000	
アルプス物流	1,400	945.00	1,323,000	
日本通運	6,900	8,200.00	56,580,000	
ヤマトホールディングス	27,900	3,285.00	91,651,500	
山九	5,100	4,970.00	25,347,000	
丸運	1,100	274.00	301,400	
丸全昭和運輸	1,600	3,425.00	5,480,000	
センコーグループホールディングス	11,000	1,110.00	12,210,000	
トナミホールディングス	500	4,905.00	2,452,500	
ニッコンホールディングス	6,700	2,410.00	16,147,000	
日本石油輸送	200	2,595.00	519,000	
福山通運	2,500	4,155.00	10,387,500	
セイノーホールディングス	14,900	1,416.00	21,098,400	
エスライン	500	903.00	451,500	
神奈川中央交通	500	3,390.00	1,695,000	
日立物流	4,400	4,395.00	19,338,000	
丸和運輸機関	4,200	1,549.00	6,505,800	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	2,000	1,649.00	3,298,000	
九州旅客鉄道	15,400	2,503.00	38,546,200	
ＳＧホールディングス	37,600	3,025.00	113,740,000	
日本郵船	16,600	5,520.00	91,632,000	
商船三井	11,800	5,000.00	59,000,000	
川崎汽船	6,100	3,580.00	21,838,000	
ＮＳユナイテッド海運	900	2,336.00	2,102,400	
明治海運	2,100	477.00	1,001,700	
飯野海運	9,200	442.00	4,066,400	
共栄タンカー	300	853.00	255,900	
乾汽船	1,400	1,229.00	1,720,600	
日本航空	48,500	2,298.00	111,453,000	

ＡＮＡホールディングス	53,700	2,574.00	138,223,800	
パスコ	400	1,532.00	612,800	
トランコム	600	8,580.00	5,148,000	
日新	1,600	1,509.00	2,414,400	
三菱倉庫	6,900	3,290.00	22,701,000	
三井倉庫ホールディングス	2,100	2,599.00	5,457,900	
住友倉庫	7,000	1,608.00	11,256,000	
澁澤倉庫	1,100	2,089.00	2,297,900	
東陽倉庫	3,300	315.00	1,039,500	
日本トランスシティ	4,400	573.00	2,521,200	
ケイヒン	400	1,372.00	548,800	
中央倉庫	1,200	999.00	1,198,800	
川西倉庫	400	1,124.00	449,600	
安田倉庫	1,600	961.00	1,537,600	
ファイズホールディングス	400	825.00	330,000	
東洋埠頭	600	1,425.00	855,000	
宇徳	1,400	515.00	721,000	
上組	11,000	2,340.00	25,740,000	
サンリツ	500	775.00	387,500	
キムラユニティー	500	1,303.00	651,500	
キユーソー流通システム	500	1,725.00	862,500	
近鉄エクスプレス	3,800	2,644.00	10,047,200	
東海運	1,100	306.00	336,600	
エーアイテイー	1,200	1,113.00	1,335,600	
内外トランスライン	700	1,928.00	1,349,600	
日本コンセプト	600	2,081.00	1,248,600	
ＮＥＣネッツエスアイ	6,800	1,823.00	12,396,400	
クロスキャット	500	999.00	499,500	
システナ	7,400	2,200.00	16,280,000	
デジタルアーツ	1,200	7,890.00	9,468,000	
日鉄ソリューションズ	3,000	3,570.00	10,710,000	
キューブシステム	1,000	1,016.00	1,016,000	
ＷＯＷ　ＷＯＲＬＤ	300	2,042.00	612,600	
コア	900	1,455.00	1,309,500	
ラクーンホールディングス	1,500	2,457.00	3,685,500	
ソリトンシステムズ	1,000	1,581.00	1,581,000	

ソフトクリエイトホールディングス	800	2,930.00	2,344,000	
ＴＩＳ	20,600	2,886.00	59,451,600	
ＪＮＳホールディングス	1,000	603.00	603,000	
グリー	12,600	616.00	7,761,600	
GMOペパボ	200	4,505.00	901,000	
コーエーテクモホールディングス	5,500	5,030.00	27,665,000	
三菱総合研究所	900	4,090.00	3,681,000	
ボルテージ	600	470.00	282,000	
電算	200	2,307.00	461,400	
ＡＧＳ	1,000	887.00	887,000	
ファインデックス	1,700	1,110.00	1,887,000	
ブレインパッド	500	4,440.00	2,220,000	
ＫＬａｂ	3,800	664.00	2,523,200	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,700	1,056.00	2,851,200	
イーブックイニシアティブジャパン	300	3,365.00	1,009,500	
ネクソン	52,200	2,312.00	120,686,400	
アイスタイル	6,300	478.00	3,011,400	
エムアップホールディングス	500	3,390.00	1,695,000	
エイチーム	1,400	1,513.00	2,118,200	
エニグモ	1,900	1,450.00	2,755,000	
テクノスジャパン	1,600	608.00	972,800	
ｅｎｉｓｈ	1,100	564.00	620,400	
コロプラ	6,800	809.00	5,501,200	
オルトプラス	1,600	413.00	660,800	
ブロードリーフ	10,200	510.00	5,202,000	
クロス・マーケティンググループ	900	612.00	550,800	
デジタルハーツホールディングス	900	1,553.00	1,397,700	
システム情報	1,500	924.00	1,386,000	
メディアドゥ	800	4,670.00	3,736,000	
じげん	5,100	444.00	2,264,400	
ブイキューブ	1,100	2,499.00	2,748,900	
エンカレッジ・テクノロジ	400	638.00	255,200	
サイバーリンクス	700	1,509.00	1,056,300	
ディー・エル・イー	1,700	391.00	664,700	
フィックスターズ	2,200	803.00	1,766,600	

ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	800	1,898.00	1,518,400	
オプティム	1,400	2,111.00	2,955,400	
セレス	700	3,360.00	2,352,000	
ＳＨＩＦＴ	1,000	20,240.00	20,240,000	
ティーガイア	2,200	2,012.00	4,426,400	
セック	300	2,660.00	798,000	
日本アジアグループ	2,000	967.00	1,934,000	
テクマトリックス	3,200	1,848.00	5,913,600	
プロシップ	600	1,392.00	835,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,000	2,084.00	10,420,000	
GMOペイメントゲートウェイ	4,000	14,420.00	57,680,000	
ザッパラス	800	530.00	424,000	
システムリサーチ	600	2,200.00	1,320,000	
インターネットイニシアティブ	5,500	3,585.00	19,717,500	
さくらインターネット	2,200	609.00	1,339,800	
ヴィンクス	600	963.00	577,800	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	500	4,470.00	2,235,000	
ＳＲＡホールディングス	1,100	2,677.00	2,944,700	
システムインテグレータ	600	637.00	382,200	
朝日ネット	1,700	691.00	1,174,700	
ｅＢＡＳＥ	2,500	828.00	2,070,000	
アバント	2,200	1,651.00	3,632,200	
アドソル日進	700	2,115.00	1,480,500	
ＯＤＫソリューションズ	400	765.00	306,000	
フリービット	1,200	772.00	926,400	
コムチュア	1,900	2,335.00	4,436,500	
サイバーコム	400	1,368.00	547,200	
アステリア	1,500	824.00	1,236,000	
アイル	1,100	1,435.00	1,578,500	
マークラインズ	900	2,941.00	2,646,900	
メディカル・データ・ビジョン	2,400	2,085.00	5,004,000	
ｇｕｍｉ	2,900	797.00	2,311,300	
ショーケース	400	710.00	284,000	
モバイルファクトリー	500	1,124.00	562,000	
テラスカイ	700	2,104.00	1,472,800	

デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	1,897.00	1,707,300	
ＰＣＩホールディングス	900	1,109.00	998,100	
パイプドHD	400	2,300.00	920,000	
アイビーシー	300	960.00	288,000	
ネオジャパン	400	1,418.00	567,200	
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	400	3,255.00	1,302,000	
ラクス	6,200	3,320.00	20,584,000	
ランドコンピュータ	300	1,100.00	330,000	
ダブルスタンダード	300	5,260.00	1,578,000	
オープンドア	1,200	2,134.00	2,560,800	
マイネット	700	682.00	477,400	
アカツキ	800	3,405.00	2,724,000	
ベネフィットジャパン	200	2,027.00	405,400	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	500	3,420.00	1,710,000	
カナミックネットワーク	2,200	626.00	1,377,200	
ノムラシステムコーポレーション	900	304.00	273,600	
チェンジ	3,800	2,697.00	10,248,600	
シンクロ・フード	1,200	361.00	433,200	
オークネット	1,100	1,691.00	1,860,100	
キャピタル・アセット・プランニング	400	1,040.00	416,000	
セグエグループ	500	1,074.00	537,000	
エイトレッド	400	2,319.00	927,600	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,900	898.00	1,706,200	
マクロミル	4,200	797.00	3,347,400	
ビーグリー	400	1,576.00	630,400	
オロ	700	3,820.00	2,674,000	
ユーザーローカル	600	1,916.00	1,149,600	
テモナ	400	1,066.00	426,400	
ニーズウェル	400	630.00	252,000	
サインポスト	500	707.00	353,500	
電算システムホールディングス	800	3,030.00	2,424,000	
ソルクシーズ	800	959.00	767,200	
フェイス	600	693.00	415,800	
プロトコーポレーション	2,500	1,395.00	3,487,500	
ハイマックス	600	1,100.00	660,000	

野村総合研究所	35,800	3,580.00	128,164,000	
サイバネットシステム	1,500	694.00	1,041,000	
ＣＥホールディングス	1,100	594.00	653,400	
日本システム技術	400	1,608.00	643,200	
インテージホールディングス	2,600	1,560.00	4,056,000	
東邦システムサイエンス	500	944.00	472,000	
ソースネクスト	9,800	304.00	2,979,200	
インフォコム	1,900	2,921.00	5,549,900	
ＨＥＲＯＺ	600	2,094.00	1,256,400	
ラクスル	2,200	5,560.00	12,232,000	
ＩＰＳ	500	2,803.00	1,401,500	
ＦＩＧ	2,200	277.00	609,400	
システムサポート	600	1,307.00	784,200	
イーソル	1,100	1,084.00	1,192,400	
アルテリア・ネットワークス	2,300	1,808.00	4,158,400	
ＥｄｕＬａｂ	200	5,000.00	1,000,000	
東海ソフト	300	1,373.00	411,900	
ウイングアーク１ｓｔ	1,100	2,048.00	2,252,800	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	500	2,115.00	1,057,500	
サーバーワークス	200	4,130.00	826,000	
東名	200	1,171.00	234,200	
ヴィッツ	200	1,803.00	360,600	
トビラシステムズ	300	1,293.00	387,900	
Ｓａｎｓａｎ	1,800	8,970.00	16,146,000	
Ｌｉｎｋ－Ｕ	400	1,547.00	618,800	
ギフティ	1,200	3,545.00	4,254,000	
ベース	200	4,925.00	985,000	
フォーカスシステムズ	1,400	1,009.00	1,412,600	
クレスコ	1,400	1,992.00	2,788,800	
フジ・メディア・ホールディングス	21,400	1,228.00	26,279,200	
オービック	6,500	19,520.00	126,880,000	
ジャストシステム	2,900	6,380.00	18,502,000	
ＴＤＣソフト	1,800	1,116.00	2,008,800	
Ｚホールディングス	283,400	581.10	164,683,740	
トレンドマイクロ	11,000	5,900.00	64,900,000	

ＩＤホールディングス	1,200	960.00	1,152,000	
日本オラクル	4,200	8,250.00	34,650,000	
アルファシステムズ	600	3,845.00	2,307,000	
フューチャー	2,500	1,894.00	4,735,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	1,300	1,418.00	1,843,400	
ＳＢテクノロジー	700	3,050.00	2,135,000	
トーセ	600	799.00	479,400	
オービックビジネスコンサルタント	2,000	6,030.00	12,060,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	9,400	3,420.00	32,148,000	
アイティフォー	2,700	759.00	2,049,300	
東計電算	300	4,430.00	1,329,000	
エックスネット	300	1,041.00	312,300	
大塚商会	11,200	5,900.00	66,080,000	
サイボウズ	2,400	2,486.00	5,966,400	
電通国際情報サービス	2,600	4,675.00	12,155,000	
ＡＣＣＥＳＳ	2,600	874.00	2,272,400	
デジタルガレージ	3,400	4,780.00	16,252,000	
ＥＭシステムズ	3,400	851.00	2,893,400	
ウェザーニューズ	600	5,640.00	3,384,000	
ＣＩＪ	1,300	851.00	1,106,300	
ビジネスエンジニアリング	200	3,215.00	643,000	
日本エンタープライズ	2,000	206.00	412,000	
ＷＯＷＯＷ	1,000	2,466.00	2,466,000	
スカラ	1,800	748.00	1,346,400	
インテリジェント　ウェイブ	1,200	586.00	703,200	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	1,800	445.00	801,000	
ネットワンシステムズ	8,400	3,785.00	31,794,000	
システムソフト	4,200	274.00	1,150,800	
アルゴグラフィックス	1,600	3,395.00	5,432,000	
マーベラス	3,200	761.00	2,435,200	
エイベックス	3,600	1,679.00	6,044,400	
日本ユニシス	7,200	3,420.00	24,624,000	
兼松エレクトロニクス	1,100	3,665.00	4,031,500	
都築電気	900	1,606.00	1,445,400	
ＴＢＳホールディングス	13,700	1,692.00	23,180,400	
日本テレビホールディングス	17,200	1,254.00	21,568,800	

朝日放送グループホールディングス	2,000	709.00	1,418,000	
テレビ朝日ホールディングス	6,400	1,723.00	11,027,200	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	13,600	422.00	5,739,200	
テレビ東京ホールディングス	1,500	2,098.00	3,147,000	
日本ＢＳ放送	700	1,106.00	774,200	
ビジョン	2,600	1,102.00	2,865,200	
スマートバリュー	500	683.00	341,500	
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	2,000	2,412.00	4,824,000	
ワイヤレスゲート	800	422.00	337,600	
コネクシオ	1,200	1,578.00	1,893,600	
日本通信	18,200	213.00	3,876,600	
クロップス	400	889.00	355,600	
日本電信電話	241,300	2,825.50	681,793,150	
ＫＤＤＩ	165,400	3,469.00	573,772,600	
ソフトバンク	187,500	1,467.50	275,156,250	
光通信	2,400	20,220.00	48,528,000	
エムティーアイ	2,000	715.00	1,430,000	
GMOインターネット	7,300	2,936.00	21,432,800	
ファイバーゲート	700	1,413.00	989,100	
アイドママーケティングコミュニケーション	500	380.00	190,000	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	5,300	4,395.00	23,293,500	
学研ホールディングス	2,900	1,303.00	3,778,700	
ゼンリン	3,700	1,115.00	4,125,500	
昭文社ホールディングス	800	494.00	395,200	
インプレスホールディングス	1,700	261.00	443,700	
アイネット	1,100	1,425.00	1,567,500	
松竹	1,400	12,050.00	16,870,000	
東宝	12,200	4,900.00	59,780,000	
東映	700	19,910.00	13,937,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	54,900	1,744.00	95,745,600	
ピー・シー・エー	300	3,995.00	1,198,500	
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,744.00	1,220,800	
ＤＴＳ	4,300	2,741.00	11,786,300	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,800	5,750.00	50,600,000	
シーイーシー	2,200	1,637.00	3,601,400	
カプコン	17,700	3,065.00	54,250,500	

アイ・エス・ビー	1,000	1,476.00	1,476,000	
ジャステック	1,300	1,204.00	1,565,200	
ＳＣＳＫ	4,800	6,830.00	32,784,000	
日本システムウエア	700	2,415.00	1,690,500	
アイネス	2,000	1,382.00	2,764,000	
ＴＫＣ	3,500	3,245.00	11,357,500	
富士ソフト	2,200	5,520.00	12,144,000	
ＮＳＤ	6,600	1,880.00	12,408,000	
コナミホールディングス	7,500	6,200.00	46,500,000	
福井コンピュータホールディングス	900	4,060.00	3,654,000	
ＪＢＣＣホールディングス	1,400	1,466.00	2,052,400	
ミロク情報サービス	2,000	1,637.00	3,274,000	
ソフトバンクグループ	163,700	7,106.00	1,163,252,200	
ホウスイ	200	981.00	196,200	
高千穂交易	800	1,159.00	927,200	
オルバヘルスケアホールディングス	300	1,649.00	494,700	
伊藤忠食品	500	5,290.00	2,645,000	
エレマテック	1,700	1,260.00	2,142,000	
ＪＡＬＵＸ	600	1,724.00	1,034,400	
あらた	1,600	4,275.00	6,840,000	
トーメンデバイス	300	4,215.00	1,264,500	
東京エレクトロン　デバイス	700	5,320.00	3,724,000	
フィールズ	1,800	522.00	939,600	
双日	114,400	338.00	38,667,200	
アルフレッサ　ホールディングス	21,500	1,718.00	36,937,000	
横浜冷凍	5,800	897.00	5,202,600	
神栄	300	1,193.00	357,900	
ラサ商事	1,100	899.00	988,900	
アルコニックス	2,200	1,463.00	3,218,600	
神戸物産	14,300	3,970.00	56,771,000	
ハイパー	400	549.00	219,600	
あい　ホールディングス	3,000	2,092.00	6,276,000	
ディーブイエックス	600	1,012.00	607,200	
ダイワボウホールディングス	9,400	2,220.00	20,868,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	4,900	2,727.00	13,362,300	
ラクト・ジャパン	900	2,676.00	2,408,400	

グリムス	600	2,077.00	1,246,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,600	762.00	2,743,200	
八洲電機	1,600	963.00	1,540,800	
メディアスホールディングス	1,200	996.00	1,195,200	
レスターホールディングス	2,200	1,919.00	4,221,800	
ジューテックホールディングス	500	1,049.00	524,500	
大光	800	674.00	539,200	
ＯＣＨＩホールディングス	600	1,294.00	776,400	
ＴＯＫＡＩホールディングス	10,000	910.00	9,100,000	
黒谷	600	826.00	495,600	
Ｃｏｍｉｎｉｘ	400	730.00	292,000	
三洋貿易	2,100	1,219.00	2,559,900	
ビューティガレージ	300	4,265.00	1,279,500	
ウイン・パートナーズ	1,500	998.00	1,497,000	
ミタチ産業	600	822.00	493,200	
シップヘルスケアホールディングス	7,300	2,803.00	20,461,900	
明治電機工業	700	1,427.00	998,900	
デリカフーズホールディングス	800	656.00	524,800	
スターティアホールディングス	400	2,046.00	818,400	
コメダホールディングス	4,500	2,025.00	9,112,500	
ピーバンドットコム	300	768.00	230,400	
アセンテック	500	1,185.00	592,500	
富士興産	600	1,049.00	629,400	
協栄産業	200	1,418.00	283,600	
小野建	1,900	1,335.00	2,536,500	
南陽	400	1,974.00	789,600	
佐鳥電機	1,300	860.00	1,118,000	
エコートレーディング	400	669.00	267,600	
伯東	1,300	1,540.00	2,002,000	
コンドーテック	1,600	1,008.00	1,612,800	
中山福	1,200	447.00	536,400	
ナガイレーベン	2,700	2,605.00	7,033,500	
三菱食品	2,300	2,848.00	6,550,400	
松田産業	1,500	2,143.00	3,214,500	
第一興商	3,900	4,135.00	16,126,500	
メディパルホールディングス	20,700	2,152.00	44,546,400	

ＳＰＫ	900	1,397.00	1,257,300	
萩原電気ホールディングス	800	2,283.00	1,826,400	
アズワン	1,500	15,520.00	23,280,000	
スズデン	700	1,482.00	1,037,400	
尾家産業	600	1,201.00	720,600	
シモジマ	1,300	1,091.00	1,418,300	
ドウシシャ	2,000	1,712.00	3,424,000	
小津産業	500	1,909.00	954,500	
高速	1,100	1,477.00	1,624,700	
たけびし	700	1,546.00	1,082,200	
リックス	500	1,535.00	767,500	
丸文	1,800	683.00	1,229,400	
ハピネット	1,700	1,466.00	2,492,200	
橋本総業ホールディングス	400	2,928.00	1,171,200	
日本ライフライン	6,700	1,395.00	9,346,500	
タカショー	1,300	886.00	1,151,800	
マルカ	700	2,573.00	1,801,100	
ＩＤＯＭ	7,000	946.00	6,622,000	
進和	1,200	2,258.00	2,709,600	
エスケイジャパン	500	480.00	240,000	
ダイトロン	900	1,980.00	1,782,000	
シークス	2,600	1,427.00	3,710,200	
田中商事	600	661.00	396,600	
オーハシテクニカ	1,100	1,563.00	1,719,300	
白銅	700	2,210.00	1,547,000	
ダイコー通産	200	1,240.00	248,000	
伊藤忠商事	144,800	3,273.00	473,930,400	
丸紅	204,200	955.60	195,133,520	
高島	300	1,777.00	533,100	
長瀬産業	11,400	1,719.00	19,596,600	
蝶理	1,300	1,876.00	2,438,800	
豊田通商	20,800	5,250.00	109,200,000	
三共生興	3,100	558.00	1,729,800	
兼松	8,300	1,508.00	12,516,400	
ツカモトコーポレーション	300	1,449.00	434,700	
三井物産	165,200	2,554.00	421,920,800	

日本紙パルプ商事	1,100	3,655.00	4,020,500	
カメイ	2,700	1,163.00	3,140,100	
東都水産	200	5,170.00	1,034,000	
ＯＵＧホールディングス	300	2,911.00	873,300	
スターゼン	1,500	2,225.00	3,337,500	
山善	8,100	1,044.00	8,456,400	
椿本興業	400	3,600.00	1,440,000	
住友商事	130,700	1,486.00	194,220,200	
内田洋行	900	4,885.00	4,396,500	
三菱商事	126,100	3,104.00	391,414,400	
第一実業	900	4,560.00	4,104,000	
キヤノンマーケティングジャパン	5,100	2,573.00	13,122,300	
西華産業	1,100	1,664.00	1,830,400	
佐藤商事	1,700	1,146.00	1,948,200	
菱洋エレクトロ	1,600	2,484.00	3,974,400	
東京産業	1,900	672.00	1,276,800	
ユアサ商事	2,100	3,150.00	6,615,000	
神鋼商事	500	2,340.00	1,170,000	
トルク	1,200	235.00	282,000	
阪和興業	4,100	3,130.00	12,833,000	
正栄食品工業	1,300	3,950.00	5,135,000	
カナデン	1,700	1,066.00	1,812,200	
菱電商事	1,500	1,651.00	2,476,500	
フルサト工業	1,000	1,995.00	1,995,000	
岩谷産業	5,000	6,390.00	31,950,000	
ナイス	800	2,031.00	1,624,800	
ニチモウ	300	2,087.00	626,100	
極東貿易	600	2,689.00	1,613,400	
アステナホールディングス	3,000	567.00	1,701,000	
三愛石油	5,100	1,364.00	6,956,400	
稲畑産業	5,000	1,707.00	8,535,000	
ＧＳＩクレオス	1,000	973.00	973,000	
明和産業	1,900	477.00	906,300	
クワザワホールディングス	700	613.00	429,100	
ヤマエ久野	1,500	1,104.00	1,656,000	
ワキタ	4,100	1,036.00	4,247,600	

東邦ホールディングス	6,600	1,916.00	12,645,600	
サンゲツ	5,600	1,631.00	9,133,600	
ミツウロコグループホールディングス	3,100	1,285.00	3,983,500	
シナネンホールディングス	800	3,280.00	2,624,000	
伊藤忠エネクス	4,600	1,020.00	4,692,000	
サンリオ	5,800	1,907.00	11,060,600	
サンワテクノス	1,400	1,317.00	1,843,800	
リョーサン	2,300	2,156.00	4,958,800	
新光商事	2,800	784.00	2,195,200	
トーホー	900	1,576.00	1,418,400	
三信電気	1,100	2,129.00	2,341,900	
東陽テクニカ	2,000	1,189.00	2,378,000	
モスフードサービス	2,900	3,140.00	9,106,000	
加賀電子	1,900	2,922.00	5,551,800	
ソーダニッカ	2,000	536.00	1,072,000	
立花エレテック	1,500	1,451.00	2,176,500	
フォーバル	700	952.00	666,400	
ＰＡＬＴＡＣ	3,300	5,150.00	16,995,000	
三谷産業	2,700	388.00	1,047,600	
太平洋興発	800	629.00	503,200	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	500	2,693.00	1,346,500	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,759.00	351,800	
コーア商事ホールディングス	1,600	653.00	1,044,800	
国際紙パルプ商事	4,400	262.00	1,152,800	
ヤマタネ	900	1,566.00	1,409,400	
丸紅建材リース	200	1,916.00	383,200	
日鉄物産	1,500	4,600.00	6,900,000	
泉州電業	600	3,865.00	2,319,000	
トラスコ中山	4,700	2,911.00	13,681,700	
オートバックスセブン	7,500	1,571.00	11,782,500	
モリト	1,500	677.00	1,015,500	
加藤産業	3,000	3,375.00	10,125,000	
北恵	500	990.00	495,000	
イノテック	1,200	1,336.00	1,603,200	
イエローハット	3,900	2,115.00	8,248,500	
ＪＫホールディングス	1,900	809.00	1,537,100	

日伝	1,700	2,239.00	3,806,300	
北沢産業	1,400	250.00	350,000	
杉本商事	1,000	2,325.00	2,325,000	
因幡電機産業	5,500	2,694.00	14,817,000	
東テク	700	2,654.00	1,857,800	
ミスミグループ本社	26,000	3,920.00	101,920,000	
アルテック	1,500	320.00	480,000	
タキヒヨー	700	1,903.00	1,332,100	
蔵王産業	400	1,573.00	629,200	
スズケン	8,800	3,315.00	29,172,000	
ジェコス	1,400	900.00	1,260,000	
グローセル	2,200	451.00	992,200	
ローソン	5,200	5,620.00	29,224,000	
サンエー	1,600	4,145.00	6,632,000	
カワチ薬品	1,400	2,246.00	3,144,400	
エービーシー・マート	3,200	6,020.00	19,264,000	
ハードオフコーポレーション	900	766.00	689,400	
アスクル	3,300	1,690.00	5,577,000	
ゲオホールディングス	2,800	1,216.00	3,404,800	
アダストリア	2,900	1,913.00	5,547,700	
ジーフット	1,300	420.00	546,000	
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	300	415.00	124,500	
くら寿司	2,400	3,960.00	9,504,000	
キャンドゥ	1,000	1,885.00	1,885,000	
アイケイ	600	645.00	387,000	
パルグループホールディングス	1,800	1,799.00	3,238,200	
エディオン	8,800	1,115.00	9,812,000	
サーラコーポレーション	4,200	607.00	2,549,400	
ワッツ	1,000	942.00	942,000	
ハローズ	800	2,883.00	2,306,400	
フジオフードグループ本社	1,700	1,301.00	2,211,700	
あみやき亭	400	2,899.00	1,159,600	
ひらまつ	3,700	188.00	695,600	
大黒天物産	700	6,340.00	4,438,000	
ハニーズホールディングス	1,600	1,184.00	1,894,400	
ファーマライズホールディングス	500	748.00	374,000	

アルペン	1,600	3,140.00	5,024,000	
ハブ	700	695.00	486,500	
クオールホールディングス	2,800	1,525.00	4,270,000	
ジンズホールディングス	1,400	7,220.00	10,108,000	
ビックカメラ	12,300	1,130.00	13,899,000	
ＤＣＭホールディングス	12,800	1,107.00	14,169,600	
ペッパーフードサービス	3,100	411.00	1,274,100	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	29,400	2,613.00	76,822,200	
東京一番フーズ	500	595.00	297,500	
ＤＤホールディングス	1,000	495.00	495,000	
きちりホールディングス	600	601.00	360,600	
アークランドサービスホールディングス	1,700	2,188.00	3,719,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	24,700	933.00	23,045,100	
ドトール・日レスホールディングス	3,300	1,664.00	5,491,200	
マツモトキヨシホールディングス	8,600	5,030.00	43,258,000	
ブロンコビリー	1,100	2,376.00	2,613,600	
ＺＯＺＯ	12,200	3,470.00	42,334,000	
トレジャー・ファクトリー	600	1,002.00	601,200	
物語コーポレーション	1,100	7,040.00	7,744,000	
ココカラファイン	1,800	8,520.00	15,336,000	
三越伊勢丹ホールディングス	36,200	773.00	27,982,600	
Ｈａｍｅｅ	500	1,547.00	773,500	
マーケットエンタープライズ	100	1,101.00	110,100	
ウエルシアホールディングス	10,900	3,690.00	40,221,000	
クリエイトＳＤホールディングス	3,100	3,690.00	11,439,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	2,400	395.00	948,000	
ミサワ	400	673.00	269,200	
ティーライフ	300	1,449.00	434,700	
エー・ピーホールディングス	400	480.00	192,000	
チムニー	600	1,419.00	851,400	
シュッピン	1,400	1,097.00	1,535,800	
オイシックス・ラ・大地	2,700	4,265.00	11,515,500	
ネクステージ	3,700	2,243.00	8,299,100	
ジョイフル本田	6,100	1,403.00	8,558,300	
鳥貴族ホールディングス	800	1,754.00	1,403,200	
ホットランド	1,500	1,305.00	1,957,500	

すかいらーくホールディングス	26,400	1,458.00	38,491,200	
ＳＦＰホールディングス	1,000	1,432.00	1,432,000	
綿半ホールディングス	1,600	1,269.00	2,030,400	
ヨシックスホールディングス	400	2,265.00	906,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	6,000	1,070.00	6,420,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,100	1,643.00	1,807,300	
ＢＥＥＮＯＳ	1,000	3,360.00	3,360,000	
あさひ	1,500	1,354.00	2,031,000	
日本調剤	1,300	1,705.00	2,216,500	
コスモス薬品	2,100	18,440.00	38,724,000	
トーエル	1,000	826.00	826,000	
オンリー	400	476.00	190,400	
セブン&アイ・ホールディングス	81,000	5,010.00	405,810,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	11,100	895.00	9,934,500	
ツルハホールディングス	4,500	13,010.00	58,545,000	
サンマルクホールディングス	1,600	1,576.00	2,521,600	
フェリシモ	500	1,515.00	757,500	
トリドールホールディングス	5,100	1,887.00	9,623,700	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	1,900	688.00	1,307,200	
ウイルプラスホールディングス	300	1,133.00	339,900	
ＪＭホールディングス	1,400	2,112.00	2,956,800	
サツドラホールディングス	300	2,028.00	608,400	
アレンザホールディングス	1,600	1,301.00	2,081,600	
串カツ田中ホールディングス	500	1,799.00	899,500	
バロックジャパンリミテッド	1,400	840.00	1,176,000	
クスリのアオキホールディングス	2,100	7,480.00	15,708,000	
力の源ホールディングス	900	608.00	547,200	
ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥＳ	12,100	4,290.00	51,909,000	
メディカルシステムネットワーク	1,800	749.00	1,348,200	
はるやまホールディングス	1,000	633.00	633,000	
ノジマ	3,700	2,866.00	10,604,200	
カッパ・クリエイト	2,900	1,411.00	4,091,900	
ライトオン	1,500	745.00	1,117,500	
良品計画	23,800	2,179.00	51,860,200	

三城ホールディングス	2,500	273.00	682,500	
アドヴァングループ	2,100	915.00	1,921,500	
アルビス	700	2,378.00	1,664,600	
コナカ	2,400	349.00	837,600	
ハウス　オブ　ローゼ	300	1,643.00	492,900	
Ｇ－７ホールディングス	1,000	3,655.00	3,655,000	
イオン北海道	2,700	1,020.00	2,754,000	
コジマ	3,600	687.00	2,473,200	
ヒマラヤ	700	1,133.00	793,100	
コーナン商事	2,900	4,560.00	13,224,000	
エコス	800	1,917.00	1,533,600	
ワタミ	2,700	921.00	2,486,700	
マルシェ	500	492.00	246,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	41,400	2,396.00	99,194,400	
西松屋チェーン	4,500	1,389.00	6,250,500	
ゼンショーホールディングス	11,100	2,734.00	30,347,400	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,441.00	1,873,300	
ハークスレイ	400	1,001.00	400,400	
サイゼリヤ	3,100	2,552.00	7,911,200	
ＶＴホールディングス	7,800	492.00	3,837,600	
魚力	600	2,116.00	1,269,600	
ポプラ	500	261.00	130,500	
フジ・コーポレーション	1,100	1,240.00	1,364,000	
ユナイテッドアローズ	2,400	1,983.00	4,759,200	
ハイデイ日高	3,000	1,768.00	5,304,000	
京都きもの友禅	1,300	258.00	335,400	
コロワイド	6,900	1,960.00	13,524,000	
ピーシーデポコーポレーション	2,400	481.00	1,154,400	
壱番屋	1,500	4,850.00	7,275,000	
トップカルチャー	700	346.00	242,200	
ＰＬＡＮＴ	500	743.00	371,500	
スギホールディングス	4,100	8,240.00	33,784,000	
薬王堂ホールディングス	900	2,301.00	2,070,900	
ヴィア・ホールディングス	2,500	186.00	465,000	
スクロール	3,000	859.00	2,577,000	

ヨンドシーホールディングス	1,900	1,821.00	3,459,900	
木曽路	2,700	2,349.00	6,342,300	
ＳＲＳホールディングス	2,700	807.00	2,178,900	
千趣会	3,700	370.00	1,369,000	
タカキュー	1,600	132.00	211,200	
リテールパートナーズ	2,500	1,170.00	2,925,000	
ケーヨー	3,800	837.00	3,180,600	
上新電機	2,400	2,747.00	6,592,800	
日本瓦斯	10,100	1,953.00	19,725,300	
ロイヤルホールディングス	3,600	1,929.00	6,944,400	
東天紅	200	1,128.00	225,600	
いなげや	2,300	1,497.00	3,443,100	
チヨダ	2,000	880.00	1,760,000	
ライフコーポレーション	1,900	3,680.00	6,992,000	
リンガーハット	2,600	2,233.00	5,805,800	
ＭｒＭａｘＨＤ	2,800	674.00	1,887,200	
テンアライド	1,900	337.00	640,300	
ＡＯＫＩホールディングス	4,000	667.00	2,668,000	
オークワ	3,200	1,111.00	3,555,200	
コメリ	3,200	2,708.00	8,665,600	
青山商事	4,600	712.00	3,275,200	
しまむら	2,400	10,520.00	25,248,000	
はせがわ	1,100	277.00	304,700	
高島屋	15,100	1,169.00	17,651,900	
松屋	4,500	943.00	4,243,500	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	9,800	871.00	8,535,800	
近鉄百貨店	800	3,140.00	2,512,000	
丸井グループ	17,500	1,974.00	34,545,000	
アクシアル　リテイリング	1,700	3,850.00	6,545,000	
井筒屋	1,000	231.00	231,000	
イオン	79,700	2,986.50	238,024,050	
イズミ	4,200	3,870.00	16,254,000	
平和堂	3,800	2,129.00	8,090,200	
フジ	2,500	1,972.00	4,930,000	
ヤオコー	2,400	6,660.00	15,984,000	
ゼビオホールディングス	2,500	1,030.00	2,575,000	

ケーズホールディングス	17,600	1,274.00	22,422,400	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	1,100	773.00	850,300	
日産東京販売ホールディングス	3,000	252.00	756,000	
シルバーライフ	400	1,955.00	782,000	
一家ダイニングプロジェクト	400	579.00	231,600	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	900	4,260.00	3,834,000	
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,158.00	463,200	
ブックオフグループホールディングス	1,200	970.00	1,164,000	
ギフト	300	2,415.00	724,500	
アインホールディングス	3,000	6,650.00	19,950,000	
元気寿司	600	2,504.00	1,502,400	
ヤマダホールディングス	69,400	510.00	35,394,000	
アークランドサカモト	3,200	1,492.00	4,774,400	
ニトリホールディングス	8,200	20,320.00	166,624,000	
グルメ杵屋	1,500	944.00	1,416,000	
愛眼	1,600	228.00	364,800	
ケーユーホールディングス	1,100	1,027.00	1,129,700	
吉野家ホールディングス	6,800	2,045.00	13,906,000	
松屋フーズホールディングス	1,000	3,615.00	3,615,000	
サガミホールディングス	2,900	1,027.00	2,978,300	
関西スーパーマーケット	1,600	1,088.00	1,740,800	
王将フードサービス	1,400	5,800.00	8,120,000	
プレナス	2,300	2,154.00	4,954,200	
ミニストップ	1,500	1,422.00	2,133,000	
アークス	4,000	2,269.00	9,076,000	
バローホールディングス	4,200	2,334.00	9,802,800	
藤久	500	712.00	356,000	
ベルク	1,000	5,040.00	5,040,000	
大庄	1,100	1,006.00	1,106,600	
ファーストリテイリング	2,800	75,810.00	212,268,000	
サンドラッグ	7,800	3,660.00	28,548,000	
サックスバー　ホールディングス	1,800	617.00	1,110,600	
ヤマザワ	500	1,712.00	856,000	
やまや	400	2,327.00	930,800	
ベルーナ	4,400	918.00	4,039,200	
島根銀行	700	614.00	429,800	

じもとホールディングス	1,400	647.00	905,800	
めぶきフィナンシャルグループ	107,700	234.00	25,201,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,600	1,551.00	4,032,600	
九州フィナンシャルグループ	42,300	384.00	16,243,200	
ゆうちょ銀行	58,700	933.00	54,767,100	
富山第一銀行	4,900	273.00	1,337,700	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	126,300	392.00	49,509,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	13,500	624.00	8,424,000	
三十三フィナンシャルグループ	1,800	1,420.00	2,556,000	
第四北越フィナンシャルグループ	3,400	2,426.00	8,248,400	
ひろぎんホールディングス	30,600	587.00	17,962,200	
新生銀行	16,900	1,447.00	24,454,300	
あおぞら銀行	12,400	2,464.00	30,553,600	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,418,400	580.00	822,672,000	
りそなホールディングス	238,000	411.30	97,889,400	
三井住友トラスト・ホールディングス	39,200	3,512.00	137,670,400	
三井住友フィナンシャルグループ	143,500	3,693.00	529,945,500	
千葉銀行	69,200	633.00	43,803,600	
群馬銀行	42,700	347.00	14,816,900	
武蔵野銀行	3,100	1,646.00	5,102,600	
千葉興業銀行	5,300	255.00	1,351,500	
筑波銀行	8,600	169.00	1,453,400	
七十七銀行	6,500	1,142.00	7,423,000	
青森銀行	1,600	2,027.00	3,243,200	
秋田銀行	1,200	1,417.00	1,700,400	
山形銀行	2,300	848.00	1,950,400	
岩手銀行	1,400	1,677.00	2,347,800	
東邦銀行	18,500	209.00	3,866,500	
東北銀行	1,000	998.00	998,000	
みちのく銀行	1,300	924.00	1,201,200	
ふくおかフィナンシャルグループ	18,700	1,846.00	34,520,200	
静岡銀行	50,500	822.00	41,511,000	
十六銀行	2,600	1,929.00	5,015,400	
スルガ銀行	18,200	327.00	5,951,400	
八十二銀行	46,700	353.00	16,485,100	
山梨中央銀行	2,400	819.00	1,965,600	

大垣共立銀行	4,100	1,859.00	7,621,900	
福井銀行	1,800	1,401.00	2,521,800	
北國銀行	1,900	2,070.00	3,933,000	
清水銀行	900	1,559.00	1,403,100	
富山銀行	400	2,153.00	861,200	
滋賀銀行	4,200	1,872.00	7,862,400	
南都銀行	3,000	1,885.00	5,655,000	
百五銀行	18,600	308.00	5,728,800	
京都銀行	7,400	4,825.00	35,705,000	
紀陽銀行	7,300	1,503.00	10,971,900	
ほくほくフィナンシャルグループ	13,800	795.00	10,971,000	
山陰合同銀行	13,100	548.00	7,178,800	
中国銀行	17,800	851.00	15,147,800	
鳥取銀行	700	1,133.00	793,100	
伊予銀行	27,500	536.00	14,740,000	
百十四銀行	2,200	1,511.00	3,324,200	
四国銀行	2,900	714.00	2,070,600	
阿波銀行	3,200	1,997.00	6,390,400	
大分銀行	1,200	1,685.00	2,022,000	
宮崎銀行	1,300	1,990.00	2,587,000	
佐賀銀行	1,200	1,371.00	1,645,200	
沖縄銀行	1,900	2,469.00	4,691,100	
琉球銀行	4,500	721.00	3,244,500	
セブン銀行	69,300	235.00	16,285,500	
みずほフィナンシャルグループ	281,800	1,570.50	442,566,900	
高知銀行	800	805.00	644,000	
山口フィナンシャルグループ	25,900	620.00	16,058,000	
長野銀行	700	1,091.00	763,700	
名古屋銀行	1,700	2,437.00	4,142,900	
北洋銀行	31,300	237.00	7,418,100	
愛知銀行	700	2,821.00	1,974,700	
中京銀行	700	1,430.00	1,001,000	
大光銀行	700	1,265.00	885,500	
愛媛銀行	2,900	749.00	2,172,100	
トマト銀行	800	1,043.00	834,400	
京葉銀行	8,800	415.00	3,652,000	

栃木銀行	10,000	171.00	1,710,000	
北日本銀行	600	1,559.00	935,400	
東和銀行	3,600	499.00	1,796,400	
福島銀行	2,300	235.00	540,500	
大東銀行	1,000	613.00	613,000	
トモニホールディングス	16,000	297.00	4,752,000	
フィデアホールディングス	20,000	120.00	2,400,000	
池田泉州ホールディングス	23,800	159.00	3,784,200	
ＦＰＧ	7,000	754.00	5,278,000	
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,400	1,534.00	2,147,600	
マーキュリアホールディングス	800	741.00	592,800	
ＳＢＩホールディングス	25,600	2,596.00	66,457,600	
日本アジア投資	1,700	315.00	535,500	
ジャフコ　グループ	3,000	6,460.00	19,380,000	
大和証券グループ本社	155,300	572.70	88,940,310	
野村ホールディングス	316,600	549.60	174,003,360	
岡三証券グループ	17,700	414.00	7,327,800	
丸三証券	6,200	599.00	3,713,800	
東洋証券	6,800	157.00	1,067,600	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	22,100	393.00	8,685,300	
光世証券	500	584.00	292,000	
水戸証券	5,500	300.00	1,650,000	
いちよし証券	4,200	602.00	2,528,400	
松井証券	10,200	810.00	8,262,000	
マネックスグループ	18,600	683.00	12,703,800	
極東証券	2,800	790.00	2,212,000	
岩井コスモホールディングス	2,100	1,410.00	2,961,000	
藍澤證券	3,700	1,040.00	3,848,000	
マネーパートナーズグループ	2,200	221.00	486,200	
スパークス・グループ	9,500	258.00	2,451,000	
小林洋行	600	266.00	159,600	
かんぽ生命保険	25,700	1,962.00	50,423,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	36,600	4,511.00	165,102,600	
アニコム　ホールディングス	5,800	855.00	4,959,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	50,400	3,372.00	169,948,800	

第一生命ホールディングス	102,000	1,973.50	201,297,000	
東京海上ホールディングス	68,300	5,252.00	358,711,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	62,000	1,396.00	86,552,000	
アドバンスクリエイト	1,000	1,004.00	1,004,000	
全国保証	5,400	5,120.00	27,648,000	
あんしん保証	700	349.00	244,300	
ジェイリース	700	1,660.00	1,162,000	
イントラスト	600	667.00	400,200	
日本モーゲージサービス	1,100	1,015.00	1,116,500	
Ｃａｓａ	600	979.00	587,400	
アルヒ	3,100	1,411.00	4,374,100	
プレミアグループ	1,000	3,610.00	3,610,000	
クレディセゾン	12,100	1,328.00	16,068,800	
芙蓉総合リース	2,200	7,140.00	15,708,000	
みずほリース	3,200	3,625.00	11,600,000	
東京センチュリー	4,800	5,960.00	28,608,000	
日本証券金融	8,800	825.00	7,260,000	
アイフル	34,800	353.00	12,284,400	
リコーリース	1,600	3,460.00	5,536,000	
イオンフィナンシャルサービス	12,700	1,379.00	17,513,300	
アコム	41,700	470.00	19,599,000	
ジャックス	2,300	2,583.00	5,940,900	
オリエントコーポレーション	56,100	142.00	7,966,200	
オリックス	125,900	1,913.50	240,909,650	
三菱ＨＣキャピタル	71,700	605.00	43,378,500	
九州リースサービス	1,000	653.00	653,000	
日本取引所グループ	56,000	2,581.00	144,536,000	
イー・ギャランティ	2,400	2,427.00	5,824,800	
アサックス	1,100	689.00	757,900	
ＮＥＣキャピタルソリューション	800	2,170.00	1,736,000	
いちご	23,100	332.00	7,669,200	
日本駐車場開発	22,700	162.00	3,677,400	
スター・マイカ・ホールディングス	1,100	1,282.00	1,410,200	
ＳＲＥホールディングス	300	6,750.00	2,025,000	
ＡＤワークスグループ	4,100	157.00	643,700	
ヒューリック	44,000	1,259.00	55,396,000	

三栄建築設計	800	1,997.00	1,597,600	
野村不動産ホールディングス	11,900	2,748.00	32,701,200	
三重交通グループホールディングス	4,200	486.00	2,041,200	
サムティ	2,900	2,237.00	6,487,300	
ディア・ライフ	2,700	471.00	1,271,700	
コーセーアールイー	600	653.00	391,800	
日本商業開発	1,300	1,751.00	2,276,300	
プレサンスコーポレーション	3,400	1,562.00	5,310,800	
ＴＨＥグローバル社	1,300	217.00	282,100	
ハウスコム	400	1,217.00	486,800	
日本管理センター	1,100	1,304.00	1,434,400	
サンセイランディック	600	874.00	524,400	
エストラスト	200	674.00	134,800	
フージャースホールディングス	3,400	728.00	2,475,200	
オープンハウス	6,600	5,590.00	36,894,000	
東急不動産ホールディングス	56,400	621.00	35,024,400	
飯田グループホールディングス	17,300	2,626.00	45,429,800	
イーグランド	300	1,021.00	306,300	
ムゲンエステート	1,300	503.00	653,900	
ビーロット	1,200	575.00	690,000	
ファーストブラザーズ	400	1,025.00	410,000	
ハウスドゥ	1,000	990.00	990,000	
シーアールイー	500	1,567.00	783,500	
プロパティエージェント	300	2,925.00	877,500	
ケイアイスター不動産	700	5,230.00	3,661,000	
アグレ都市デザイン	400	1,001.00	400,400	
グッドコムアセット	1,000	1,420.00	1,420,000	
ジェイ・エス・ビー	400	4,310.00	1,724,000	
テンポイノベーション	600	884.00	530,400	
グローバル・リンク・マネジメント	400	855.00	342,000	
フェイスネットワーク	200	1,352.00	270,400	
パーク２４	11,100	2,025.00	22,477,500	
パラカ	500	1,654.00	827,000	
三井不動産	94,500	2,573.00	243,148,500	
三菱地所	136,200	1,718.50	234,059,700	
平和不動産	3,600	3,895.00	14,022,000	

東京建物	20,500	1,661.00	34,050,500	
ダイビル	5,300	1,416.00	7,504,800	
京阪神ビルディング	3,600	1,414.00	5,090,400	
住友不動産	46,600	3,642.00	169,717,200	
テーオーシー	4,100	657.00	2,693,700	
東京楽天地	300	4,050.00	1,215,000	
レオパレス２１	17,100	148.00	2,530,800	
スターツコーポレーション	2,500	2,877.00	7,192,500	
フジ住宅	2,400	640.00	1,536,000	
空港施設	2,100	575.00	1,207,500	
明和地所	1,000	616.00	616,000	
ゴールドクレスト	1,900	1,665.00	3,163,500	
エスリード	800	1,613.00	1,290,400	
日神グループホールディングス	3,100	485.00	1,503,500	
日本エスコン	3,800	768.00	2,918,400	
タカラレーベン	8,700	346.00	3,010,200	
ＡＶＡＮＴＩＡ	1,100	916.00	1,007,600	
イオンモール	10,400	1,680.00	17,472,000	
毎日コムネット	700	774.00	541,800	
ファースト住建	900	1,152.00	1,036,800	
ランド	112,300	12.00	1,347,600	
カチタス	5,100	3,320.00	16,932,000	
トーセイ	2,900	1,130.00	3,277,000	
穴吹興産	500	1,996.00	998,000	
サンフロンティア不動産	2,500	1,069.00	2,672,500	
エフ・ジェー・ネクスト	2,000	1,045.00	2,090,000	
インテリックス	500	701.00	350,500	
ランドビジネス	900	325.00	292,500	
サンネクスタグループ	700	978.00	684,600	
グランディハウス	1,400	441.00	617,400	
日本空港ビルデング	7,200	4,685.00	33,732,000	
明豊ファシリティワークス	900	985.00	886,500	
日本工営	1,200	3,005.00	3,606,000	
ＬＩＦＵＬＬ	6,100	341.00	2,080,100	
ミクシィ	5,100	2,821.00	14,387,100	
ジェイエイシーリクルートメント	1,400	1,814.00	2,539,600	

日本M&Aセンター	32,900	3,115.00	102,483,500	
メンバーズ	600	3,335.00	2,001,000	
中広	300	370.00	111,000	
ＵＴグループ	2,900	3,350.00	9,715,000	
アイティメディア	700	2,122.00	1,485,400	
タケエイ	2,200	1,874.00	4,122,800	
Ｅ・Ｊホールディングス	1,000	1,330.00	1,330,000	
夢真ビーネックスグループ	5,300	1,305.00	6,916,500	
コシダカホールディングス	5,400	556.00	3,002,400	
アルトナー	500	839.00	419,500	
パソナグループ	2,200	2,227.00	4,899,400	
ＣＤＳ	500	1,558.00	779,000	
リンクアンドモチベーション	3,700	867.00	3,207,900	
ＧＣＡ	2,600	1,111.00	2,888,600	
エス・エム・エス	6,800	3,085.00	20,978,000	
サニーサイドアップグループ	700	740.00	518,000	
パーソルホールディングス	20,100	2,242.00	45,064,200	
リニカル	1,100	950.00	1,045,000	
クックパッド	6,300	246.00	1,549,800	
エスクリ	600	452.00	271,200	
アイ・ケイ・ケイ	1,000	664.00	664,000	
学情	700	1,208.00	845,600	
スタジオアリス	1,000	2,402.00	2,402,000	
シミックホールディングス	1,100	1,512.00	1,663,200	
エプコ	500	917.00	458,500	
ＮＪＳ	500	1,925.00	962,500	
綜合警備保障	8,000	5,150.00	41,200,000	
カカクコム	14,800	3,105.00	45,954,000	
アイロムグループ	700	1,926.00	1,348,200	
セントケア・ホールディング	1,500	972.00	1,458,000	
サイネックス	300	699.00	209,700	
ルネサンス	1,300	1,251.00	1,626,300	
ディップ	3,100	3,380.00	10,478,000	
デジタルホールディングス	1,400	2,249.00	3,148,600	
新日本科学	2,400	1,093.00	2,623,200	
キャリアデザインセンター	500	1,035.00	517,500	

ベネフィット・ワン	7,300	3,515.00	25,659,500	
エムスリー	35,400	7,560.00	267,624,000	
ツカダ・グローバルホールディング	1,600	337.00	539,200	
ブラス	300	486.00	145,800	
アウトソーシング	11,500	2,114.00	24,311,000	
ウェルネット	2,000	516.00	1,032,000	
ワールドホールディングス	700	3,150.00	2,205,000	
ディー・エヌ・エー	8,500	2,135.00	18,147,500	
博報堂ＤＹホールディングス	28,000	1,729.00	48,412,000	
ぐるなび	3,500	502.00	1,757,000	
タカミヤ	2,400	501.00	1,202,400	
ジャパンベストレスキューシステム	1,400	1,034.00	1,447,600	
ファンコミュニケーションズ	5,500	405.00	2,227,500	
ライク	500	2,200.00	1,100,000	
ビジネス・ブレークスルー	800	421.00	336,800	
エスプール	5,200	968.00	5,033,600	
ＷＤＢホールディングス	900	2,950.00	2,655,000	
手間いらず	300	5,970.00	1,791,000	
ティア	1,200	477.00	572,400	
ＣＤＧ	200	1,585.00	317,000	
アドウェイズ	3,300	806.00	2,659,800	
バリューコマース	1,300	3,450.00	4,485,000	
インフォマート	20,300	928.00	18,838,400	
ＪＰホールディングス	5,700	273.00	1,556,100	
エコナックホールディングス	3,500	88.00	308,000	
ＥＰＳホールディングス	2,800	1,797.00	5,031,600	
レッグス	500	2,366.00	1,183,000	
プレステージ・インターナショナル	7,500	715.00	5,362,500	
アミューズ	1,100	2,309.00	2,539,900	
ドリームインキュベータ	600	925.00	555,000	
クイック	1,200	1,184.00	1,420,800	
ＴＡＣ	1,100	232.00	255,200	
電通グループ	22,600	3,850.00	87,010,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	929.00	836,100	
ぴあ	600	3,260.00	1,956,000	
イオンファンタジー	800	1,953.00	1,562,400	

シーティーエス	2,300	816.00	1,876,800	
ネクシィーズグループ	700	890.00	623,000	
H．U．グループホールディングス	5,600	2,882.00	16,139,200	
アルプス技研	1,800	2,001.00	3,601,800	
サニックス	3,200	354.00	1,132,800	
ダイオーズ	400	1,055.00	422,000	
日本空調サービス	2,100	742.00	1,558,200	
オリエンタルランド	21,400	15,420.00	329,988,000	
ダスキン	4,700	2,557.00	12,017,900	
明光ネットワークジャパン	2,400	581.00	1,394,400	
ファルコホールディングス	1,000	1,732.00	1,732,000	
秀英予備校	400	417.00	166,800	
田谷	400	564.00	225,600	
ラウンドワン	6,900	1,111.00	7,665,900	
リゾートトラスト	9,200	1,804.00	16,596,800	
ビー・エム・エル	2,600	3,820.00	9,932,000	
りらいあコミュニケーションズ	3,100	1,413.00	4,380,300	
リソー教育	10,200	358.00	3,651,600	
早稲田アカデミー	900	921.00	828,900	
ユー・エス・エス	22,500	1,945.00	43,762,500	
東京個別指導学院	1,800	622.00	1,119,600	
サイバーエージェント	49,500	2,228.00	110,286,000	
楽天グループ	93,900	1,313.00	123,290,700	
クリーク・アンド・リバー社	1,100	1,670.00	1,837,000	
モーニングスター	2,900	470.00	1,363,000	
テー・オー・ダブリュー	3,500	324.00	1,134,000	
山田コンサルティンググループ	1,200	1,231.00	1,477,200	
セントラルスポーツ	700	2,411.00	1,687,700	
フルキャストホールディングス	1,700	2,258.00	3,838,600	
エン・ジャパン	3,600	3,770.00	13,572,000	
リソルホールディングス	200	3,980.00	796,000	
テクノプロ・ホールディングス	12,000	2,708.00	32,496,000	
アトラグループ	500	325.00	162,500	
インターワークス	600	418.00	250,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	800	14,490.00	11,592,000	
ＫｅｅＰｅｒ技研	1,300	2,962.00	3,850,600	

ファーストロジック	400	782.00	312,800	
三機サービス	400	1,121.00	448,400	
Ｇｕｎｏｓｙ	1,300	731.00	950,300	
デザインワン・ジャパン	500	244.00	122,000	
イー・ガーディアン	800	2,884.00	2,307,200	
リブセンス	1,100	217.00	238,700	
ジャパンマテリアル	6,200	1,326.00	8,221,200	
ベクトル	2,500	1,033.00	2,582,500	
ウチヤマホールディングス	1,000	361.00	361,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,500	1,160.00	1,740,000	
キャリアリンク	700	1,978.00	1,384,600	
ＩＢＪ	1,600	1,075.00	1,720,000	
アサンテ	700	1,750.00	1,225,000	
バリューＨＲ	800	1,629.00	1,303,200	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	1,700	5,450.00	9,265,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	800	1,444.00	1,155,200	
ＥＲＩホールディングス	600	912.00	547,200	
アビスト	300	2,932.00	879,600	
シグマクシス	1,100	2,488.00	2,736,800	
ウィルグループ	1,500	981.00	1,471,500	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,900	226.00	655,400	
メドピア	1,500	4,360.00	6,540,000	
レアジョブ	400	1,652.00	660,800	
リクルートホールディングス	143,900	5,697.00	819,798,300	
エラン	2,800	1,219.00	3,413,200	
土木管理総合試験所	1,000	388.00	388,000	
ネットマーケティング	1,000	392.00	392,000	
日本郵政	152,000	926.70	140,858,400	
ベルシステム２４ホールディングス	3,400	1,735.00	5,899,000	
鎌倉新書	2,000	977.00	1,954,000	
ＳＭＮ	400	785.00	314,000	
一蔵	300	396.00	118,800	
グローバルキッズＣＯＭＰＡＮＹ	400	884.00	353,600	
エアトリ	1,300	2,531.00	3,290,300	
アトラエ	1,400	2,171.00	3,039,400	
ストライク	800	3,820.00	3,056,000	

ソラスト	4,900	1,339.00	6,561,100	
セラク	600	1,903.00	1,141,800	
インソース	1,900	2,500.00	4,750,000	
ベイカレント・コンサルティング	1,300	42,400.00	55,120,000	
Ｏｒｃｈｅｓｔｒａ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	400	2,857.00	1,142,800	
アイモバイル	600	1,647.00	988,200	
キャリアインデックス	800	969.00	775,200	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	800	1,131.00	904,800	
船場	400	861.00	344,400	
グレイステクノロジー	2,000	1,428.00	2,856,000	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,800	2,554.00	14,813,200	
フルテック	300	1,319.00	395,700	
グリーンズ	800	584.00	467,200	
ツナググループ・ホールディングス	400	345.00	138,000	
ＧａｍｅＷｉｔｈ	600	552.00	331,200	
ソウルドアウト	500	1,845.00	922,500	
ＭＳ&Ｃｏｎｓｕｌｔｉｎｇ	300	600.00	180,000	
ウェルビー	700	1,314.00	919,800	
エル・ティー・エス	200	4,040.00	808,000	
ミダック	900	5,020.00	4,518,000	
日総工産	1,600	830.00	1,328,000	
キュービーネットホールディングス	900	1,665.00	1,498,500	
ＲＰＡホールディングス	2,400	677.00	1,624,800	
スプリックス	600	1,126.00	675,600	
マネジメントソリューションズ	1,000	2,689.00	2,689,000	
プロレド・パートナーズ	400	2,874.00	1,149,600	
ａｎｄ　ｆａｃｔｏｒｙ	400	641.00	256,400	
テノ．ホールディングス	200	1,156.00	231,200	
フロンティア・マネジメント	400	1,078.00	431,200	
ピアラ	100	1,023.00	102,300	
コプロ・ホールディングス	300	1,340.00	402,000	
ギークス	300	1,586.00	475,800	
カーブスホールディングス	5,500	871.00	4,790,500	
フォーラムエンジニアリング	1,400	911.00	1,275,400	
ダイレクトマーケティングミックス	1,100	3,810.00	4,191,000	

ポピンズホールディングス	500	4,180.00	2,090,000	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	800	5,200.00	4,160,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,000	1,123.00	1,123,000	
リログループ	11,000	2,443.00	26,873,000	
東祥	1,300	1,762.00	2,290,600	
エイチ・アイ・エス	3,200	2,418.00	7,737,600	
ラックランド	600	2,691.00	1,614,600	
共立メンテナンス	3,300	3,615.00	11,929,500	
イチネンホールディングス	2,100	1,256.00	2,637,600	
建設技術研究所	1,300	2,317.00	3,012,100	
スペース	1,300	911.00	1,184,300	
長大	800	1,940.00	1,552,000	
燦ホールディングス	900	1,265.00	1,138,500	
スバル興業	100	8,110.00	811,000	
東京テアトル	800	1,246.00	996,800	
タナベ経営	400	1,456.00	582,400	
ナガワ	600	8,800.00	5,280,000	
東京都競馬	1,300	4,505.00	5,856,500	
常磐興産	800	1,410.00	1,128,000	
カナモト	3,500	2,581.00	9,033,500	
西尾レントオール	1,900	3,045.00	5,785,500	
アゴーラ　ホスピタリティー　グループ	11,000	25.00	275,000	
トランス・コスモス	1,900	3,120.00	5,928,000	
乃村工藝社	8,600	850.00	7,310,000	
藤田観光	800	2,266.00	1,812,800	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	1,100	1,294.00	1,423,400	
日本管財	2,200	2,587.00	5,691,400	
トーカイ	1,900	2,436.00	4,628,400	
白洋舎	200	2,209.00	441,800	
セコム	19,800	8,368.00	165,686,400	
セントラル警備保障	1,000	3,075.00	3,075,000	
丹青社	3,800	867.00	3,294,600	
メイテック	2,400	6,390.00	15,336,000	
応用地質	2,300	1,311.00	3,015,300	
船井総研ホールディングス	4,100	2,561.00	10,500,100	
進学会ホールディングス	800	427.00	341,600	

オオバ	1,400	819.00	1,146,600	
いであ	500	1,850.00	925,000	
学究社	600	1,347.00	808,200	
ベネッセホールディングス	7,400	2,600.00	19,240,000	
イオンディライト	2,500	3,705.00	9,262,500	
ナック	1,000	935.00	935,000	
ダイセキ	3,400	5,130.00	17,442,000	
ステップ	700	1,815.00	1,270,500	
合　計	22,320,000		55,548,602,480	

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ先進国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	
流動資産	
預金	6,405,580,545
コール・ローン	919,319,564
株式	94,519,545,326
投資証券	2,226,105,962
派生商品評価勘定	253,421,356
未収入金	152,577
未収配当金	68,814,523
差入委託証拠金	2,963,977,636

	2021年 7月26日現在
流動資産合計	107,356,917,489
資産合計	107,356,917,489
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	32,319
未払解約金	463,650,000
未払利息	2,493
流動負債合計	463,684,812
負債合計	463,684,812
純資産の部	
元本等	
元本	55,868,335,593
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	51,024,897,084
元本等合計	106,893,232,677
純資産合計	106,893,232,677
負債純資産合計	107,356,917,489

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礎と	外貨建取引等の処理基準

なる事項	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 7月26日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	46,174,135,861円
期中追加設定元本額	54,865,017,304円
期中一部解約元本額	45,170,817,572円
期末元本額	55,868,335,593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）	5,489,278,032円
ＤＣりそな　グローバルバランス	24,173,740円
つみたてバランスファンド	1,694,161,055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	133,025,587円
りそなターゲット・イヤー・ファンド２０４５	86,437,650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	66,340,480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	35,007,825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	22,346,497,905円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国株式インデックス	5,946,937,526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	786,834,318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	
	55,868,335,593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	1.9133円
(10,000口当たり純資産額)	(19,133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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在

１.金融商品に対する取組方針

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

２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在

１.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

２.時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

３.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	9,765,718,658
投資証券	360,709,585
合計	10,126,428,243

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2021年 7月26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	10,078,699,975	－	10,329,474,702	250,774,727
合計		10,078,699,975	－	10,329,474,702	250,774,727

（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26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	720,841,142	－	723,455,452	2,614,310
	米ドル	551,893,001	－	553,568,589	1,675,588
	カナダドル	25,286,120	－	25,481,384	195,264
	ユーロ	44,441,789	－	44,604,611	162,822
	英ポンド	32,864,030	－	33,120,239	256,209
	スイスフラン	27,385,258	－	27,512,893	127,635
	スウェーデンクローナ	7,930,690	－	7,950,200	19,510
	デンマーククローネ	5,609,658	－	5,631,780	22,122
	オーストラリアドル	15,351,880	－	15,439,270	87,390
	香港ドル	5,731,155	－	5,762,907	31,752
	シンガポールドル	4,347,561	－	4,383,579	36,018
合計		720,841,142	－	723,455,452	2,614,310

（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。

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	11,112	20.21	224,573.52	
	CHENIERE ENERGY INC	3,671	83.89	307,960.19	
	CHEVRON CORP	30,831	98.86	3,047,952.66	
	CONOCOPHILLIPS	21,904	55.34	1,212,167.36	
	DEVON ENERGY CORP	8,400	25.62	215,208.00	
	EOG RESOURCES INC	9,546	72.51	692,180.46	
	EXXON MOBIL CORP	67,650	57.04	3,858,756.00	
	HALLIBURTON CO	11,937	20.11	240,053.07	
	HESS CORP	4,079	74.37	303,355.23	
	KINDER MORGAN INC	33,577	17.37	583,232.49	
	MARATHON PETROLEUM CORP	10,725	53.43	573,036.75	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	13,724	26.58	364,783.92	
	ONEOK INC	6,554	52.95	347,034.30	
	PHILLIPS 66	7,210	72.17	520,345.70	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	3,062	141.95	434,650.90	
	SCHLUMBERGER LTD	22,939	28.41	651,696.99	
	VALERO ENERGY CORP	6,797	63.71	433,036.87	
	WILLIAMS COS INC	20,127	25.15	506,194.05	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,597	290.29	1,044,173.13	
	ALBEMARLE CORP	1,582	190.35	301,133.70	
	AMCOR PLC	23,330	11.30	263,629.00	
	AVERY DENNISON CORP	1,280	202.25	258,880.00	
	BALL CORP	5,460	80.00	436,800.00	
	CELANESE CORP	1,759	152.81	268,792.79	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	47.31	139,895.67	

CORTEVA INC	12,364	42.13	520,895.32	
CROWN HOLDINGS INC	2,078	97.29	202,168.62	
DOW INC	12,199	60.11	733,281.89	
DUPONT DE NEMOURS INC	8,853	74.22	657,069.66	
EASTMAN CHEMICAL CO	1,879	110.05	206,783.95	
ECOLAB INC	4,194	217.89	913,830.66	
FMC CORP	1,927	106.35	204,936.45	
FREEPORT-MCMORAN INC	23,826	35.19	838,436.94	
INTERNATIONAL PAPER CO	5,534	58.08	321,414.72	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,701	148.33	548,969.33	
LINDE PLC	8,398	298.81	2,509,406.38	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	96.59	432,819.79	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	926	356.23	329,868.98	
MOSAIC CO/THE	5,552	29.85	165,727.20	
NEWMONT CORP	13,087	60.11	786,659.57	
NUCOR CORP	4,490	94.33	423,541.70	
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,312	133.63	175,322.56	
PPG INDUSTRIES INC	3,899	162.92	635,225.08	
RPM INTERNATIONAL INC	1,446	88.17	127,493.82	
SEALED AIR CORP	2,628	54.94	144,382.32	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,143	285.97	1,184,773.71	
STEEL DYNAMICS INC	3,569	59.08	210,856.52	
VULCAN MATERIALS CO	2,241	178.14	399,211.74	
WESTROCK CO	3,862	48.17	186,032.54	
3M CO	9,301	200.49	1,864,757.49	
ALLEGION PLC	1,523	139.18	211,971.14	
AMETEK INC	3,808	137.83	524,856.64	
BOEING CO/THE	8,886	221.52	1,968,426.72	
CARRIER GLOBAL CORP	13,521	51.90	701,739.90	
CATERPILLAR INC	8,757	209.53	1,834,854.21	
CUMMINS INC	2,428	237.44	576,504.32	
DEERE & CO	4,788	354.70	1,698,303.60	
DOVER CORP	2,147	164.29	352,730.63	
EATON CORP PLC	6,455	156.73	1,011,692.15	
EMERSON ELECTRIC CO	9,737	98.48	958,899.76	

FASTENAL CO	9,489	54.64	518,478.96	
FORTIVE CORP	4,937	69.31	342,183.47	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	98.17	184,755.94	
GENERAC HOLDINGS INC	936	449.64	420,863.04	
GENERAL DYNAMICS CORP	3,970	191.86	761,684.20	
GENERAL ELECTRIC CO	140,851	12.71	1,790,216.21	
HEICO CORP	647	135.99	87,985.53	
HEICO CORP-CLASS A	819	124.13	101,662.47	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	11,142	229.32	2,555,083.44	
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	32.38	189,552.52	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	203.75	123,065.00	
IDEX CORP	1,126	227.80	256,502.80	
ILLINOIS TOOL WORKS	5,119	226.39	1,158,890.41	
INGERSOLL-RAND INC	5,287	48.61	257,001.07	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	62.59	256,619.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	11,727	70.92	831,678.84	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,426	227.25	778,558.50	
LENNOX INTERNATIONAL INC	470	320.61	150,686.70	
LOCKHEED MARTIN CORP	4,057	380.77	1,544,783.89	
MASCO CORP	4,315	59.78	257,950.70	
NORDSON CORP	746	224.99	167,842.54	
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,570	361.31	928,566.70	
OTIS WORLDWIDE CORP	6,779	88.52	600,077.08	
OWENS CORNING	1,611	94.18	151,723.98	
PACCAR INC	5,737	87.58	502,446.46	
PARKER HANNIFIN CORP	1,915	306.68	587,292.20	
PENTAIR PLC	2,474	68.46	169,370.04	
PLUG POWER INC	8,433	26.81	226,088.73	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	24,376	85.81	2,091,704.56	
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,913	299.25	572,465.25	
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,708	496.63	848,244.04	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,682	54.88	92,308.16	
SMITH (A.O.) CORP	1,507	69.63	104,932.41	
SNAP-ON INC	772	224.59	173,383.48	
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,406	204.19	491,281.14	

SUNRUN INC	2,890	50.62	146,291.80	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	718	445.66	319,983.88	
TEXTRON INC	3,103	68.03	211,097.09	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	3,892	201.45	784,043.40	
TRANSDIGM GROUP INC	855	647.64	553,732.20	
UNITED RENTALS INC	1,210	324.06	392,112.60	
WABTEC CORP	2,696	81.81	220,559.76	
WW GRAINGER INC	677	458.66	310,512.82	
XYLEM INC	2,684	123.26	330,829.84	
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,541	89.69	138,212.29	
CINTAS CORP	1,398	395.34	552,685.32	
CLARIVATE PLC	5,086	25.14	127,862.04	
COPART INC	3,522	146.64	516,466.08	
COSTAR GROUP INC	6,493	89.97	584,175.21	
EQUIFAX INC	2,015	253.07	509,936.05	
IHS MARKIT LTD	6,159	115.44	710,994.96	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,775	133.90	237,672.50	
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	106.42	208,902.46	
REPUBLIC SERVICES INC	3,720	116.18	432,189.60	
ROBERT HALF INTL INC	1,565	92.87	145,341.55	
ROLLINS INC	3,021	37.90	114,495.90	
TRANSUNION	2,592	115.74	299,998.08	
VERISK ANALYTICS INC	2,566	188.39	483,408.74	
WASTE CONNECTIONS INC	4,328	124.76	539,961.28	
WASTE MANAGEMENT INC	6,862	146.39	1,004,528.18	
AMERCO	106	583.65	61,866.90	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	92.88	213,995.52	
CSX CORP	37,234	32.81	1,221,647.54	
DELTA AIR LINES INC	1,316	40.41	53,179.56	
EXPEDITORS INTL WASH INC	2,507	130.36	326,812.52	
FEDEX CORP	4,101	297.07	1,218,284.07	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,166	167.25	195,013.50	
KANSAS CITY SOUTHERN	1,313	271.40	356,348.20	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	48.37	118,990.20	
LYFT INC-A	4,003	54.90	219,764.70	

NORFOLK SOUTHERN CORP	4,110	265.32	1,090,465.20	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,525	261.08	398,147.00	
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	50.70	111,793.50	
UBER TECHNOLOGIES INC	19,720	47.46	935,911.20	
UNION PACIFIC CORP	10,773	220.15	2,371,675.95	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	11,571	211.64	2,448,886.44	
XPO LOGISTICS INC	1,496	143.62	214,855.52	
APTIV PLC	4,393	157.39	691,414.27	
AUTOLIV INC	743	93.75	69,656.25	
BORGWARNER INC	3,548	47.00	166,756.00	
FORD MOTOR CO	63,205	13.82	873,493.10	
GENERAL MOTORS CO	20,887	54.94	1,147,531.78	
LEAR CORP	775	167.04	129,456.00	
TESLA INC	12,229	643.38	7,867,894.02	
DR HORTON INC	5,761	93.55	538,941.55	
GARMIN LTD	2,605	154.13	401,508.65	
HASBRO INC	1,788	92.41	165,229.08	
LENNAR CORP-A	4,608	102.86	473,978.88	
LULULEMON ATHLETICA INC	2,034	402.79	819,274.86	
MOHAWK INDUSTRIES INC	916	191.84	175,725.44	
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	27.33	151,244.22	
NIKE INC -CL B	20,365	166.36	3,387,921.40	
NVR INC	54	5,130.03	277,021.62	
PELOTON INTERACTIVE INC-A	4,183	121.55	508,443.65	
PULTEGROUP INC	3,683	54.07	199,139.81	
VF CORP	5,597	83.08	464,998.76	
WHIRLPOOL CORP	966	219.52	212,056.32	
AIRBNB INC-CLASS A	758	138.73	105,157.34	
ARAMARK	2,216	34.75	77,006.00	
BOOKING HOLDINGS INC	665	2,202.57	1,464,709.05	
CAESARS ENTERTAINMENT INC	3,166	90.31	285,921.46	
CARNIVAL CORP	14,286	21.96	313,720.56	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	466	1,830.92	853,208.72	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,796	144.52	259,557.92	
DOMINO'S PIZZA INC	590	525.45	310,015.50	

DRAFTKINGS INC - CL A	2,552	49.33	125,890.16	
EXPEDIA GROUP INC	1,958	161.55	316,314.90	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	4,654	125.26	582,960.04	
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	45.77	234,571.25	
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	4,599	139.18	640,088.82	
MCDONALD'S CORP	11,979	242.96	2,910,417.84	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	14.48	52,128.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	38.76	272,366.52	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	3,496	77.72	271,709.12	
STARBUCKS CORP	18,969	125.97	2,389,524.93	
VAIL RESORTS INC	557	312.56	174,095.92	
WYNN RESORTS LTD	1,490	103.57	154,319.30	
YUM! BRANDS INC	5,025	122.79	617,019.75	
ACTIVISION BLIZZARD INC	12,635	91.50	1,156,102.50	
ALPHABET INC-CL A	4,792	2,660.30	12,748,157.60	
ALPHABET INC-CL C	4,697	2,756.32	12,946,435.04	
ALTICE USA INC- A	4,447	34.47	153,288.09	
CABLE ONE INC	68	1,938.89	131,844.52	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,196	726.81	1,596,074.76	
COMCAST CORP-CLASS A	73,170	58.36	4,270,201.20	
DISCOVERY INC - A	1,722	28.47	49,025.34	
DISCOVERY INC-C	3,336	26.83	89,504.88	
DISH NETWORK CORP-A	3,674	41.68	153,132.32	
ELECTRONIC ARTS INC	4,781	144.99	693,197.19	
FACEBOOK INC-A	38,318	369.79	14,169,613.22	
FOX CORP - CLASS A	3,877	36.19	140,308.63	
FOX CORP- CLASS B	1,836	34.01	62,442.36	
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	140.80	158,540.80	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	35.29	207,293.46	
LIBERTY BROADBAND-A	223	171.18	38,173.14	
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	177.10	474,450.90	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	2,153	47.85	103,021.05	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	45.73	80,347.61	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	46.41	43,903.86	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	77.71	190,778.05	

MATCH GROUP INC	4,252	165.86	705,236.72	
NETFLIX INC	7,095	515.41	3,656,833.95	
NEWS CORP - CLASS A	5,861	24.75	145,059.75	
OMNICOM GROUP	3,237	72.30	234,035.10	
PINTEREST INC- CLASS A	8,848	76.91	680,499.68	
ROKU INC	1,804	473.65	854,464.60	
SEA LTD-ADR	300	297.67	89,301.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.43	66,788.41	
SNAP INC - A	15,397	77.97	1,200,504.09	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	1,602	173.29	277,610.58	
TWITTER INC	13,122	71.69	940,716.18	
VIACOMCBS INC - CLASS B	9,721	40.99	398,463.79	
WALT DISNEY CO/THE	29,025	176.14	5,112,463.50	
ZILLOW GROUP INC - A	904	113.28	102,405.12	
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	111.64	300,758.16	
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	214.95	201,408.15	
AMAZON.COM INC	6,808	3,656.64	24,894,405.12	
AUTOZONE INC	373	1,632.13	608,784.49	
BEST BUY CO INC	3,865	113.28	437,827.20	
BURLINGTON STORES INC	1,107	329.97	365,276.79	
CARMAX INC	2,353	134.84	317,278.52	
CARVANA CO	1,176	338.92	398,569.92	
CHEWY INC - CLASS A	1,090	86.74	94,546.60	
DOLLAR GENERAL CORP	3,974	228.90	909,648.60	
DOLLAR TREE INC	3,916	100.15	392,187.40	
EBAY INC	11,068	73.54	813,940.72	
ETSY INC	2,096	208.86	437,770.56	
GENUINE PARTS CO	1,957	129.09	252,629.13	
HOME DEPOT INC	17,166	332.84	5,713,531.44	
L BRANDS INC	3,612	77.85	281,194.20	
LKQ CORP	4,394	50.76	223,039.44	
LOWE'S COS INC	11,709	200.84	2,351,635.56	
MERCADOLIBRE INC	725	1,613.81	1,170,012.25	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,161	620.92	720,888.12	
POOL CORP	578	462.37	267,249.86	

ROSS STORES INC	5,808	121.68	706,717.44	
TARGET CORP	8,031	261.03	2,096,331.93	
TJX COMPANIES INC	19,344	68.18	1,318,873.92	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,677	187.70	314,772.90	
ULTA BEAUTY INC	726	341.58	247,987.08	
WAYFAIR INC- CLASS A	1,109	285.51	316,630.59	
COSTCO WHOLESALE CORP	7,088	423.43	3,001,271.84	
KROGER CO	10,508	39.89	419,164.12	
SYSCO CORP	7,493	72.87	546,014.91	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12,077	46.53	561,942.81	
WALMART INC	24,870	142.43	3,542,234.10	
ALTRIA GROUP INC	30,116	47.49	1,430,208.84	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	9,327	58.01	541,059.27	
BOSTON BEER COMPANY INC-A	139	701.00	97,439.00	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	72.02	380,409.64	
BUNGE LTD	2,145	74.94	160,746.30	
CAMPBELL SOUP CO	1,995	44.57	88,917.15	
COCA-COLA CO/THE	65,565	57.01	3,737,860.65	
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	2,797	61.34	171,567.98	
CONAGRA BRANDS INC	6,526	34.25	223,515.50	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2,822	224.58	633,764.76	
GENERAL MILLS INC	9,019	59.40	535,728.60	
HERSHEY CO/THE	2,482	179.26	444,923.32	
HORMEL FOODS CORP	4,355	47.34	206,165.70	
JM SMUCKER CO/THE	1,878	130.50	245,079.00	
KELLOGG CO	3,449	63.43	218,770.07	
KEURIG DR PEPPER INC	10,616	36.07	382,919.12	
KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	39.22	445,970.62	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	75.50	161,192.50	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	85.72	365,424.36	
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	49.70	138,911.50	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	22,873	64.89	1,484,228.97	
MONSTER BEVERAGE CORP	5,854	96.29	563,681.66	
PEPSICO INC	22,108	157.18	3,474,935.44	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	25,028	98.40	2,462,755.20	

TYSON FOODS INC-CL A	5,049	71.32	360,094.68	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,223	86.48	278,725.04	
CLOROX COMPANY	2,061	184.77	380,810.97	
COLGATE-PALMOLIVE CO	12,951	83.28	1,078,559.28	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	3,687	333.55	1,229,798.85	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,985	135.66	676,265.10	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	39,222	139.79	5,482,843.38	
ABBOTT LABORATORIES	28,307	120.80	3,419,485.60	
ABIOMED INC	756	328.52	248,361.12	
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,220	638.28	778,701.60	
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,255	121.31	273,554.05	
ANTHEM INC	3,939	382.29	1,505,840.31	
BAXTER INTERNATIONAL INC	8,249	81.14	669,323.86	
BECTON DICKINSON AND CO	4,690	251.08	1,177,565.20	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	22,936	44.12	1,011,936.32	
CARDINAL HEALTH INC	4,308	59.20	255,033.60	
CENTENE CORP	9,487	73.46	696,915.02	
CERNER CORP	5,093	78.41	399,342.13	
CIGNA CORP	5,669	232.88	1,320,196.72	
COOPER COS INC/THE	727	410.07	298,120.89	
CVS HEALTH CORP	21,065	83.27	1,754,082.55	
DANAHER CORP	10,253	291.27	2,986,391.31	
DAVITA INC	1,175	120.61	141,716.75	
DENTSPLY SIRONA INC	3,218	63.59	204,632.62	
DEXCOM INC	1,418	460.72	653,300.96	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,094	109.40	1,104,283.60	
HCA HEALTHCARE INC	4,405	248.46	1,094,466.30	
HENRY SCHEIN INC	2,103	77.36	162,688.08	
HOLOGIC INC	3,815	72.30	275,824.50	
HUMANA INC	2,088	471.22	983,907.36	
IDEXX LABORATORIES INC	1,385	693.74	960,829.90	
INSULET CORP	967	276.55	267,423.85	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,890	976.46	1,845,509.40	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	283.77	458,288.55	
MASIMO CORP	701	274.54	192,452.54	

MCKESSON CORP	2,622	202.63	531,295.86	
MEDTRONIC PLC	21,558	128.54	2,771,065.32	
MOLINA HEALTHCARE INC	807	261.20	210,788.40	
NOVOCURE LTD	1,266	189.37	239,742.42	
OAK STREET HEALTH INC	1,457	60.49	88,133.93	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,978	139.43	275,792.54	
RESMED INC	2,384	259.83	619,434.72	
STERIS PLC	1,666	212.47	353,975.02	
STRYKER CORP	5,449	262.67	1,431,288.83	
TELADOC HEALTH INC	2,048	151.59	310,456.32	
TELEFLEX INC	632	397.91	251,479.12	
UNITEDHEALTH GROUP INC	15,124	417.70	6,317,294.80	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,058	152.67	161,524.86	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,223	333.06	740,392.38	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,226	381.07	467,191.82	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,416	159.97	546,457.52	
10X GENOMICS INC-CLASS A	892	183.47	163,655.24	
ABBVIE INC	28,242	118.19	3,337,921.98	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4,984	152.31	759,113.04	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,684	182.41	307,178.44	
AMGEN INC	9,264	247.72	2,294,878.08	
AVANTOR INC	8,797	37.18	327,072.46	
BIO-RAD LABORATORIES-A	375	682.92	256,095.00	
BIO-TECHNE CORP	598	474.40	283,691.20	
BIOGEN INC	2,479	325.40	806,666.60	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	77.04	202,923.36	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	35,914	68.34	2,454,362.76	
CATALENT INC	2,865	116.26	333,084.90	
CHARLES RIVER LABORATORIES	773	396.32	306,355.36	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,428	36.50	198,122.00	
ELI LILLY & CO	13,035	244.15	3,182,495.25	
EXACT SCIENCES CORP	2,304	117.95	271,756.80	
GILEAD SCIENCES INC	20,271	69.02	1,399,104.42	
HORIZON THERAPEUTICS PLC	3,200	101.05	323,360.00	
ILLUMINA INC	2,362	495.51	1,170,394.62	

INCYTE CORP	2,513	79.30	199,280.90	
IQVIA HOLDINGS INC	3,128	249.08	779,122.24	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	173.93	130,969.29	
JOHNSON & JOHNSON	41,901	171.79	7,198,172.79	
MERCK & CO. INC.	40,476	77.54	3,138,509.04	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	386	1,477.14	570,176.04	
MODERNA INC	5,123	348.83	1,787,056.09	
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	964	98.52	94,973.28	
NOVAVAX INC	1,081	203.24	219,702.44	
PERKINELMER INC	1,624	164.34	266,888.16	
PFIZER INC	89,169	41.68	3,716,563.92	
PPD INC	1,772	46.16	81,795.52	
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,708	586.35	1,001,485.80	
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	40.33	66,625.16	
SEAGEN INC	2,093	145.60	304,740.80	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	8.81	184,499.02	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	6,298	532.26	3,352,173.48	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,234	200.50	848,917.00	
VIATRIS INC	17,737	13.92	246,899.04	
WATERS CORP	1,044	384.70	401,626.80	
ZOETIS INC	7,656	203.59	1,558,685.04	
BANK OF AMERICA CORP	123,795	37.70	4,667,071.50	
CITIGROUP INC	33,269	66.71	2,219,374.99	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,675	43.63	247,600.25	
FIFTH THIRD BANCORP	10,229	35.78	365,993.62	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2,832	196.93	557,705.76	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	20,642	13.82	285,272.44	
JPMORGAN CHASE & CO	48,578	150.64	7,317,789.92	
KEYCORP	12,976	19.10	247,841.60	
M & T BANK CORP	1,846	129.33	238,743.18	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6,798	183.02	1,244,169.96	
REGIONS FINANCIAL CORP	12,767	19.10	243,849.70	
SVB FINANCIAL GROUP	909	570.87	518,920.83	
TRUIST FINANCIAL CORP	21,635	54.46	1,178,242.10	
US BANCORP	22,895	55.72	1,275,709.40	

WELLS FARGO & CO	65,983	44.59	2,942,181.97	
ALLY FINANCIAL INC	5,678	51.79	294,063.62	
AMERICAN EXPRESS CO	11,017	173.18	1,907,924.06	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,676	248.89	417,139.64	
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,618	59.44	155,613.92	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	13,731	49.97	686,138.07	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	21,872	278.49	6,091,133.28	
BLACKROCK INC	2,451	868.95	2,129,796.45	
BLACKSTONE GROUP INC/THE	11,101	111.30	1,235,541.30	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,447	160.08	1,192,115.76	
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	46.82	126,414.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,239	120.20	148,927.80	
CME GROUP INC	5,816	211.90	1,232,410.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,068	123.01	623,414.68	
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	29.41	164,637.18	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	523	345.23	180,555.29	
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	29.30	133,695.90	
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	124.62	99,696.00	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	5,558	374.05	2,078,969.90	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,122	121.36	1,107,045.92	
INVESCO LTD	5,927	24.82	147,108.14	
KKR & CO INC	8,634	61.42	530,300.28	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	520	475.19	247,098.80	
MOODY'S CORP	2,737	381.86	1,045,150.82	
MORGAN STANLEY	22,690	94.55	2,145,339.50	
MSCI INC	1,354	578.95	783,898.30	
NASDAQ INC	1,746	187.76	327,828.96	
NORTHERN TRUST CORP	2,987	111.49	333,020.63	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,703	128.50	218,835.50	
S&P GLOBAL INC	3,880	418.50	1,623,780.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	23,253	67.91	1,579,111.23	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	60.80	105,548.80	
STATE STREET CORP	5,873	85.35	501,260.55	
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	46.51	453,844.58	
T ROWE PRICE GROUP INC	3,735	207.35	774,452.25	

TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	87.82	134,364.60	
VOYA FINANCIAL INC	1,741	62.77	109,282.57	
AFLAC INC	10,863	53.37	579,758.31	
ALLEGHANY CORP	197	655.68	129,168.96	
ALLSTATE CORP	5,002	129.74	648,959.48	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	776	125.91	97,706.16	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	14,280	47.31	675,586.80	
AON PLC	3,696	232.48	859,246.08	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	38.53	235,071.53	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	3,256	143.05	465,770.80	
ASSURANT INC	896	155.02	138,897.92	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,286	65.22	149,092.92	
BROWN & BROWN INC	4,086	54.35	222,074.10	
CHUBB LTD	7,310	166.90	1,220,039.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,376	115.24	273,810.24	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	183.68	70,165.76	
EVEREST RE GROUP LTD	550	242.79	133,534.50	
FNF GROUP	4,754	44.74	212,693.96	
GLOBE LIFE INC	1,521	93.36	142,000.56	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5,383	61.40	330,516.20	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,060	60.28	124,176.80	
LOEWS CORP	2,906	53.57	155,674.42	
MARKEL CORP	207	1,229.33	254,471.31	
MARSH & MCLENNAN COS	8,253	147.41	1,216,574.73	
METLIFE INC	12,373	57.63	713,055.99	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,764	62.19	234,083.16	
PROGRESSIVE CORP	9,562	94.73	905,808.26	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6,559	99.50	652,620.50	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1,021	107.21	109,461.41	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	149.32	83,917.84	
TRAVELERS COS INC/THE	4,173	147.87	617,061.51	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	226.41	488,592.78	
WR BERKLEY CORP	2,140	74.81	160,093.40	
CBRE GROUP INC - A	5,718	87.73	501,640.14	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.72	94,872.00	

ACCENTURE PLC-CL A	10,150	318.65	3,234,297.50	
ADOBE INC	7,644	625.87	4,784,150.28	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,171	119.54	259,521.34	
ANSYS INC	1,440	365.40	526,176.00	
AUTODESK INC	3,568	312.65	1,115,535.20	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	6,908	206.08	1,423,600.64	
AVALARA INC	1,064	166.42	177,070.88	
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	60.94	157,895.54	
BLACK KNIGHT INC	2,282	80.00	182,560.00	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	1,673	172.49	288,575.77	
CADENCE DESIGN SYS INC	4,589	145.67	668,479.63	
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	100.35	193,575.15	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	125.90	209,497.60	
CITRIX SYSTEMS INC	1,705	114.93	195,955.65	
CLOUDFLARE INC - CLASS A	3,402	117.24	398,850.48	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	8,746	69.29	606,010.34	
COUPA SOFTWARE INC	1,218	225.33	274,451.94	
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	2,923	268.96	786,170.08	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	712	146.31	104,172.72	
DATADOG INC - CLASS A	2,452	111.23	272,735.96	
DOCUSIGN INC	3,040	308.50	937,840.00	
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	30.91	164,812.12	
DYNATRACE INC	2,449	63.48	155,462.52	
EPAM SYSTEMS INC	933	557.36	520,016.88	
FAIR ISAAC CORP	389	552.88	215,070.32	
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	10,020	148.83	1,491,276.60	
FISERV INC	9,774	111.79	1,092,635.46	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,117	257.08	287,158.36	
FORTINET INC	2,054	275.71	566,308.34	
GARTNER INC	1,494	260.61	389,351.34	
GLOBAL PAYMENTS INC	4,805	193.03	927,509.15	
GODADDY INC - CLASS A	2,217	86.13	190,950.21	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	908	114.89	104,320.12	
HUBSPOT INC	629	580.34	365,033.86	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	14,357	141.34	2,029,218.38	

INTUIT INC	4,395	528.43	2,322,449.85	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	176.27	226,330.68	
MASTERCARD INC-CLASS A	14,150	393.26	5,564,629.00	
MICROSOFT CORP	113,959	289.67	33,010,503.53	
MONGODB INC	916	361.54	331,170.64	
NORTONLIFELOCK INC	8,787	25.78	226,528.86	
OKTA INC	1,795	257.91	462,948.45	
ORACLE CORP	30,665	87.69	2,689,013.85	
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	7,937	21.81	173,105.97	
PALO ALTO NETWORKS INC	1,601	401.62	642,993.62	
PAYCHEX INC	5,355	112.25	601,098.75	
PAYCOM SOFTWARE INC	719	395.90	284,652.10	
PAYPAL HOLDINGS INC	17,756	308.53	5,478,258.68	
PTC INC	1,603	152.69	244,762.07	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	276.55	351,218.50	
SALESFORCE.COM INC	15,231	248.25	3,781,095.75	
SERVICENOW INC	3,155	586.18	1,849,397.90	
SNOWFLAKE INC-CLASS A	380	264.92	100,669.60	
SPLUNK INC	2,723	141.75	385,985.25	
SQUARE INC - A	6,284	264.00	1,658,976.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	3,098	75.70	234,518.60	
SYNOPSYS INC	2,499	285.07	712,389.93	
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	7,048	81.15	571,945.20	
TWILIO INC - A	2,599	409.84	1,065,174.16	
TYLER TECHNOLOGIES INC	585	497.85	291,242.25	
UNITY SOFTWARE INC	839	105.50	88,514.50	
VERISIGN INC	1,710	222.54	380,543.40	
VISA INC-CLASS A SHARES	27,048	249.02	6,735,492.96	
VMWARE INC-CLASS A	1,126	158.34	178,290.84	
WESTERN UNION CO	5,513	23.22	128,011.86	
WIX.COM LTD	998	302.51	301,904.98	
WORKDAY INC-CLASS A	2,951	240.40	709,420.40	
ZENDESK INC	1,677	146.90	246,351.30	
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	3,307	359.23	1,187,973.61	
ZSCALER INC	1,359	238.72	324,420.48	

AMPHENOL CORP-CL A	9,809	71.00	696,439.00	
APPLE INC	266,967	148.56	39,660,617.52	
ARISTA NETWORKS INC	777	380.98	296,021.46	
ARROW ELECTRONICS INC	902	113.86	102,701.72	
CDW CORP/DE	2,130	180.95	385,423.50	
CISCO SYSTEMS INC	67,475	55.23	3,726,644.25	
COGNEX CORP	2,959	86.06	254,651.54	
CORNING INC	12,703	41.22	523,617.66	
DELL TECHNOLOGIES -C	3,945	96.55	380,889.75	
F5 NETWORKS INC	916	192.18	176,036.88	
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	19,254	14.10	271,481.40	
HP INC	19,172	28.20	540,650.40	
IPG PHOTONICS CORP	558	215.46	120,226.68	
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	27.57	124,974.81	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	159.70	492,834.20	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	2,775	221.70	615,217.50	
NETAPP INC	3,390	77.72	263,470.80	
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,159	85.48	270,031.32	
TE CONNECTIVITY LTD	5,405	138.35	747,781.75	
TRIMBLE INC	3,417	83.45	285,148.65	
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	63.75	327,993.75	
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	793	548.61	435,047.73	
AT&T INC	114,268	28.15	3,216,644.20	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	26.05	34,021.30	
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	26.02	162,182.66	
LUMEN TECHNOLOGIES INC	12,971	12.63	163,823.73	
T-MOBILE US INC	10,055	144.00	1,447,920.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	66,240	55.88	3,701,491.20	
AES CORP	9,870	23.90	235,893.00	
ALLIANT ENERGY CORP	3,704	58.61	217,091.44	
AMEREN CORPORATION	4,330	83.39	361,078.70	
AMERICAN ELECTRIC POWER	8,198	85.98	704,864.04	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,044	167.27	509,169.88	
ATMOS ENERGY CORP	2,000	99.45	198,900.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	6,820	25.18	171,727.60	

CMS ENERGY CORP	3,883	62.08	241,056.64	
CONSOLIDATED EDISON INC	5,799	74.18	430,169.82	
DOMINION ENERGY INC	13,150	75.32	990,458.00	
DTE ENERGY COMPANY	3,309	116.36	385,035.24	
DUKE ENERGY CORP	12,477	104.47	1,303,472.19	
EDISON INTERNATIONAL	6,481	56.23	364,426.63	
ENTERGY CORP	3,422	102.74	351,576.28	
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	48.65	193,724.30	
EVERGY INC	3,540	65.08	230,383.20	
EVERSOURCE ENERGY	5,222	86.22	450,240.84	
EXELON CORP	16,097	46.52	748,832.44	
FIRSTENERGY CORP	8,044	38.47	309,452.68	
NEXTERA ENERGY INC	31,497	77.20	2,431,568.40	
NISOURCE INC	4,230	25.21	106,638.30	
NRG ENERGY INC	3,312	41.00	135,792.00	
P G & E CORP	21,589	9.22	199,050.58	
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	84.55	129,023.30	
PPL CORP	13,143	28.26	371,421.18	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	8,469	61.22	518,472.18	
SEMPRA ENERGY	5,230	130.72	683,665.60	
SOUTHERN CO/THE	17,217	63.86	1,099,477.62	
UGI CORP	3,091	46.15	142,649.65	
VISTRA CORP	4,854	19.10	92,711.40	
WEC ENERGY GROUP INC	5,298	94.03	498,170.94	
XCEL ENERGY INC	8,022	68.27	547,661.94	
ADVANCED MICRO DEVICES	19,422	92.15	1,789,737.30	
ANALOG DEVICES INC	5,956	163.55	974,103.80	
APPLIED MATERIALS INC	14,699	138.43	2,034,782.57	
BROADCOM INC	6,521	483.15	3,150,621.15	
ENPHASE ENERGY INC	1,709	178.18	304,509.62	
INTEL CORP	64,852	53.00	3,437,156.00	
KLA CORP	2,499	320.76	801,579.24	
LAM RESEARCH CORP	2,296	640.27	1,470,059.92	
MARVELL TECHNOLOGY INC	12,993	58.92	765,547.56	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,781	99.28	375,377.68	

	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	4,387	139.22	610,758.14	
	MICRON TECHNOLOGY INC	17,977	75.94	1,365,173.38	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	609	414.26	252,284.34	
	NVIDIA CORP	39,428	195.58	7,711,328.24	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	4,480	196.35	879,648.00	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	5,425	36.35	197,198.75	
	QORVO INC	1,631	193.09	314,929.79	
	QUALCOMM INC	18,166	144.88	2,631,890.08	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	192.66	520,759.98	
	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	716	248.63	178,019.08	
	TERADYNE INC	2,370	128.80	305,256.00	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	14,707	186.85	2,748,002.95	
	XILINX INC	4,011	137.86	552,956.46	
米ドル 小計		5,037,932		620,546,790.06 (68,595,242,173)	
カナダドル	CAMECO CORP	6,660	21.48	143,056.80	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	19,669	40.95	805,445.55	
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	10.12	223,024.56	
	ENBRIDGE INC	32,985	48.80	1,609,668.00	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	34.06	97,990.62	
	INTER PIPELINE LTD	3,471	20.22	70,183.62	
	KEYERA CORP	2,259	32.30	72,965.70	
	PARKLAND CORP	1,790	39.80	71,242.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	39.40	340,258.40	
	SUNCOR ENERGY INC	25,615	26.14	669,576.10	
	TC ENERGY CORP	15,580	61.02	950,691.60	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,421	75.36	257,806.56	
	B2GOLD CORP	10,119	4.95	50,089.05	
	BARRICK GOLD CORP	29,830	25.93	773,491.90	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,673	69.25	115,855.25	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	9,213	24.55	226,179.15	
	FRANCO-NEVADA CORP	3,254	184.85	601,501.90	
	IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	9.20	95,302.80	
	KINROSS GOLD CORP	19,092	7.70	147,008.40	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,057	50.12	253,456.84	

LUNDIN MINING CORP	7,300	11.32	82,636.00	
NUTRIEN LTD	9,609	74.28	713,756.52	
PAN AMERICAN SILVER CORP	2,050	33.77	69,228.50	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7,404	26.40	195,465.60	
WEST FRASER TIMBER CO LTD	1,300	90.00	117,000.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	54.94	433,256.84	
YAMANA GOLD INC	9,288	5.12	47,554.56	
BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	19.84	53,052.16	
CAE INC	3,196	39.00	124,644.00	
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	103.95	147,193.20	
WSP GLOBAL INC	1,908	146.93	280,342.44	
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	41.07	128,754.45	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	76.11	137,682.99	
THOMSON REUTERS CORP	2,714	131.36	356,511.04	
AIR CANADA	840	25.11	21,092.40	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	11,656	132.99	1,550,131.44	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	11,094	92.81	1,029,634.14	
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,285	101.73	435,913.05	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	43.32	164,096.16	
RESTAURANT BRANDS INTERN	4,126	82.80	341,632.80	
QUEBECOR INC -CL B	1,274	33.32	42,449.68	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	36.50	317,623.00	
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	195.50	182,401.50	
DOLLARAMA INC	5,287	58.96	311,721.52	
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	14,242	49.15	699,994.30	
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	40.33	105,987.24	
LOBLAW COMPANIES LTD	2,114	80.25	169,648.50	
METRO INC	4,107	61.98	254,551.86	
WESTON (GEORGE) LTD	817	124.58	101,781.86	
SAPUTO INC	3,667	36.09	132,342.03	
BAUSCH HEALTH COS INC	3,277	35.96	117,840.92	
CANOPY GROWTH CORP	3,659	24.70	90,377.30	
BANK OF MONTREAL	10,497	124.47	1,306,561.59	
BANK OF NOVA SCOTIA	19,615	77.92	1,528,400.80	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	7,311	143.12	1,046,350.32	

	NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	94.02	530,836.92	
	ROYAL BANK OF CANADA	22,851	125.32	2,863,687.32	
	TORONTO-DOMINION BANK	29,178	82.68	2,412,437.04	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	21,038	64.39	1,354,636.82	
	IGM FINANCIAL INC	81	43.74	3,542.94	
	ONEX CORPORATION	908	93.99	85,342.92	
	TMX GROUP LTD	540	134.67	72,721.80	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	526.61	240,134.16	
	GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	37.24	161,174.72	
	IA FINANCIAL CORP INC	1,254	65.91	82,651.14	
	INTACT FINANCIAL CORP	2,773	168.60	467,527.80	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	32,652	23.97	782,668.44	
	POWER CORP OF CANADA	8,338	39.28	327,516.64	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	63.98	639,160.20	
	FIRSTSERVICE CORP	671	229.21	153,799.91	
	BLACKBERRY LTD	7,347	12.83	94,262.01	
	CGI INC	3,488	115.85	404,084.80	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	1,928.54	657,632.14	
	LIGHTSPEED POS INC-SUB VOTE	1,593	108.03	172,091.79	
	NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	103.11	85,478.19	
	OPEN TEXT CORP	4,289	64.54	276,812.06	
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,806	2,068.45	3,735,620.70	
	BCE INC	2,440	61.99	151,255.60	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	5,173	64.49	333,606.77	
	TELUS CORP	4,085	27.66	112,991.10	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	8,948	19.39	173,501.72	
	ALTAGAS LTD	2,930	26.41	77,381.30	
	ATCO LTD -CLASS I	863	43.79	37,790.77	
	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	53.12	109,214.72	
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.31	34,850.97	
	EMERA INC	4,109	58.10	238,732.90	
	FORTIS INC	8,232	56.06	461,485.92	
	HYDRO ONE LTD	4,991	30.37	151,576.67	
	NORTHLAND POWER INC	3,252	43.37	141,039.24	
		627,669		38,039,653.65	

カナダドル 小計				(3,342,544,366)	
ユーロ	ENI SPA	42,914	9.66	414,935.46	
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.34	61,858.68	
	NESTE OYJ	7,057	55.72	393,216.04	
	OMV AG	2,574	45.85	118,017.90	
	REPSOL SA	21,728	9.18	199,549.95	
	TENARIS SA	5,062	8.53	43,219.35	
	TOTALENERGIES SE	40,333	35.63	1,437,266.45	
	VOPAK	762	38.25	29,146.50	
	AIR LIQUIDE SA	7,694	150.56	1,158,408.64	
	AKZO NOBEL	3,222	102.70	330,899.40	
	ARCELORMITTAL	12,348	27.16	335,433.42	
	ARKEMA	822	102.75	84,460.50	
	BASF SE	14,987	67.17	1,006,676.79	
	COVESTRO AG	2,528	56.16	141,972.48	
	CRH PLC	11,526	41.45	477,752.70	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,793	29.24	52,427.32	
	FUCHS PETROLUB SE -PREF	1,085	41.00	44,485.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	74.08	160,309.12	
	KONINKLIJKE DSM NV	2,864	170.35	487,882.40	
	LANXESS AG	745	60.06	44,744.70	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	47.07	187,150.32	
	SOLVAY SA	1,489	110.80	164,981.20	
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	16.60	144,685.60	
	SYMRISE AG	1,815	122.85	222,972.75	
	UMICORE	3,883	53.88	209,216.04	
	UPM-KYMMENE OYJ	8,076	34.39	277,733.64	
	VOESTALPINE AG	2,425	35.86	86,960.50	
	ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,875	22.02	63,307.50	
	AIRBUS SE	9,541	111.50	1,063,821.50	
	ALSTOM	3,998	36.98	147,846.04	
	BOUYGUES SA	3,499	32.40	113,367.60	
	BRENNTAG SE	2,419	83.58	202,180.02	
	CNH INDUSTRIAL NV	16,278	13.72	223,415.55	
	COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	8,413	59.03	496,619.39	

DASSAULT AVIATION SA	11	1,013.00	11,143.00	
EIFFAGE	1,313	85.92	112,812.96	
FERROVIAL SA	7,014	24.60	172,544.40	
GEA GROUP AG	1,676	35.72	59,866.72	
KINGSPAN GROUP PLC	2,050	89.20	182,860.00	
KION GROUP AG	740	89.84	66,481.60	
KNORR-BREMSE AG	1,136	95.80	108,828.80	
KONE OYJ-B	5,617	71.86	403,637.62	
LEGRAND SA	4,481	93.72	419,959.32	
MTU AERO ENGINES AG	831	207.10	172,100.10	
PRYSMIAN SPA	4,594	29.73	136,579.62	
RATIONAL AG	80	897.20	71,776.00	
SAFRAN SA	5,615	116.40	653,586.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	8,718	140.18	1,222,089.24	
SIEMENS AG-REG	12,326	134.62	1,659,326.12	
SIEMENS ENERGY AG	5,006	22.81	114,186.86	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	22.92	94,613.76	
THALES SA	1,768	89.48	158,200.64	
VINCI SA	8,693	90.15	783,673.95	
WARTSILA OYJ ABP	8,128	12.72	103,428.80	
BUREAU VERITAS SA	4,564	27.41	125,099.24	
RANDSTAD NV	1,871	65.82	123,149.22	
TELEPERFORMANCE	832	360.60	300,019.20	
WOLTERS KLUWER	4,447	94.74	421,308.78	
ADP	314	105.40	33,095.60	
AENA SME SA	1,045	135.05	141,127.25	
ATLANTIA SPA	8,066	15.17	122,401.55	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	9.84	13,844.88	
DEUTSCHE POST AG-REG	16,274	59.29	964,885.46	
GETLINK	4,655	13.26	61,748.57	
INPOST SA	3,195	17.60	56,232.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	5,485	85.62	469,625.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	73.00	45,187.00	
CONTINENTAL AG	1,647	117.74	193,917.78	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	13,868	75.09	1,041,348.12	

FAURECIA	1,292	39.57	51,124.44	
FERRARI NV	2,135	179.20	382,592.00	
MICHELIN (CGDE)	2,826	138.00	389,988.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	92.30	221,427.70	
RENAULT SA	3,099	31.21	96,735.28	
STELLANTIS NV	33,623	15.75	529,629.49	
VALEO SA	3,692	24.16	89,198.72	
VOLKSWAGEN AG	462	279.20	128,990.40	
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,043	208.50	634,465.50	
ADIDAS AG	3,112	316.70	985,570.40	
ESSILORLUXOTTICA	4,703	155.12	729,529.36	
HERMES INTERNATIONAL	524	1,288.00	674,912.00	
KERING	1,227	747.60	917,305.20	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	4,452	674.00	3,000,648.00	
MONCLER SPA	3,302	59.60	196,799.20	
PUMA SE	1,586	106.15	168,353.90	
SEB SA	166	141.10	23,422.60	
ACCOR SA	2,330	29.89	69,643.70	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	151.00	422,498.00	
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	806	49.56	39,945.36	
SODEXO	1,088	74.50	81,056.00	
BOLLORE	14,850	4.62	68,725.80	
PUBLICIS GROUPE	3,613	54.80	197,992.40	
SCOUT24 AG	1,621	71.78	116,355.38	
UBISOFT ENTERTAINMENT	1,095	56.32	61,670.40	
VIVENDI	11,862	28.46	337,592.52	
DELIVERY HERO SE	2,411	129.00	311,019.00	
HELLOFRESH SE	2,219	83.38	185,020.22	
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	18,187	28.84	524,513.08	
JUST EAT TAKEAWAY	2,552	71.26	181,855.52	
PROSUS NV	7,939	79.97	634,881.83	
ZALANDO SE	3,598	100.35	361,059.30	
CARREFOUR SA	10,978	15.94	175,044.21	
COLRUYT SA	290	47.97	13,911.30	
JERONIMO MARTINS	5,217	16.68	87,019.56	

KESKO OYJ-B SHS	4,478	36.08	161,566.24	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	17,272	25.85	446,481.20	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	12,812	58.09	744,249.08	
DANONE	10,826	58.19	629,964.94	
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	11.49	103,615.93	
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	84.15	153,153.00	
HEINEKEN NV	4,350	100.00	435,000.00	
JDE PEET'S BV	1,184	29.75	35,224.00	
KERRY GROUP PLC-A	2,701	124.40	336,004.40	
PERNOD RICARD SA	3,480	186.35	648,498.00	
REMY COINTREAU	264	182.40	48,153.60	
BEIERSDORF AG	1,716	101.90	174,860.40	
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	77.55	121,133.10	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,396	85.94	205,912.24	
L'OREAL	4,043	387.05	1,564,843.15	
AMPLIFON SPA	2,059	41.37	85,180.83	
BIOMERIEUX	402	94.86	38,133.72	
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	184.75	116,392.50	
DIASORIN SPA	256	172.35	44,121.60	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	2,956	69.54	205,560.24	
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	45.56	324,787.32	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	14,872	40.76	606,257.08	
ORPEA	501	107.65	53,932.65	
SARTORIUS AG-VORZUG	502	497.60	249,795.20	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	54.62	254,911.54	
ARGENX SE	674	267.90	180,564.60	
BAYER AG-REG	16,071	51.26	823,799.46	
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	102.90	221,132.10	
GRIFOLS SA	3,329	20.80	69,243.20	
IPSEN	158	86.92	13,733.36	
MERCK KGAA	2,192	174.10	381,627.20	
ORION OYJ-CLASS B	739	35.45	26,197.55	
QIAGEN N.V.	2,679	44.30	118,679.70	
RECORDATI SPA	1,969	51.24	100,891.56	
SANOFI	18,263	88.07	1,608,422.41	

SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	461.90	205,083.60	
UCB SA	2,009	90.22	181,251.98	
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	9.59	36,526.18	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	109,886	5.36	589,648.27	
BANCO SANTANDER SA	282,095	3.12	881,828.97	
BNP PARIBAS	18,170	50.57	918,856.90	
CAIXABANK S.A	78,740	2.53	199,212.20	
COMMERZBANK AG	13,866	5.42	75,209.18	
CREDIT AGRICOLE SA	16,523	11.67	192,856.45	
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	31.57	123,785.97	
FINECOBANK SPA	11,008	14.42	158,735.36	
ING GROEP NV-CVA	62,971	10.53	663,084.63	
INTESA SANPAOLO	271,197	2.28	619,685.14	
KBC GROEP NV	3,531	66.36	234,317.16	
MEDIOBANCA SPA	6,857	9.92	68,021.44	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	1,216	18.81	22,872.96	
SOCIETE GENERALE SA	12,059	24.47	295,083.73	
UNICREDIT SPA	35,836	9.65	345,996.58	
AMUNDI SA	618	77.30	47,771.40	
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	10.56	372,398.40	
DEUTSCHE BOERSE AG	3,191	148.00	472,268.00	
EURAZEO	403	77.25	31,131.75	
EXOR NV	1,318	67.56	89,044.08	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	97.40	192,754.60	
SOFINA	168	396.40	66,595.20	
WENDEL	294	112.10	32,957.40	
AEGON NV	16,557	3.56	59,025.70	
AGEAS	2,765	45.07	124,618.55	
ALLIANZ SE-REG	6,681	210.00	1,403,010.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	16,006	16.73	267,860.41	
AXA SA	31,953	21.77	695,616.81	
CNP ASSURANCES	1,015	14.78	15,006.77	
HANNOVER RUECK SE	718	142.60	102,386.80	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,344	229.85	538,768.40	
NN GROUP NV	4,060	41.31	167,718.60	

POSTE ITALIANE SPA	5,374	11.21	60,242.54	
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	40.77	343,324.17	
SCOR SE	1,565	24.40	38,186.00	
AROUNDTOWN SA	10,475	6.62	69,407.35	
DEUTSCHE WOHNEN SE	6,085	51.10	310,943.50	
LEG IMMOBILIEN SE	1,031	130.75	134,803.25	
VONOVIA SE	8,104	57.26	464,035.04	
ADYEN NV	322	2,308.00	743,176.00	
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	56.46	431,806.08	
ATOS SE	1,599	40.89	65,383.11	
BECHTLE AG	414	170.25	70,483.50	
CAPGEMINI SA	2,687	172.30	462,970.10	
DASSAULT SYSTEMES SE	9,025	44.45	401,206.37	
EDENRED	3,764	50.78	191,135.92	
NEMETSCHEK SE	536	73.04	39,149.44	
NEXI SPA	7,091	19.00	134,729.00	
SAP SE	16,792	117.78	1,977,761.76	
TEAMVIEWER AG	2,285	29.29	66,927.65	
WORLDLINE SA	4,054	84.37	342,035.98	
NOKIA OYJ	89,059	4.95	441,420.93	
CELLNEX TELECOM SA	7,697	55.54	427,491.38	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	54,555	17.91	977,298.27	
ELISA OYJ	2,152	54.26	116,767.52	
ILIAD SA	98	118.30	11,593.40	
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	10.03	24,806.52	
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.70	159,331.03	
ORANGE	34,597	9.52	329,501.82	
PROXIMUS	918	16.97	15,578.46	
TELECOM ITALIA SPA	72,024	0.37	26,771.32	
TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.39	28,533.57	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.45	31,022.74	
TELEFONICA SA	91,673	3.76	344,736.31	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	35.11	26,894.26	
E.ON SE	38,444	10.39	399,510.04	
EDF	10,409	10.85	112,937.65	

	EDP RENOVAVEIS SA	3,232	20.98	67,807.36	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.56	226,238.60	
	ELIA GROUP SA/NV	345	95.30	32,878.50	
	ENAGAS SA	2,667	18.89	50,392.96	
	ENDESA SA	4,803	21.35	102,544.05	
	ENEL SPA	133,241	8.05	1,072,590.05	
	ENGIE	31,335	11.46	359,224.44	
	FORTUM OYJ	6,395	23.29	148,939.55	
	IBERDROLA SA	94,841	10.42	988,717.42	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	22.56	104,858.88	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,907	16.33	80,131.31	
	RWE AG	11,090	30.17	334,585.30	
	SNAM SPA	32,585	5.01	163,250.85	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	19.66	113,949.36	
	TERNA SPA	25,545	6.69	171,049.32	
	UNIPER SE	2,857	32.44	92,681.08	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	8,568	26.23	224,738.64	
	VERBUND AG	1,516	84.25	127,723.00	
	ASM INTERNATIONAL NV	621	304.50	189,094.50	
	ASML HOLDING NV	6,691	638.80	4,274,210.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	21,326	32.12	684,991.12	
	STMICROELECTRONICS NV	11,414	33.22	379,173.08	
ユーロ 小計		2,913,012		76,172,786.90 (9,905,509,208)	
英ポンド	BP PLC	330,682	2.84	939,467.56	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	66,729	13.65	910,984.30	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	60,484	13.41	811,332.37	
	ANGLO AMERICAN PLC	21,366	29.64	633,288.24	
	ANTOFAGASTA PLC	4,320	14.37	62,078.40	
	BHP GROUP PLC	34,634	22.58	782,035.72	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	79.32	173,948.76	
	EVRAZ PLC	3,072	6.06	18,640.89	
	GLENCORE PLC	166,199	3.15	524,773.34	
	JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	30.76	96,555.64	
	MONDI PLC	7,876	19.90	156,732.40	

RIO TINTO PLC	18,226	59.26	1,080,072.76	
ASHTEAD GROUP PLC	7,512	56.50	424,428.00	
BAE SYSTEMS PLC	55,064	5.52	303,953.28	
BUNZL PLC	4,790	26.67	127,749.30	
DCC PLC	1,401	60.14	84,256.14	
FERGUSON PLC	3,775	103.95	392,411.25	
MELROSE INDUSTRIES PLC	76,613	1.58	121,278.37	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	107,239	0.95	102,552.65	
SMITHS GROUP PLC	6,986	15.91	111,147.26	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	146.50	176,386.00	
EXPERIAN PLC	15,285	31.44	480,560.40	
INTERTEK GROUP PLC	2,573	55.92	143,882.16	
RELX PLC	31,739	20.66	655,727.74	
RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	5.29	156,457.98	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	12,121	7.19	87,149.99	
BERKELEY GROUP HOLDINGS	1,498	49.35	73,926.30	
BURBERRY GROUP PLC	5,808	21.05	122,258.40	
PERSIMMON PLC	5,194	28.93	150,262.42	
TAYLOR WIMPEY PLC	43,373	1.66	72,107.61	
COMPASS GROUP PLC	30,179	14.85	448,158.15	
ENTAIN PLC	10,699	18.48	197,771.01	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,512	47.53	119,395.36	
WHITBREAD PLC	2,921	30.33	88,593.93	
AUTO TRADER GROUP PLC	11,332	6.60	74,813.86	
INFORMA PLC	17,619	4.99	88,077.38	
PEARSON PLC	13,772	8.57	118,053.58	
WPP PLC	19,572	9.52	186,325.44	
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	9.28	46,068.48	
KINGFISHER PLC	29,802	3.75	111,817.10	
NEXT PLC	1,878	80.92	151,967.76	
OCADO GROUP PLC	6,371	18.68	119,042.13	
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.79	77,707.02	
TESCO PLC	131,492	2.34	308,085.75	
WM MORRISON SUPERMARKETS	42,443	2.66	113,110.59	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	20.40	101,469.60	

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	35,567	27.69	984,850.23	
COCA-COLA HBC AG-DI	1,836	27.10	49,755.60	
DIAGEO PLC	37,936	35.05	1,329,846.48	
IMPERIAL BRANDS PLC	14,237	15.69	223,378.53	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	11,553	62.64	723,679.92	
UNILEVER PLC	42,129	41.44	1,745,825.76	
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00	
SMITH & NEPHEW PLC	12,128	15.54	188,529.76	
ASTRAZENECA PLC	24,957	84.80	2,116,353.60	
GLAXOSMITHKLINE PLC	81,445	14.16	1,153,261.20	
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	1,352	26.44	35,746.88	
BARCLAYS PLC	284,737	1.67	475,852.47	
HSBC HOLDINGS PLC	327,374	4.01	1,314,733.98	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,158,693	0.45	531,666.28	
NATWEST GROUP PLC	73,118	1.99	145,577.93	
STANDARD CHARTERED PLC	39,789	4.31	171,769.11	
3I GROUP PLC	14,053	12.95	182,056.61	
ABRDN PLC	32,937	2.85	94,068.07	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	16.32	91,338.37	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	5,447	76.24	415,279.28	
M&G PLC	41,949	2.25	94,427.19	
SCHRODERS PLC	1,161	36.73	42,643.53	
ST JAMES'S PLACE PLC	7,750	15.26	118,265.00	
ADMIRAL GROUP PLC	2,745	33.50	91,957.50	
AVIVA PLC	60,743	3.85	233,982.03	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	2.96	58,065.91	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.63	275,139.50	
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.87	60,112.50	
PRUDENTIAL PLC	43,245	13.64	590,078.02	
AVEVA GROUP PLC	2,041	39.98	81,599.18	
SAGE GROUP PLC/THE	15,187	7.04	107,037.97	
HALMA PLC	6,704	28.56	191,466.24	
BT GROUP PLC	129,623	1.84	239,478.49	
VODAFONE GROUP PLC	448,104	1.18	532,526.79	
NATIONAL GRID PLC	59,116	9.29	549,483.22	

	SEVERN TRENT PLC	2,734	27.40	74,911.60	
	SSE PLC	18,204	15.22	277,064.88	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,835	10.52	82,424.20	
英ポンド 小計		4,674,096		28,001,096.58 (4,254,206,603)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	19.04	54,259.20	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	968.50	75,543.00	
	GIVAUDAN-REG	153	4,489.00	686,817.00	
	HOLCIM LTD	8,800	53.30	469,040.00	
	SIKA AG-REG	2,337	320.20	748,307.40	
	ABB LTD-REG	28,259	33.67	951,480.53	
	GEBERIT AG-REG	620	743.60	461,032.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	285.00	61,275.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	297.80	210,544.60	
	ADECCO SA-REG	2,354	63.44	149,337.76	
	SGS SA-REG	90	2,927.00	263,430.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	844	307.60	259,614.40	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	8,543	116.10	991,842.30	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	307.80	126,198.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	58.70	14,733.70	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	42	2,274.00	95,508.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	9,750.00	234,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	100,500.00	100,500.00	
	NESTLE SA-REG	45,578	115.62	5,269,728.36	
	ALCON INC	8,263	65.42	540,565.46	
	SONOVA HOLDING AG-REG	840	352.20	295,848.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	162	1,649.50	267,219.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,218	705.60	859,420.80	
	NOVARTIS AG-REG	35,565	84.57	3,007,732.05	
	ROCHE HOLDING AG-BR	420	387.00	162,540.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	11,232	347.30	3,900,873.60	
	VIFOR PHARMA AG	638	126.50	80,707.00	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	80.10	21,867.30	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	41,644	9.26	385,623.44	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	59.80	213,426.20	

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	335	1,529.50	512,382.50	
	UBS GROUP AG-REG	60,103	14.62	878,705.86	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	144.90	95,344.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	516	465.30	240,094.80	
	SWISS RE AG	5,123	83.26	426,540.98	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,466	366.70	904,282.20	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	95.25	106,394.25	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	139.40	162,958.60	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	110.60	326,159.40	
	SWISSCOM AG-REG	414	544.80	225,547.20	
スイスフラン 小計		280,829		24,837,424.09 (2,983,968,130)	
スウェーデンクローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	275.00	888,250.00	
	BOLIDEN AB	4,039	321.00	1,296,519.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	9,468	159.00	1,505,412.00	
	ALFA LAVAL AB	4,566	350.80	1,601,752.80	
	ASSA ABLOY AB-B	17,091	276.90	4,732,497.90	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	11,247	586.20	6,592,991.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	493.60	3,394,980.80	
	EPIROC AB-A	9,564	204.60	1,956,794.40	
	EPIROC AB-B	4,649	175.00	813,575.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	329.50	482,388.00	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	19,556	101.35	1,982,000.60	
	SANDVIK AB	19,332	226.90	4,386,430.80	
	SKANSKA AB-B SHS	4,937	258.80	1,277,695.60	
	SKF AB-B SHARES	4,538	229.90	1,043,286.20	
	VOLVO AB-A SHS	3,298	215.60	711,048.80	
	VOLVO AB-B SHS	21,605	209.00	4,515,445.00	
	SECURITAS AB-B SHS	3,833	143.55	550,227.15	
	ELECTROLUX AB-SER B	3,653	227.00	829,231.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	2,837	119.55	339,163.35	
	EVOLUTION AB	2,577	1,503.80	3,875,292.60	
	EMBRACER GROUP AB	4,198	223.30	937,413.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	187.48	2,449,238.72	
	ICA GRUPPEN AB	1,462	422.70	617,987.40	

	SWEDISH MATCH AB	26,306	78.40	2,062,390.40	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	10,496	282.30	2,963,020.80	
	NORDEA BANK ABP	54,039	99.86	5,396,334.54	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	23,883	114.65	2,738,185.95	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	96.22	2,213,541.10	
	SWEDBANK AB - A SHARES	13,356	164.20	2,193,055.20	
	EQT AB	4,360	430.20	1,875,672.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	344.00	589,616.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	329.50	775,313.50	
	INVESTOR AB-B SHS	30,610	216.20	6,617,882.00	
	KINNEVIK AB - B	3,881	377.30	1,464,301.30	
	LUNDBERGS AB-B SHS	920	608.00	559,360.00	
	FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	594.80	941,568.40	
	SINCH AB	7,260	175.15	1,271,589.00	
	ERICSSON LM-B SHS	49,181	101.96	5,014,494.76	
	HEXAGON AB-B SHS	33,733	139.70	4,712,500.10	
	TELE2 AB-B SHS	7,424	127.65	947,673.60	
	TELIA CO AB	49,229	38.92	1,916,238.82	
スウェーデンクローナ 小計		520,419		91,032,359.39 (1,156,110,964)	
ノルウェークローネ	EQUINOR ASA	14,162	172.56	2,443,794.72	
	NORSK HYDRO ASA	20,202	56.16	1,134,544.32	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	470.70	1,304,780.40	
	ADEVINTA ASA	3,943	179.15	706,388.45	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	552	412.60	227,755.20	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	472.80	550,812.00	
	MOWI ASA	8,760	226.80	1,986,768.00	
	ORKLA ASA	11,182	81.38	909,991.16	
	DNB BANK ASA	13,700	175.00	2,397,500.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	201.80	539,613.20	
	TELENOR ASA	13,825	154.15	2,131,123.75	
ノルウェークローネ 小計		92,937		14,333,071.20 (178,590,067)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,218	552.00	672,336.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	477.70	1,592,651.80	

	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	3,285.00	423,765.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	16,911	234.00	3,957,174.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	39	16,820.00	655,980.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	17,380.00	1,720,620.00	
	DSV PANALPINA A S	3,473	1,534.50	5,329,318.50	
	PANDORA A/S	1,659	838.00	1,390,242.00	
	CARLSBERG AS-B	1,603	1,169.00	1,873,907.00	
	AMBU A/S-B	1,526	229.80	350,674.80	
	COLOPLAST-B	1,680	1,121.00	1,883,280.00	
	DEMANT A/S	1,941	367.70	713,705.70	
	GN STORE NORD A/S	1,892	581.60	1,100,387.20	
	GENMAB A/S	1,125	2,840.00	3,195,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	27,782	570.90	15,860,743.80	
	DANSKE BANK A/S	9,894	108.05	1,069,046.70	
	TRYG A/S	4,694	155.30	728,978.20	
	ORSTED A/S	3,278	944.40	3,095,743.20	
デンマーククローネ 小計		82,277		45,613,553.90 (797,781,057)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	28.77	86,655.24	
	OIL SEARCH LTD	32,812	3.99	130,919.88	
	SANTOS LTD	26,550	6.59	174,964.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	33.37	11,913.09	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	13,609	22.34	304,025.06	
	BHP GROUP LTD	47,944	51.27	2,458,088.88	
	BLUESCOPE STEEL LTD	6,256	22.67	141,823.52	
	EVOLUTION MINING LTD	16,140	4.25	68,595.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	25.25	738,360.50	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	6,656	46.49	309,437.44	
	NEWCREST MINING LTD	15,067	26.17	394,303.39	
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	10.09	150,108.93	
	ORICA LTD	6,263	13.00	81,419.00	
	RIO TINTO LTD	6,335	127.10	805,178.50	
	SOUTH32 LTD	74,829	2.95	220,745.55	
	REECE LTD	5,105	23.12	118,027.60	
	BRAMBLES LTD	27,700	11.62	321,874.00	

AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.91	90,070.76	
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	4.55	39,585.00	
SYDNEY AIRPORT	22,505	7.80	175,539.00	
TRANSURBAN GROUP	47,822	14.34	685,767.48	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	41.61	379,025.49	
CROWN RESORTS LTD	773	10.02	7,745.46	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	119.00	123,165.00	
TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	4.95	187,619.85	
REA GROUP LTD	563	162.55	91,515.65	
SEEK LTD	6,794	30.60	207,896.40	
WESFARMERS LTD	18,825	61.93	1,165,832.25	
COLES GROUP LTD	18,622	17.61	327,933.42	
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	6.44	109,228.84	
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	39.52	846,162.72	
TREASURY WINE ESTATES LTD	7,050	11.95	84,247.50	
COCHLEAR LTD	1,060	246.07	260,834.20	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	64.64	177,760.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	40.10	291,527.00	
CSL LTD	7,413	293.48	2,175,567.24	
AUST AND NZ BANKING GROUP	46,634	27.69	1,291,295.46	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	28,594	99.12	2,834,237.28	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	53,909	26.04	1,403,790.36	
WESTPAC BANKING CORP	59,855	24.71	1,479,017.05	
ASX LTD	3,256	77.67	252,893.52	
MACQUARIE GROUP LTD	5,810	157.70	916,237.00	
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	53.92	83,953.44	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	35,291	4.91	173,278.81	
MEDIBANK PRIVATE LTD	33,618	3.32	111,611.76	
QBE INSURANCE GROUP LTD	24,270	10.63	257,990.10	
SUNCORP GROUP LTD	19,255	11.40	219,507.00	
LENDLEASE GROUP	8,292	11.92	98,840.64	
AFTERPAY LTD	3,885	106.70	414,529.50	
COMPUTERSHARE LTD	5,604	16.08	90,112.32	
WISETECH GLOBAL LTD	1,600	30.55	48,880.00	
XERO LTD	1,891	142.92	270,261.72	

	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.77	272,800.97	
	AGL ENERGY LTD	7,599	7.99	60,716.01	
	APA GROUP	13,816	9.59	132,495.44	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.84	2,651.26	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.53	119,628.24	
オーストラリアドル 小計		1,047,298		24,478,191.22 (1,989,097,818)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.15	159,373.50	
	A2 MILK CO LTD	7,857	7.14	56,098.98	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,000	32.65	359,150.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	13.02	71,688.12	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.83	209,259.75	
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.82	49,104.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	5.28	121,338.31	
ニュージーランドドル 小計		120,137		1,026,012.66 (79,002,974)	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	57.35	2,781,475.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	21,500	133.50	2,870,250.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	31.90	957,000.00	
	MTR CORP	19,500	46.35	903,825.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	57.05	2,339,050.00	
	SANDS CHINA LTD	50,200	29.45	1,478,390.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	7.52	15,040.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	10.98	57,096.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	16.02	541,476.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	24.20	532,400.00	
	WH GROUP LTD	152,000	6.29	956,080.00	
	BANK OF EAST ASIA	3,600	13.04	46,944.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	25.20	1,738,800.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	149.90	1,783,810.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	19,800	521.00	10,315,800.00	
	AIA GROUP LTD	196,000	94.90	18,600,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	53.15	2,126,000.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	28.10	820,520.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	18.88	509,760.00	

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	36.05	1,078,471.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	37.70	980,200.00	
	SINO LAND CO	58,000	12.50	725,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,700	115.40	2,273,380.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	50.00	210,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	23.00	115,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	45.00	1,035,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	33,000	10.66	351,780.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	46.60	205,040.00	
	CLP HOLDINGS LTD	24,000	78.45	1,882,800.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.85	243,350.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	164,717	12.52	2,062,256.84	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	18,000	49.20	885,600.00	
香港ドル 小計		1,263,133		61,421,994.64 (874,034,983)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	19,000	5.30	100,700.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	12,000	3.97	47,640.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	4.91	129,133.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.81	65,852.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.53	114,156.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	30,000	30.21	906,300.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	12.12	687,204.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	26.01	528,003.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	11,500	11.80	135,700.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	4.00	199,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	6.84	20,520.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.37	15,477.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	19.07	78,187.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	123,100	2.25	276,975.00	
シンガポールドル 小計		463,900		3,305,047.00 (268,303,715)	
イスラエルシュケル	ICL GROUP LTD	12,922	22.42	289,711.24	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	411.00	156,591.00	
	BANK HAPOALIM BM	18,231	25.80	470,359.80	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	17,924	24.60	440,930.40	

	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	15.19	359,562.49	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	97.45	137,794.30	
	AZRIELI GROUP	234	249.70	58,429.80	
	NICE SYSTEMS LTD	960	939.00	901,440.00	
イスラエルシュケル 小計		75,737		2,814,819.03 (95,153,268)	
合　計		17,199,376		94,519,545,326 (94,519,545,326)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	8,437	136,004.44	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,239	440,948.66	
		AMERICAN TOWER CORP	7,181	2,048,452.06	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	16,047	134,634.33	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,369	537,289.20	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,200	252,780.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,697	249,849.31	
		CROWN CASTLE INTL CORP	7,018	1,357,632.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	4,665	722,421.90	
		DUKE REALTY CORP	5,513	282,816.90	
		EQUINIX INC	1,459	1,216,047.32	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,445	201,468.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	5,175	438,943.50	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	970	321,952.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,920	329,107.20	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	7,606	275,869.62	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	165,579.54	
		INVITATION HOMES INC	9,853	399,243.56	
		IRON MOUNTAIN INC	4,068	176,632.56	
		MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,954	188,034.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,702	319,295.20	

	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,330	87,211.90	
	PROLOGIS INC	12,019	1,537,109.91	
	PUBLIC STORAGE	2,608	818,390.40	
	REALTY INCOME CORP	5,689	400,960.72	
	REGENCY CENTERS CORP	2,658	172,902.90	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,836	618,805.44	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	5,481	680,466.15	
	SUN COMMUNITIES INC	1,872	352,310.40	
	UDR INC	5,162	283,548.66	
	VENTAS INC	5,547	331,987.95	
	VEREIT INC	3,546	174,463.20	
	VICI PROPERTIES INC	7,940	253,762.40	
	VORNADO REALTY TRUST	2,829	124,532.58	
	WELLTOWER INC	7,019	615,987.44	
	WEYERHAEUSER CO	12,823	443,419.34	
	WP CAREY INC	2,436	193,491.48	
米ドル 小計		193,806	17,284,352.97 (1,910,612,377)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	58,577.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	34,379.10	
カナダドル 小計		2,480	92,956.10 (8,168,052)	
ユーロ	COVIVIO	522	41,217.12	
	GECINA SA	569	75,989.95	
	KLEPIERRE	3,496	74,569.68	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	164,414.48	
ユーロ 小計		6,868	356,191.23 (46,319,107)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	69,791.36	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	6,648	46,004.16	
	SEGRO PLC	18,596	224,267.76	
英ポンド 小計		39,086	340,063.28 (51,665,814)	
オーストラリアドル	DEXUS/AU	13,745	142,948.00	
	GOODMAN GROUP	29,600	666,888.00	
	GPT GROUP	32,860	156,085.00	

		MIRVAC GROUP	63,099	180,463.14	
		SCENTRE GROUP	83,252	213,125.12	
		STOCKLAND	29,890	130,918.20	
		VICINITY CENTRES	42,168	63,884.52	
	オーストラリアドル 小計		294,614	1,554,311.98 (126,303,391)	
	香港ドル	LINK REIT	38,700	2,914,110.00	
	香港ドル 小計		38,700	2,914,110.00 (41,467,785)	
	シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	226,259.00	
		CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	155,736.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	49,220.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	38,500	80,850.00	
	シンガポールドル 小計		209,360	512,065.00 (41,569,436)	
合計				2,226,105,962 (2,226,105,962)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	598銘柄	97.3%	—	70.9%
	投資証券	37銘柄	—	2.7%	2.0%
カナダドル	株式	89銘柄	99.8%	—	3.5%
	投資証券	2銘柄	—	0.2%	0.0%
ユーロ	株式	231銘柄	99.5%	—	10.2%
	投資証券	4銘柄	—	0.5%	0.0%
英ポンド	株式	84銘柄	98.8%	—	4.4%
	投資証券	3銘柄	—	1.2%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%	—	3.1%
スウェーデンクローナ	株式	41銘柄	100.0%	—	1.2%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%	—	0.2%

デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%	—	0.8%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	94.0%	—	2.1%
	投資証券	7銘柄	—	6.0%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%	—	0.1%
香港ドル	株式	32銘柄	95.5%	—	0.9%
	投資証券	1銘柄	—	4.5%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	86.6%	—	0.3%
	投資証券	4銘柄	—	13.4%	0.0%
イスラエルシュケル	株式	8銘柄	100.0%	—	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	
流動資産	
預金	890,105,159
コール・ローン	85,897,392
株式	14,099,949,331
投資証券	10,711,207
派生商品評価勘定	123,295
未収入金	1,483,094
未収配当金	39,302,428
差入委託証拠金	1,078,486,384
流動資産合計	16,206,058,290
資産合計	16,206,058,290
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	79,539,936
未払金	22,736,585

	2021年 7月26日現在
未払解約金	57,938,000
未払利息	232
流動負債合計	160,214,753
負債合計	160,214,753
純資産の部	
元本等	
元本	9,555,405,971
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,490,437,566
元本等合計	16,045,843,537
純資産合計	16,045,843,537
負債純資産合計	16,206,058,290

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26日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	6,916,953,326円
期中追加設定元本額	6,832,918,088円
期中一部解約元本額	4,194,465,443円
期末元本額	9,555,405,971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	10,313,218円
つみたてバランスファンド	458,556,776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	2,322,759,614円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　新興国株式インデックス	1,394,830,360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	
	9,555,405,971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	1.6792円
(10,000口当たり純資産額)	(16,792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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
1 .金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2 .金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3 .金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在
1 .貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2 .時価の算定方法 株式、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	△646,140,454
投資証券	850,028
合計	△645,290,426

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(株式関連)

（2021年 7月26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	2,055,138,125	－	1,975,598,515	△79,539,610
合計		2,055,138,125	－	1,975,598,515	△79,539,610

（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26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	81,190,800	－	81,314,095	123,295
	米ドル	81,190,800	－	81,314,095	123,295
	売建	69,218	－	69,544	△326
	オフショア人民元	69,218	－	69,544	△326
合計		81,260,018	－	81,383,639	122,969

（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。

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	92,693	7.53	698,534.44	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	6,475	87.02	563,454.50	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,433	207.40	297,204.20	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	18,641	7.36	137,197.76	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	11,989	4.38	52,535.79	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,726	39.39	146,767.14	
	YPF S.A.-SPONSORED ADR	1,900	4.24	8,056.00	

CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	8.60	27,459.80	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	9,876	33.79	333,710.04	
NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,400	33.28	79,872.00	
PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	19.00	44,574.00	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,078	92.50	99,715.00	
SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	23.54	75,328.00	
SOUTHERN COPPER CORP	1,285	63.08	81,057.80	
51JOB INC-ADR	500	77.81	38,905.00	
DIDI GLOBAL INC	4,700	8.06	37,882.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	6,900	28.01	193,269.00	
LI AUTO INC - ADR	7,400	30.28	224,072.00	
NIO INC - ADR	20,100	43.99	884,199.00	
XPENG INC - ADR	6,000	41.00	246,000.00	
GAOTU TECHEDU INC	1,900	3.52	6,688.00	
HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,800	47.10	131,880.00	
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	24,300	2.93	71,199.00	
TAL EDUCATION GROUP- ADR	6,500	6.00	39,000.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	6,550	66.16	433,348.00	
AUTOHOME INC-ADR	1,020	51.94	52,978.80	
BAIDU INC - SPON ADR	4,150	172.66	716,539.00	
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,500	95.21	238,025.00	
DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	4.00	6,400.00	
HUYA INC-ADR	1,300	13.39	17,407.00	
IQIYI INC-ADR	4,500	11.32	50,940.00	
JOYY INC	920	55.00	50,600.00	
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	20.74	35,071.34	
MOMO INC-SPON ADR	2,650	12.44	32,966.00	
NETEASE INC-ADR	6,310	103.53	653,274.30	
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	10,500	10.78	113,190.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	930	59.20	55,056.00	
YANDEX NV-A	4,700	70.34	330,598.00	
BAOZUN INC-SPN ADR	900	26.52	23,868.00	
DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	23.47	23,470.00	
JD.COM INC-ADR	13,420	72.29	970,131.80	
OZON HOLDINGS PLC - ADR	600	53.63	32,178.00	

	PINDUODUO INC-ADR	6,800	97.31	661,708.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	7,950	27.23	216,478.50	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,000	17.06	119,420.00	
	MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,497	13.85	62,283.45	
	X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	31.64	59,451.56	
	ADECOAGRO SA	1,800	9.10	16,380.00	
	RLX TECHNOLOGY INC-ADR	1,600	4.97	7,952.00	
	BEIGENE LTD-ADR	700	316.93	221,851.00	
	BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	800	26.60	21,280.00	
	HUTCHMED CHINA-ADR	1,300	40.39	52,507.00	
	I-MAB-SPONSORED ADR	500	73.24	36,620.00	
	ZAI LAB LTD-ADR	1,200	150.00	180,000.00	
	COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	20,476	3.72	76,273.10	
	CREDICORP LTD	1,044	119.15	124,392.60	
	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	41,932	16.03	672,169.96	
	TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	1,893	88.36	167,265.48	
	VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.25	27,760.11	
	360 DIGITECH INC	1,400	25.97	36,358.00	
	LUFAX HOLDING LTD	2,900	7.69	22,301.00	
	NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	41.53	20,765.00	
	UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,400	16.88	23,632.00	
	KE HOLDINGS INC	5,600	33.80	189,280.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.96	9,767.52	
	21VIANET GROUP INC-ADR	1,400	15.80	22,120.00	
	AGORA INC-ADR	800	26.01	20,808.00	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	13.17	19,755.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,400	64.67	90,538.00	
	GLOBANT SA	621	237.66	147,586.86	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	27.70	24,930.00	
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,900	8.95	17,005.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,200	8.51	61,272.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	800	59.07	47,256.00	
米ドル 小計		468,450		11,831,768.85 (1,307,883,728)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	240,900	16.30	3,926,670.00	

	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	49,400	94.87	4,686,578.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	277.26	512,931.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	53.21	755,582.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	62.99	466,126.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,700	221.39	1,483,313.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	361.29	1,094,708.70	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	150.41	413,627.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	39,400	55.46	2,185,124.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	70.19	154,418.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	83,200	64.86	5,396,352.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	121.00	931,700.00	
	BECLE SAB DE CV	5,300	51.22	271,466.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	105.72	818,801.40	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	30,800	166.46	5,126,968.00	
	GRUMA S.A.B.-B	2,855	214.21	611,569.55	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	44.79	1,195,893.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	24,500	32.82	804,090.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	41,000	127.32	5,220,120.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	30,800	19.56	602,448.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	537,500	15.87	8,530,125.00	
	TELESITES SAB DE CV	19,700	16.99	334,703.00	
メキシコペソ 小計		1,185,630		45,523,314.15 (250,692,338)	
ブラジルレアル	COSAN SA	16,900	27.00	456,300.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	58,500	27.40	1,602,900.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	74,700	26.74	1,997,478.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	18.36	190,944.00	
	BRADESPAR SA -PREF	3,300	76.34	251,922.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	58.93	170,897.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	45.74	452,826.00	
	GERDAU SA-PREF	18,400	30.74	565,616.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,200	25.65	261,630.00	
	SUZANO SA	11,907	56.36	671,078.52	
	VALE SA	61,700	114.12	7,041,204.00	
	WEG SA	26,600	34.80	925,680.00	

CCR SA	18,800	13.66	256,808.00	
LOCALIZA RENT A CAR	9,710	68.32	663,387.20	
RUMO SA	21,000	21.35	448,350.00	
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	52.49	141,723.00	
AMERICANAS SA	5,500	55.98	307,890.00	
LOJAS RENNER S.A.	13,000	43.31	563,030.00	
MAGAZINE LUIZA SA	46,300	22.60	1,046,380.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	18,700	28.60	534,820.00	
VIA VAREJO SA	21,100	14.09	297,299.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	19.71	157,680.00	
RAIA DROGASIL SA	17,600	26.55	467,280.00	
AMBEV SA	74,400	16.75	1,246,200.00	
BRF SA	9,900	25.63	253,737.00	
JBS SA	16,900	30.66	518,154.00	
NATURA &CO HOLDING SA	14,300	60.29	862,147.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	14.59	250,948.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	8,300	80.85	671,055.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	3,700	69.20	256,040.00	
HYPERA SA	6,400	36.27	232,128.00	
BANCO BRADESCO S.A.	23,432	20.69	484,808.08	
BANCO BRADESCO SA-PREF	76,379	23.95	1,829,277.05	
BANCO DO BRASIL S.A.	13,800	31.78	438,564.00	
BANCO INTER SA-UNITS	5,500	81.30	447,150.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,200	40.05	248,310.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	75,800	29.02	2,199,716.00	
ITAUSA SA	70,000	11.08	775,600.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	97,500	16.35	1,594,125.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,800	31.68	532,224.00	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	22.00	215,600.00	
TOTVS SA	7,200	37.54	270,288.00	
TELEFONICA BRASIL S.A.	7,600	40.97	311,372.00	
TIM SA	9,000	11.81	106,290.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	42.10	143,140.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	42.32	207,368.00	
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	15,742	12.16	191,422.72	

	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	6.05	66,550.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	35.74	178,700.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	26.15	60,145.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	44.33	88,660.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	39.00	88,725.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	15,100	24.45	369,195.00	
ブラジルレアル 小計		1,119,645		34,610,761.57 (735,530,599)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	6,329.00	36,043,655.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	1,605.00	23,790,915.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,233	36,048.00	80,495,184.00	
	FALABELLA SA	10,992	2,910.00	31,986,720.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,405.00	36,390,905.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	7,850.00	13,619,750.00	
	BANCO DE CHILE	766,095	68.41	52,408,558.95	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	945	30,050.00	28,397,250.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	35.45	34,093,115.80	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,219.60	6,348,018.00	
	COLBUN SA	161,671	109.99	17,782,193.29	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	105.80	40,582,446.60	
	ENEL CHILE SA	369,172	41.25	15,228,345.00	
チリペソ 小計		2,709,768		417,167,056.64 (60,455,015)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,551.00	181,182,224.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	28,270.00	131,087,990.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,902	28,300.00	223,626,600.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	18,480.00	47,826,240.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	22,600.00	150,131,800.00	
コロンビアペソ 小計		92,794		733,854,854.00 (20,898,718)	
ユーロ	OPAP SA	3,467	11.50	39,870.50	
	JUMBO SA	1,515	13.87	21,013.05	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	36,613	1.06	38,809.78	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	42,000	0.78	32,869.20	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	14.72	48,458.24	

ユーロ 小計		86,887		181,020.77 (23,539,940)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,150	15.20	78,280.00	
英ポンド 小計		5,150		78,280.00 (11,893,080)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	93.80	164,619.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	17.92	407,518.72	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	14.46	114,378.60	
	KOC HOLDING AS	14,295	19.73	282,040.35	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	7.45	126,650.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	169.90	185,530.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	61.10	505,663.60	
	AKBANK T.A.S.	43,035	5.16	222,060.60	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	8.27	262,332.67	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	5.11	127,949.29	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	15.25	291,137.75	
トルコリラ 小計		191,955		2,689,881.38 (34,808,678)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,233	773.00	953,109.00	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	85.65	603,404.25	
	CEZ AS	2,634	592.00	1,559,328.00	
チェココルナ 小計		10,912		3,115,841.25 (15,792,952)	
ハンガリーフォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,370.00	12,866,730.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	8,035.00	16,278,910.00	
	OTP BANK PLC	3,561	15,870.00	56,513,070.00	
ハンガリーフォリント 小計		11,016		85,658,710.00 (30,915,170)	
ポーランドズロチ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,822	69.40	334,646.80	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	26,615	6.16	164,001.63	
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,231	190.20	424,336.20	
	LPP SA	19	13,550.00	257,450.00	
	CD PROJEKT SA	1,166	186.28	217,202.48	
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	33.04	161,103.04	
	ALLEGRO.EU SA	5,718	73.15	418,271.70	

	DINO POLSKA SA	707	302.50	213,867.50	
	BANK PEKAO SA	2,676	91.88	245,870.88	
	PKO BANK POLSKI SA	12,623	37.17	469,196.91	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	243.80	131,164.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,703	36.92	358,234.76	
	ORANGE POLSKA SA	11,699	7.67	89,731.33	
	PGE SA	9,929	9.08	90,195.03	
ポーランドズロチ 小計		93,322		3,575,272.66 (101,512,716)	
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	114,400	38.45	4,398,680.00	
	ALROSA PJSC	32,550	129.40	4,211,970.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	24,440	170.08	4,156,755.20	
	INTER RAO UES PJSC	423,000	4.39	1,856,970.00	
ロシアルーブル 小計		594,390		14,624,375.20 (21,936,562)	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	6.03	168,840.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	380,000	3.65	1,387,000.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	53,500	15.14	809,990.00	
	PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT	15,000	1.59	23,850.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	304,000	3.29	1,000,160.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-H	26,000	12.24	318,240.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	4.84	319,440.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	19,500	39.55	771,225.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	34,500	10.36	357,420.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	5.72	274,560.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	62,000	9.40	582,800.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	6.93	249,480.00	
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,000	161.80	647,200.00	
	JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	15.84	285,120.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	6.05	133,100.00	
	MMG LTD	40,000	3.86	154,400.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	26,000	10.56	274,560.00	
	SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	12.92	122,740.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	7.12	92,560.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	90,000	10.58	952,200.00	

AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	5.45	239,800.00	
BOC AVIATION LTD	3,500	61.00	213,500.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.53	98,840.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	25,500	31.10	793,050.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	17,000	16.40	278,800.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	3.81	247,650.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	5.15	154,500.00	
CITIC LTD	92,000	8.00	736,000.00	
FOSUN INTERNATIONAL LTD	40,000	11.62	464,800.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	27.80	278,000.00	
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	8.05	152,950.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	14.00	161,000.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	31,000	18.04	559,240.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	12.04	154,112.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	8,700	56.20	488,940.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	7.20	141,120.00	
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	36.30	326,700.00	
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	59,000	4.23	249,570.00	
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	18.20	218,400.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	23,000	71.40	1,642,200.00	
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	8.94	178,800.00	
AIR CHINA LTD-H	30,000	5.27	158,100.00	
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.82	144,600.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	11.44	274,560.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.45	115,700.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	50,700	12.58	637,806.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	5.95	190,400.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.69	173,800.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	10.48	204,360.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.74	121,320.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	12,000	227.20	2,726,400.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	6.89	303,160.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,600	52.50	504,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	92,000	23.70	2,180,400.00	

GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	48,500	34.20	1,658,700.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	46,000	7.06	324,760.00	
MINTH GROUP LTD	12,000	31.90	382,800.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	15.00	300,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	17,000	169.80	2,886,600.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	4.76	257,040.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	31,000	28.40	880,400.00	
LI NING CO LTD	35,000	83.85	2,934,750.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	12,900	168.40	2,172,360.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	9.15	54,900.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	15.32	199,160.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	5.73	137,520.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	17,000	41.65	708,050.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	12,000	29.70	356,400.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	1.04	208,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	6,200	78.75	488,250.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	4,300	129.50	556,850.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	89,500	531.00	47,524,500.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	235,440	205.20	48,312,288.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	45.20	361,600.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	0.95	132,050.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	44,000	3.73	164,120.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	4,550	101.00	459,550.00	
MEITUAN	56,100	273.20	15,326,520.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	18.26	262,944.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	11.06	265,440.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	9,000	72.85	655,650.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	5.18	163,170.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	108.94	119,834.00	
CHINA FEIHE LTD	56,000	16.58	928,480.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	49,000	43.95	2,153,550.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	22,000	65.05	1,431,100.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.37	133,285.00	
NONGFU SPRING CO LTD-H	6,400	42.20	270,080.00	
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	19,000	41.10	780,900.00	

TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	32,000	14.78	472,960.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	70.80	566,400.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	7.94	166,740.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.42	390,240.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	7,000	51.60	361,200.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	10,500	48.20	506,100.00	
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	20.60	123,600.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	64,000	14.04	898,560.00	
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	15.36	307,200.00	
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	10,000	61.15	611,500.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	71.70	516,240.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40,000	15.04	601,600.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	16.54	186,902.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	21,600	22.00	475,200.00	
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	57.75	202,125.00	
3SBIO INC	20,500	7.84	160,720.00	
AKESO INC	5,000	52.95	264,750.00	
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,200	290.40	348,480.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	22,000	17.96	395,120.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	25,500	4.55	116,025.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	46,000	4.80	220,800.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	140,000	10.78	1,509,200.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	36.35	654,300.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	166.50	316,350.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	29.15	524,700.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	18,000	84.10	1,513,800.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	167.10	350,910.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	8,000	68.00	544,000.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	162,250	6.99	1,134,127.50	
SSY GROUP LTD	22,000	5.53	121,660.00	
WUXI APPTEC CO LTD-H	5,368	176.40	946,915.20	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	52,500	129.70	6,809,250.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	2.62	1,006,080.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,236,000	2.71	3,349,560.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	137,000	4.55	623,350.00	

CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	2.85	112,575.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	140,000	3.60	504,000.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,495,000	5.46	8,162,700.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.77	130,190.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	60,500	62.80	3,799,400.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	3.51	263,601.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	3.00	54,000.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	878,000	4.42	3,880,760.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.09	636,250.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	149,000	1.39	207,110.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	9.00	126,000.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.32	241,920.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.02	105,060.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	23,200	20.60	477,920.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	36,500	18.08	659,920.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.32	241,280.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	10.74	167,544.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	6.90	300,840.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	10.90	281,220.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	116,000	13.56	1,572,960.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	41,400	23.50	972,900.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	11.88	289,872.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	14,100	23.05	325,005.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.52	317,520.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	104,000	6.67	693,680.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	98,500	71.30	7,023,050.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,900	47.75	377,225.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	9.64	173,520.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	20,000	5.74	114,800.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	7.26	174,240.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	2.49	239,040.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	60,500	18.42	1,114,410.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	8.10	162,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	50,000	31.45	1,572,500.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	5,800	46.55	269,990.00	

CHINA VANKE CO LTD-H	27,100	22.60	612,460.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	54,000	5.23	282,420.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	122,000	8.25	1,006,500.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	10.56	158,400.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	8.13	214,632.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	10,700	33.30	356,310.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	2.36	87,320.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	9.95	213,925.00	
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	9.77	224,710.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	28,500	43.25	1,232,625.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	2,400	50.05	120,120.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	6.02	150,500.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	6.77	243,720.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.25	117,000.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	17.40	348,000.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	22.15	221,500.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	23.65	946,000.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	11,000	22.50	247,500.00	
WHARF HOLDINGS LTD	22,000	28.10	618,200.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	20,800	7.81	162,448.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	22,000	4.38	96,360.00	
CHINA YOUZAN LTD	220,000	1.12	246,400.00	
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	41,000	25.70	1,053,700.00	
KINGSOFT CORP LTD	15,200	37.40	568,480.00	
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	6,000	34.65	207,900.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	13.54	176,020.00	
WEIMOB INC	27,000	10.86	293,220.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	11,500	48.05	552,575.00	
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10,500	41.20	432,600.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	10,500	41.25	433,125.00	
KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	15.76	260,040.00	
LENOVO GROUP LTD	114,000	7.88	898,320.00	
SUNNY OPTICAL TECH	11,100	226.40	2,513,040.00	
XIAOMI CORP-CLASS B	223,400	26.35	5,886,590.00	
ZTE CORP-H	12,200	25.80	314,760.00	

	CHINA TOWER CORP LTD-H	656,000	1.05	688,800.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	25.25	214,625.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	2.95	224,200.00	
	CGN POWER CO LTD-H	171,000	1.71	292,410.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	48,600	23.70	1,151,820.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	53,000	13.06	692,180.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	1.83	107,970.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	14,000	47.95	671,300.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	32,000	11.48	367,360.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,400	164.80	2,043,520.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	48,000	11.10	532,800.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	2.72	141,440.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	64,000	6.70	428,800.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	36.45	255,150.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	8,000	40.05	320,400.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	76,000	15.72	1,194,720.00	
香港ドル 小計		13,319,408		252,503,845.70 (3,593,129,724)	
マレーシアリンギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.87	200,326.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	18.76	110,684.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	40,000	8.05	322,000.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	49,400	4.83	238,602.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	7.88	59,888.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.18	72,158.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.75	74,175.00	
	MISC BHD	17,600	6.86	120,736.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	4.24	83,104.00	
	GENTING BHD	32,900	4.78	157,262.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.79	155,403.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	26.18	54,978.00	
	IOI CORP BHD	32,500	3.71	120,575.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	19.66	125,824.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	133.30	133,300.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	18.36	204,163.20	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.63	96,554.50	

	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	3.65	110,960.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	7.70	182,490.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.81	184,758.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	3.49	57,934.00	
	SUPERMAX CORP BHD	19,217	3.67	70,526.39	
	TOP GLOVE CORP BHD	79,500	4.14	329,130.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	2.90	67,860.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	95,200	4.51	429,352.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.40	185,840.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	17.74	31,932.00	
	MALAYAN BANKING BHD	64,500	8.03	517,935.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	231,100	4.02	929,022.00	
	RHB BANK BHD	28,700	5.18	148,666.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.87	184,986.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	4.19	221,651.00	
	MAXIS BHD	30,200	4.39	132,578.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	6.01	110,584.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	15.62	218,680.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	38,200	9.73	371,686.00	
マレーシアリンギット 小計		1,272,287		6,816,303.09 (178,204,064)	
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	108.00	2,559,600.00	
	PTT PCL-NVDR	161,800	35.75	5,784,350.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	13,200	47.00	620,400.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	26,800	38.75	1,038,500.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	57.00	1,869,600.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	20,500	63.75	1,306,875.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	12,700	412.00	5,232,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	70,100	58.25	4,083,325.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	7.85	702,575.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	8.85	933,675.00	
	ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	3.82	237,604.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	29.00	1,409,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	31.50	1,046,587.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	13.70	1,206,970.00	

	PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	28.50	1,553,250.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	33.50	552,750.00	
	CP ALL PCL-NVDR	94,900	60.25	5,717,725.00	
	CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	151.50	742,350.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	26.75	1,516,725.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	37.00	721,500.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	22.40	1,088,640.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	159,100	22.70	3,611,570.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	121.50	729,000.00	
	SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	38.00	509,200.00	
	BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	104.50	815,100.00	
	KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.50	262,500.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	95.00	1,463,000.00	
	BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	17.50	320,250.00	
	KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	64.50	948,150.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	63.25	480,700.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	68.25	614,250.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	48.75	1,433,250.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	8.00	1,249,600.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,200	576.00	2,995,200.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	19,700	176.50	3,477,050.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	28,600	64.50	1,844,700.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.08	262,108.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	40.75	387,125.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	171.50	686,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	23,900	58.50	1,398,150.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	78.75	1,047,375.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	46,700	33.50	1,564,450.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	44.25	495,600.00	
タイバーツ 小計		1,793,425		66,519,129.50 (223,504,275)	
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	39.70	927,392.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	732.50	3,479,375.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	573.00	893,880.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	59.50	3,063,714.50	

	SM INVESTMENTS CORP	4,030	966.00	3,892,980.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	17,520	161.00	2,820,720.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	198.00	1,376,100.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,570	137.00	1,859,090.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	86.50	2,284,465.00	
	BDO UNIBANK INC	28,100	105.60	2,967,360.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	44.50	1,228,734.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.55	514,750.00	
	AYALA LAND INC	134,900	33.15	4,471,935.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	148,800	33.45	4,977,360.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	1,930.00	868,500.00	
	PLDT INC	980	1,265.00	1,239,700.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	269.00	844,660.00	
フィリピンペソ 小計		638,623		37,710,715.50 (82,820,273)	
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,305.00	196,924,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	19,750.00	436,475,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	111,500	2,620.00	292,130,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	810.00	305,775,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,675.00	413,682,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	10,275.00	238,380,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,930.00	470,265,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	8,700.00	481,110,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	293,800	4,950.00	1,454,310,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESI PT	108,300	6,225.00	674,167,500.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	36,050.00	237,930,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	8,650.00	282,855,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,475.00	525,770,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	4,800.00	483,360,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,345.00	466,042,500.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	174,900	30,175.00	5,277,607,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	303,200	5,975.00	1,811,620,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	5,075.00	535,412,500.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	882,300	3,870.00	3,414,501,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,330.00	461,909,000.00	

	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	792,800	3,170.00	2,513,176,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	3,180.00	448,062,000.00	
インドネシアルピア 小計		4,671,600		21,421,465,000.00 (164,945,280)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	43,750.00	37,100,000.00	
	S-OIL CORP	662	96,300.00	63,750,600.00	
	SK INNOVATION CO LTD	811	263,000.00	213,293,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,981	43,200.00	85,579,200.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,255	52,500.00	65,887,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	121	539,000.00	65,219,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	216,500.00	66,465,500.00	
	LG CHEM LTD	719	828,000.00	595,332,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	380,000.00	50,540,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	239	269,500.00	64,410,500.00	
	POSCO	1,166	353,500.00	412,181,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	448	158,000.00	70,784,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	251,000.00	27,610,000.00	
	SKC CO LTD	311	159,500.00	49,604,500.00	
	CJ CORP	193	101,000.00	19,493,000.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	33,400.00	17,167,600.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	883	47,100.00	41,589,300.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	4,146	23,400.00	97,016,400.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	44,200.00	37,083,800.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,161	55,300.00	64,203,300.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	69,700.00	56,666,100.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	34,150.00	34,150,000.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	132,000.00	73,524,000.00	
	LG CORP	1,396	97,800.00	136,528,800.00	
	SAMSUNG C&T CORP	1,346	137,500.00	185,075,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	23,650.00	56,878,250.00	
	SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	6,540.00	45,171,780.00	
	SK	511	275,500.00	140,780,500.00	
	S-1 CORPORATION	228	82,800.00	18,878,400.00	
	CJ LOGISTICS	135	183,000.00	24,705,000.00	
	HMM CO LTD	4,121	41,900.00	172,669,900.00	

HYUNDAI GLOVIS CO LTD	314	200,000.00	62,800,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,155	30,300.00	65,296,500.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	7,580.00	24,839,660.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	49,750.00	48,058,500.00	
HANON SYSTEMS	2,393	16,000.00	38,288,000.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,051	279,500.00	293,754,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,179	225,500.00	491,364,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	108,000.00	65,880,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	110,000.00	36,960,000.00	
KIA CORP	4,149	86,400.00	358,473,600.00	
COWAY CO LTD	831	87,600.00	72,795,600.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	52,200.00	34,138,800.00	
HLB INC	1,142	34,500.00	39,399,000.00	
LG ELECTRONICS INC	1,690	166,500.00	281,385,000.00	
KANGWON LAND INC	1,387	26,100.00	36,200,700.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	25,100.00	26,355,000.00	
HYBE CO LTD	230	303,000.00	69,690,000.00	
KAKAO CORP	4,858	149,500.00	726,271,000.00	
NAVER CORP	1,928	452,000.00	871,456,000.00	
NCSOFT CORP	263	812,000.00	213,556,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	143,000.00	38,753,000.00	
PEARL ABYSS CORP	350	79,400.00	27,790,000.00	
CJ ENM CO LTD	195	173,000.00	33,735,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	407	94,300.00	38,380,100.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	110,500.00	24,531,000.00	
SHINSEGAE INC	109	274,000.00	29,866,000.00	
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	168,500.00	23,253,000.00	
E-MART INC	257	158,500.00	40,734,500.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	123	470,000.00	57,810,000.00	
KT&G CORP	1,875	82,900.00	155,437,500.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	118,500.00	48,822,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	526	234,500.00	123,347,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	60,000.00	25,740,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	149	1,527,000.00	227,523,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	714,000.00	22,134,000.00	

CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,232	116,100.00	143,035,200.00	
ALTEOGEN INC	360	86,200.00	31,032,000.00	
CELLTRION INC	1,516	268,500.00	407,046,000.00	
CELLTRION PHARM INC	238	148,000.00	35,224,000.00	
GREEN CROSS CORP	90	318,000.00	28,620,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	331,500.00	28,840,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	263	893,000.00	234,859,000.00	
SEEGENE INC	480	76,000.00	36,480,000.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	63,700.00	25,480,000.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	387	122,000.00	47,214,000.00	
YUHAN CORP	839	61,600.00	51,682,400.00	
HANA FINANCIAL GROUP	4,768	44,100.00	210,268,800.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	10,250.00	45,663,750.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	6,224	52,200.00	324,892,800.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	6,937	38,350.00	266,033,950.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	11,200.00	83,025,600.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	715	112,000.00	80,080,000.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	4,910.00	29,852,800.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,302	9,150.00	39,363,300.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	13,000.00	20,020,000.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	44,550.00	36,709,200.00	
DB INSURANCE CO LTD	726	56,000.00	40,656,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	503	217,500.00	109,402,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	76,800.00	74,188,800.00	
DOUZONE BIZON CO LTD	357	88,400.00	31,558,800.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	567	185,000.00	104,895,000.00	
KMW CO LTD	357	55,200.00	19,706,400.00	
LG DISPLAY CO LTD	3,338	22,700.00	75,772,600.00	
LG INNOTEK CO LTD	243	233,000.00	56,619,000.00	
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	899	183,500.00	164,966,500.00	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	74,262	79,300.00	5,888,976,600.00	
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	12,856	73,100.00	939,773,600.00	
SAMSUNG SDI CO LTD	862	751,000.00	647,362,000.00	
LG UPLUS CORP	3,613	14,950.00	54,014,350.00	
SK TELECOM	628	305,000.00	191,540,000.00	

	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,249	25,150.00	106,862,350.00	
	SK HYNIX INC	8,517	118,500.00	1,009,264,500.00	
韓国ウォン 小計		235,316		19,585,138,690.00 (1,878,214,800)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	100.50	1,909,500.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	52.80	1,636,800.00	
	CHINA STEEL CORP	186,000	36.30	6,751,800.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	56,000	84.20	4,715,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	60,000	101.50	6,090,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	81,000	88.00	7,128,000.00	
	TAIWAN CEMENT	78,477	53.00	4,159,281.00	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,100	1,020.00	2,142,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	32.75	1,277,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	4,174	381.50	1,592,381.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	37,550	154.00	5,782,700.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	30.90	679,800.00	
	WAN HAI LINES LTD	8,000	240.00	1,920,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	28,000	145.50	4,074,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	44.45	1,333,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,020	606.00	1,830,120.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	224.50	1,364,960.00	
	GIANT MANUFACTURING	4,000	302.00	1,208,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	446.00	892,000.00	
	POU CHEN	34,000	35.80	1,217,200.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	604.00	3,020,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	9,000	265.00	2,385,000.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	77,000	73.20	5,636,400.00	
	ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	196.00	588,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	16.70	1,195,987.20	
	CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	292,000	23.00	6,716,000.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	179,906	26.60	4,785,499.60	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	163,627	23.00	3,763,421.00	
	HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	135,416	19.45	2,633,841.20	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	172,000	33.10	5,693,200.00	
	SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	14.25	2,066,178.75	

TAISHIN FINANCIAL HOLDING	140,769	17.15	2,414,188.35	
TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.59	764,054.48	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	149,374	21.95	3,278,759.30	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	58,000	45.10	2,615,800.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	19,997	222.50	4,449,332.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	156,920	25.70	4,032,844.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	125,000	60.30	7,537,500.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	218,000	14.40	3,139,200.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	27.25	760,247.75	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	105,000	85.00	8,925,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	9.90	1,532,866.50	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	66.40	629,472.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	8,000	337.50	2,700,000.00	
ACER INC	38,000	27.10	1,029,800.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	367.00	1,944,733.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	11,000	354.50	3,899,500.00	
AU OPTRONICS CORP	122,000	20.70	2,525,400.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	11,000	187.00	2,057,000.00	
COMPAL ELECTRONICS	63,000	21.90	1,379,700.00	
DELTA ELECTRONICS INC	31,000	304.00	9,424,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	62.60	876,400.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	194,800	110.50	21,525,400.00	
INNOLUX CORP	126,000	19.45	2,450,700.00	
INVENTEC CORP	41,000	23.65	969,650.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,600	3,020.00	4,832,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	35,000	57.90	2,026,500.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	143.00	1,430,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	3,000	391.50	1,174,500.00	
PEGATRON CORP	33,000	66.80	2,204,400.00	
QUANTA COMPUTER INC	43,000	89.40	3,844,200.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	52.90	899,300.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	139.50	2,371,500.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	209.00	1,045,000.00	
WISTRON CORP	40,951	28.10	1,150,723.10	
WIWYNN CORP	1,000	945.00	945,000.00	

	WPG HOLDINGS LTD	26,960	55.00	1,482,800.00	
	YAGEO CORPORATION	6,198	589.00	3,650,622.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	10,000	103.50	1,035,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	60,000	115.00	6,900,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	61.60	1,478,400.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	27,000	104.00	2,808,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	52,000	115.00	5,980,000.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,880.00	940,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	867.00	2,601,000.00	
	MEDIATEK INC	23,500	933.00	21,925,500.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	73.40	1,247,800.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	9,000	489.00	4,401,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	474.00	948,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	110.50	1,105,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	7,000	560.00	3,920,000.00	
	SILERGY CORP	1,250	3,880.00	4,850,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	382,700	585.00	223,879,500.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	185,000	52.70	9,749,500.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	114.00	1,368,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	370.00	2,220,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	33.55	1,409,100.00	
新台湾ドル 小計		5,008,665		512,871,912.73 (2,020,715,336)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	13,868	461.35	6,398,001.80	
	COAL INDIA LTD	25,983	144.10	3,744,150.30	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	277.40	2,250,268.80	
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	106.00	2,594,244.00	
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	37,490	115.30	4,322,597.00	
	PETRONET LNG LTD	12,992	219.65	2,853,692.80	
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	44,465	2,105.70	93,629,950.50	
	ACC LTD	1,105	2,337.55	2,582,992.75	
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,501	402.30	4,626,852.30	
	ASIAN PAINTS LTD	6,046	3,083.75	18,644,352.50	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	854.25	3,481,923.00	
	GRASIM INDUSTRIES LTD	4,259	1,549.50	6,599,320.50	

HINDALCO INDUSTRIES LTD	25,088	391.75	9,828,224.00	
JSW STEEL LTD	12,106	717.55	8,686,660.30	
PI INDUSTRIES LTD	1,184	3,026.00	3,582,784.00	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	2,306.60	4,910,751.40	
SHREE CEMENT LTD	150	27,986.40	4,197,960.00	
TATA STEEL LTD	9,239	1,281.40	11,838,854.60	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,607	7,490.30	12,036,912.10	
UPL LTD	7,039	819.70	5,769,868.30	
VEDANTA LTD	18,209	267.80	4,876,370.20	
ADANI ENTERPRISES LTD	4,200	1,401.65	5,886,930.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	19,000	182.65	3,470,350.00	
HAVELLS INDIA LTD	2,780	1,143.75	3,179,625.00	
LARSEN & TOUBRO LTD	10,871	1,611.75	17,521,334.25	
SIEMENS LTD	766	1,975.10	1,512,926.60	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	8,215	680.05	5,586,610.75	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	663.50	2,725,658.00	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,727.10	2,243,502.90	
BAJAJ AUTO LTD	1,141	3,841.90	4,383,607.90	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	2,333.05	2,834,655.75	
BHARAT FORGE LTD	3,030	788.90	2,390,367.00	
EICHER MOTORS LTD	2,214	2,549.65	5,644,925.10	
HERO MOTOCORP LTD	1,947	2,835.00	5,519,745.00	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	13,839	764.20	10,575,763.80	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,145	7,293.85	15,645,308.25	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	18,232	235.95	4,301,840.40	
MRF LTD	27	81,174.85	2,191,720.95	
TATA MOTORS LTD	26,597	295.55	7,860,743.35	
PAGE INDUSTRIES LTD	97	33,376.95	3,237,564.15	
TITAN CO LTD	5,705	1,700.95	9,703,919.75	
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	3,569.35	4,001,241.35	
INFO EDGE INDIA LTD	1,257	5,142.55	6,464,185.35	
TRENT LTD	2,541	891.15	2,264,412.15	
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,611	3,413.20	8,911,865.20	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,600	3,439.80	5,503,680.00	
ITC LTD	47,218	212.40	10,029,103.20	

NESTLE INDIA LTD	540	18,143.95	9,797,733.00	
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	9,657	775.15	7,485,623.55	
UNITED SPIRITS LTD	4,926	683.45	3,366,674.70	
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,795.05	3,024,659.25	
DABUR INDIA LTD	9,014	590.15	5,319,612.10	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	980.15	5,273,207.00	
HINDUSTAN UNILEVER LTD	12,917	2,358.10	30,459,577.70	
MARICO LTD	7,098	533.95	3,789,977.10	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,657	3,918.90	6,493,617.30	
AUROBINDO PHARMA LTD	4,816	963.70	4,641,179.20	
BIOCON LTD	5,970	398.15	2,376,955.50	
CIPLA LTD	7,779	948.00	7,374,492.00	
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,117	4,824.75	10,213,995.75	
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,854	5,422.15	10,052,666.10	
IPCA LABORATORIES LTD	1,001	2,203.65	2,205,853.65	
LUPIN LTD	3,463	1,181.20	4,090,495.60	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	13,422	694.00	9,314,868.00	
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	3,043.20	2,653,670.40	
AXIS BANK LTD	35,514	755.40	26,827,275.60	
BANDHAN BANK LTD	9,895	305.05	3,018,469.75	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	26,702	2,482.50	66,287,715.00	
ICICI BANK LTD	79,821	676.65	54,010,879.65	
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	8,749	1,722.95	15,074,089.55	
STATE BANK OF INDIA	28,263	428.90	12,122,000.70	
YES BANK LTD	141,484	13.05	1,846,366.20	
BAJAJ FINANCE LTD	4,258	6,180.90	26,318,272.20	
BAJAJ FINSERV LTD	619	13,201.20	8,171,542.80	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,200	499.05	3,094,110.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,899.60	2,058,716.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,567.05	2,842,628.70	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,715	2,255.05	3,867,410.75	
REC LTD	14,000	152.90	2,140,600.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	3,000	956.90	2,870,700.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,385.60	3,792,387.20	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	12,966	665.35	8,626,928.10	

	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	3,638	1,484.80	5,401,702.40	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	645.05	3,890,296.55	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,379	1,050.45	6,700,820.55	
	DLF LTD	9,206	334.15	3,076,184.90	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	17,122	994.00	17,019,268.00	
	INFOSYS LTD	53,107	1,590.45	84,464,028.15	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	4,361.20	3,262,177.60	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	14,446	3,212.85	46,412,831.10	
	TECH MAHINDRA LTD	10,014	1,131.00	11,325,834.00	
	WIPRO LTD	21,755	599.15	13,034,508.25	
	BHARTI AIRTEL LTD	38,516	548.30	21,118,322.80	
	INDUS TOWERS LTD	8,128	220.50	1,792,224.00	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	5,571	980.25	5,460,972.75	
	ADANI TOTAL GAS LTD	4,100	880.60	3,610,460.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	4,100	963.60	3,950,760.00	
	GAIL INDIA LTD	24,471	142.40	3,484,670.40	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	538.15	2,537,915.40	
	NTPC LTD	78,280	118.50	9,276,180.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	38,088	233.00	8,874,504.00	
インドルピー 小計		1,275,929		996,646,928.25 (1,485,003,923)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	17.65	112,960.00	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.03	112,449.78	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	1.88	142,564.16	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	13.25	316,847.25	
	COMMERCIAL BANK PQSC	33,159	5.44	180,617.07	
	MASRAF AL RAYAN	59,948	4.44	266,408.91	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	9.35	87,684.30	
	QATAR ISLAMIC BANK	18,726	17.20	322,087.20	
	QATAR NATIONAL BANK	71,025	18.00	1,278,450.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.09	76,564.08	
	OOREDOO QPSC	12,412	7.28	90,433.83	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	17.22	139,447.56	
カタールリアル 小計		380,672		3,126,514.14 (94,139,340)	

南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	174.75	735,173.25	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	276.36	452,401.32	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	852	1,712.00	1,458,624.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	6,642	283.50	1,883,007.00	
	GOLD FIELDS LTD	14,144	134.90	1,908,025.60	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	58.04	400,185.80	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	12,499	238.82	2,985,011.18	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	702.46	749,524.82	
	NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	220.75	1,099,335.00	
	SASOL LTD	8,982	218.40	1,961,668.80	
	SIBANYE STILLWATER LTD	44,383	60.24	2,673,631.92	
	BIDVEST GROUP LTD	4,193	193.87	812,896.91	
	MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	120.66	736,991.28	
	MR PRICE GROUP LTD	3,738	211.04	788,867.52	
	NASPERS LTD-N SHS	6,784	2,960.53	20,084,235.52	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	16,364	54.36	889,547.04	
	BID CORP LTD	5,393	317.03	1,709,742.79	
	CLICKS GROUP LTD	3,433	263.74	905,419.42	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	8,180	157.18	1,285,732.40	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	179.44	455,957.04	
	TIGER BRANDS LTD	2,099	203.00	426,097.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	6,295	172.56	1,086,265.20	
	ABSA GROUP LTD	11,483	134.00	1,538,722.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,171	1,598.97	1,872,393.87	
	NEDBANK GROUP LTD	5,252	165.16	867,420.32	
	STANDARD BANK GROUP LTD	20,435	122.49	2,503,083.15	
	FIRSTRAND LTD	79,568	53.75	4,276,780.00	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,213	289.40	640,442.20	
	REMGRO LTD	8,773	109.98	964,854.54	
	DISCOVERY LTD	7,125	120.81	860,771.25	
	OLD MUTUAL LTD	76,960	12.90	992,784.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	31.60	316,442.40	
	SANLAM LTD	30,241	58.53	1,770,005.73	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	100.49	599,824.81	
	MTN GROUP LTD	26,706	107.13	2,861,013.78	

	VODACOM GROUP LTD	9,434	131.28	1,238,495.52	
南アフリカランド 小計		466,760		66,791,374.38 (496,927,825)	
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	36,436	4.33	157,767.88	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,749	6.82	305,188.18	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	5.47	111,440.31	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	4.77	97,498.80	
	EMIRATES NBD PJSC	40,014	13.50	540,189.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	68,484	16.32	1,117,658.88	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	63,815	3.84	245,049.60	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	3.99	196,200.27	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	27,455	22.46	616,639.30	
アラブディルハム 小計		370,939		3,387,632.22 (102,103,235)	
クウェートディナール	AGILITY	18,700	0.94	17,596.70	
	BOUBYAN BANK K.S.C	14,451	0.74	10,780.44	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	73,529	0.77	56,617.33	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	107,400	0.86	93,115.80	
	MABANEE CO KPSC	7,811	0.71	5,592.67	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,345	0.58	20,782.86	
クウェートディナール 小計		257,236		204,485.80 (75,271,222)	
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,400	4.04	9,696.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.06	131,950.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	17.77	97,735.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.53	18,802.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	3.67	4,037.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.23	2,115.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.71	102,207.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	11.26	106,970.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	520	8.20	4,264.00	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	12.70	3,810.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	9.02	33,374.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	43.26	38,934.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	17.10	16,946.10	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	6.28	79,756.00	

ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	38.79	151,281.00	
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	51.55	25,775.00	
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	8.09	152,901.00	
BBMG CORPORATION-A	900	2.62	2,358.00	
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	15.16	36,384.00	
CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	15.97	52,924.58	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	7.06	121,432.00	
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	39.40	137,900.00	
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	18.19	34,561.00	
GEM CO LTD-A	3,500	12.63	44,205.00	
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	31.59	15,795.00	
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	104.90	124,831.00	
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	28.98	165,765.60	
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	12.98	25,311.00	
HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.69	4,035.00	
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	13.70	63,020.00	
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	16.30	17,930.00	
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	7.62	26,670.00	
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.69	119,167.00	
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.19	18,165.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	27.70	88,640.00	
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	7.64	14,516.00	
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	119.11	35,733.00	
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	91.86	45,930.00	
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	25.87	51,740.00	
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	189.06	207,966.00	
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	19.95	63,840.00	
LB GROUP CO LTD-A	1,700	30.78	52,326.00	
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	21.91	41,629.00	
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	16.38	99,918.00	
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	2.80	20,160.00	
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	20.27	203,713.50	
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	17.59	61,002.12	
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	34.01	61,898.20	
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	5.19	51,900.00	

SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	47.10	37,680.00	
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.80	25,960.00	
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	139.12	100,166.40	
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	10.19	48,912.00	
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	25.09	42,653.00	
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	114.21	68,526.00	
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	26.70	58,740.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.41	2,046.00	
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	159.20	89,152.00	
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	12.40	13,640.00	
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	28.11	42,165.00	
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	3.65	5,475.00	
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	7.94	10,322.00	
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,000	118.90	356,700.00	
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	68.34	27,336.00	
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	31.13	37,356.00	
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.99	23,776.20	
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	14.00	43,400.00	
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	900	260.18	234,162.00	
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	138.30	160,428.00	
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	12.02	27,646.00	
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	12.98	41,536.00	
ZHEJIANG SATELLITE PETROCH-A	1,680	38.10	64,008.00	
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4,700	8.68	40,796.00	
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	10.13	179,301.00	
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	21.58	21,580.00	
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	60.70	151,750.00	
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	10.16	30,480.00	
AVIC SHENYANG AIRCRAFT CO -A	1,540	73.77	113,605.80	
AVIC XI'AN AIRCRAFT INDUST-A	2,500	28.12	70,300.00	
AVICOPTER PLC-A	500	53.12	26,560.00	
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	39.45	55,230.00	
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	100.65	40,260.00	
CHINA AEROSPACE TIMES ELEC-A	2,300	7.34	16,882.00	
CHINA AVIONICS SYSTEMS CO -A	100	16.47	1,647.00	

CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	15.64	68,816.00	
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	9.63	4,815.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.38	115,132.00	
CHINA SHIPBUILDING INDUSTR-A	25,300	4.06	102,718.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	4.68	139,464.00	
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,200	547.01	1,203,422.00	
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	11.41	6,846.00	
EVE ENERGY CO LTD-A	1,820	125.23	227,918.60	
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	8.66	3,611.22	
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	59.87	59,870.00	
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	225.00	90,000.00	
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	36.21	72,420.00	
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	51.05	30,630.00	
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	63.23	18,969.00	
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	105.25	109,039.00	
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	8.26	21,476.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.94	85,892.00	
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,000	19.20	76,800.00	
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	4,246	27.50	116,765.00	
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	23,000	4.34	99,820.00	
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	27.90	55,800.00	
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	8,200	27.37	224,434.00	
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.70	15,120.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.00	41,600.00	
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	80.77	218,079.00	
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	9,000	6.31	56,790.00	
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	137.20	205,800.00	
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	31.23	40,599.00	
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	7.17	2,868.00	
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	569.99	91,198.40	
TBEA CO LTD-A	2,100	15.49	32,529.00	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	19.17	17,253.00	
WEICHAI POWER CO LTD-A	5,900	18.45	108,855.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	250.30	125,150.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	6.28	48,356.00	

XIAMEN C & D INC-A	300	7.48	2,244.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	13.36	45,424.00	
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	39.07	38,288.60	
YUTONG BUS CO LTD-A	200	12.01	2,402.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	5.58	29,574.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	35.77	71,540.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	66.30	27,846.00	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	108.00	86,400.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	21.27	63,597.30	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	19.59	25,467.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	21.22	84,880.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	8.17	52,288.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.11	18,486.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	73.26	58,608.00	
AIR CHINA LTD-A	6,400	7.23	46,272.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	40,800	5.16	210,528.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.90	52,920.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.86	53,326.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	19.59	252,123.30	
S F HOLDING CO LTD-A	4,300	61.65	265,095.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	43.13	43,130.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.20	46,280.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	5.17	10,340.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	900	53.80	48,420.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	9.46	37,840.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	13.92	16,286.40	
BYD CO LTD -A	1,600	258.68	413,888.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	219.08	43,816.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	19.48	117,269.60	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	10.98	35,136.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	49.18	93,442.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	1,600	54.95	87,920.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	21.85	65,550.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	21.49	47,278.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	27.30	32,760.00	

NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	31.70	25,360.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	20.70	143,037.00	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	9.11	28,241.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	38.33	49,829.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	21.02	2,102.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	190.21	114,126.00	
GUANGDONG XINBAO ELECTRICA-A	800	21.80	17,440.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	26.24	149,568.00	
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	30.20	33,220.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	42.63	42,630.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	112.87	56,435.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	70.70	56,560.00	
JOYOUNG CO LTD -A	600	25.06	15,036.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	3,200	66.96	214,272.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	13.03	11,727.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	142.00	76,680.00	
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	6.31	28,395.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	20.87	8,348.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	7.71	108,711.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	39.50	20,145.00	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	10.10	4,040.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	55.40	16,620.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	14.96	14,960.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	47.64	28,584.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	7.15	59,345.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	15.77	17,031.60	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	9.86	12,818.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	8.52	1,704.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	7.99	96,679.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	487.61	48,761.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	11.95	2,390.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	17.15	13,720.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	2.48	10,168.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	57.67	75,547.70	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	11.09	12,199.00	

PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	18.88	25,488.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	21.91	19,719.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	5.97	17,910.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,900	277.68	527,592.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	20.44	4,088.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	10.87	54,350.00	
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	5.91	53,781.00	
WANGFUJING GROUP CO LTD-A	800	28.04	22,432.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	6.19	37,140.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	42.69	30,736.80	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	48.61	13,610.80	
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	1,700	16.46	27,982.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	49.41	26,977.86	
YIXINTANG PHARMACEUTICAL G-A	600	30.34	18,204.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	4.17	12,927.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	50.35	35,245.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	221.00	66,300.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	66.30	33,150.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	7.27	3,635.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	35.27	21,162.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.73	16,152.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	37.83	15,132.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	193.91	77,564.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	31.80	22,260.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	3,390	118.39	401,342.10	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	172.01	68,804.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	19.39	17,451.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	70.81	92,053.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.75	36,875.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	27.83	66,792.00	
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	5,900	34.10	201,190.00	
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	52.72	52,720.00	
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	196.68	275,352.00	
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	10.73	21,460.00	
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	239.50	95,800.00	

JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	37.75	11,325.00	
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	76.80	23,040.00	
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,200	1,900.00	2,280,000.00	
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,400	216.50	303,100.00	
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,016	47.41	237,808.56	
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	12.05	31,330.00	
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	800	24.10	19,280.00	
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	79.49	77,900.20	
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,120	354.77	397,342.40	
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	143.53	57,412.00	
TOLY BREAD CO LTD-A	700	29.19	20,433.00	
TONGWEI CO LTD-A	4,400	43.54	191,576.00	
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	97.08	87,372.00	
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	12.90	73,014.00	
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,600	271.21	976,356.00	
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	900	73.46	66,114.00	
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	18.25	20,075.00	
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	29.06	37,778.00	
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	21.08	21,080.00	
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	172.21	17,221.00	
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	54.42	32,652.00	
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	63.39	352,765.35	
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	63.10	39,753.00	
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	30.26	12,104.00	
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	135.00	94,500.00	
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	390	54.43	21,227.70	
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	37.64	65,493.60	
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	105.90	31,770.00	
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	76.00	89,680.00	
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	35.89	17,945.00	
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	14.31	2,862.00	
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	28.35	19,845.00	
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	8.27	3,969.60	
OVCTEK CHINA INC-A	920	94.97	87,372.40	
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	34.02	20,412.00	

SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	19.42	38,840.00	
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,100	435.00	478,500.00	
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	368.60	110,580.00	
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	16.48	17,139.20	
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	28.42	25,578.00	
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	363.80	72,760.00	
BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL-A	1,080	41.23	44,528.40	
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	95.96	28,788.00	
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	100.15	30,045.00	
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	365.78	146,312.00	
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	24.39	2,439.00	
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,500	171.10	256,650.00	
DAAN GENE CO LTD-A	960	18.33	17,596.80	
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	33.58	3,358.00	
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	31.63	44,282.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	162.60	48,780.00	
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	38.12	67,853.60	
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	25.83	36,162.00	
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,116	61.49	376,072.84	
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	15.45	15,450.00	
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	12.09	19,344.00	
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	400	178.21	71,284.00	
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	40.53	20,265.00	
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	36.93	36,930.00	
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	29.37	24,817.65	
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	194.80	136,360.00	
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	20.27	5,270.20	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	77.80	147,820.00	
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.49	21,721.00	
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	15.07	13,563.00	
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	132.00	79,200.00	
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	27.80	2,780.00	
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	17.80	24,920.00	
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	18.60	3,720.00	
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	11.52	2,304.00	

WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	76.50	114,750.00	
WUXI APPTEC CO LTD-A	2,328	154.00	358,512.00	
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	14.32	14,320.00	
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	104.33	114,763.00	
ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHA-A	600	416.60	249,960.00	
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	21.84	26,426.40	
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	44.60	57,980.00	
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	26.68	56,988.48	
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	66.43	26,572.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	2.99	211,991.00	
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.47	83,589.00	
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	11.77	17,655.00	
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.04	102,144.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.41	165,375.00	
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	13.43	77,894.00	
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	7.15	106,535.00	
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	9.93	88,377.00	
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	35.54	177,700.00	
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.38	100,441.80	
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.92	54,464.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	3.44	120,056.00	
CHINA MERCHANTS BANK-A	19,300	50.05	965,965.00	
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	4.20	125,160.00	
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.87	65,403.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.92	33,320.00	
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.76	70,848.00	
IND & COMM BK OF CHINA-A	58,300	4.70	274,010.00	
INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	19.79	356,220.00	
PING AN BANK CO LTD-A	17,400	20.10	349,740.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	21,100	4.85	102,335.00	
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	4.05	21,465.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	27,500	9.58	263,450.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.80	3,420.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	16.90	50,700.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.49	15,735.00	

CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.23	49,164.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.31	28,868.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	9.88	29,640.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	61.69	74,028.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	18.55	124,285.00	
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	24.24	269,064.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	29.71	148,550.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	10.97	2,194.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	10,104	34.12	344,748.48	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	16.65	53,280.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.63	3,315.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	9.23	66,456.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	15.43	91,037.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	12.05	28,920.00	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	14.36	31,592.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.15	51,290.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	17.35	119,715.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.73	3,865.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	12.13	107,957.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	103.33	51,665.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.44	2,176.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	15.64	86,020.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.38	2,814.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	9.72	65,124.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	11.21	17,936.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.37	25,110.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	12.41	64,532.00	
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.35	10,720.00	
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	8.19	44,815.68	
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.16	10,400.00	
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.64	2,656.00	
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.49	122,128.00	
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	12.05	51,815.00	
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	8.31	2,493.00	
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	4.75	18,050.00	

TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	4.67	20,081.00	
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	7.78	3,890.00	
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	12.39	16,107.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	31.20	78,000.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	29.14	195,238.00	
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	3.58	2,148.00	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	44.19	83,961.00	
PICC HOLDING CO-A	3,500	5.81	20,335.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	10,200	57.64	587,928.00	
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	14.27	9,989.00	
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	11.04	88,320.00	
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	23.11	205,679.00	
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.06	2,424.00	
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	36.07	86,568.00	
GEMDALE CORP-A	3,300	9.36	30,888.00	
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.72	70,375.20	
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	5.08	15,748.00	
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.69	3,283.00	
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	11.15	142,720.00	
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	5.11	3,066.00	
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	16.52	27,753.60	
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	17.95	16,155.00	
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	4.67	15,878.00	
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.33	19,623.00	
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.69	60,970.00	
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.42	12,342.00	
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	12.56	50,240.00	
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	27.81	13,348.80	
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	21.17	2,963.80	
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	14.89	10,423.00	
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	56.08	11,216.00	
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	15.21	10,647.00	
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.44	2,976.00	
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	964	60.46	58,283.44	
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	62.60	156,500.00	

LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	25.99	20,792.00	
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	266.29	106,516.00	
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	520	61.60	32,032.00	
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	136.50	40,950.00	
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	36.68	84,657.44	
ADDSINO CO LTD -A	1,700	19.38	32,946.00	
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	37.54	86,342.00	
AVIC JONHON OPTRONIC TECH-A	900	85.10	76,590.00	
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	41.20	20,600.00	
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	150.77	30,154.00	
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	6.07	208,201.00	
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	48.32	86,976.00	
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	14.37	37,362.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.31	58,410.00	
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	19.57	21,527.00	
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.76	83,496.00	
GOERTEK INC -A	3,300	39.28	129,624.00	
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	10.56	23,232.00	
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	7.31	50,439.00	
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.25	2,775.00	
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	116.20	58,100.00	
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	27.31	27,310.00	
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	30.34	18,204.00	
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	25.15	115,690.00	
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	10.31	23,713.00	
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6,733	40.45	272,349.85	
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	409.00	147,240.00	
NINESTAR CORP-A	100	33.67	3,367.00	
OFILM GROUP CO LTD-A	400	7.87	3,148.00	
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	114.56	80,192.00	
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	23.40	23,400.00	
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	118.70	33,236.00	
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	16.83	16,830.00	
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	39.90	31,920.00	
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	25.43	22,887.00	

SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	20.21	14,147.00	
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	34.77	24,339.00	
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	14.21	34,104.00	
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	27.08	50,802.08	
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	14.05	18,265.00	
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	88.44	106,128.00	
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	26.90	51,217.60	
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	8.58	21,450.00	
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	12.36	21,753.60	
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	65.65	42,016.00	
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	93.16	83,844.00	
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	22.46	53,904.00	
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	34.43	17,215.00	
ZTE CORP-A	3,800	36.37	138,206.00	
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	4.83	20,769.00	
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,900	18.79	430,291.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.16	4,108.00	
HUANENG POWER INTL INC-A	800	3.92	3,136.00	
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	8.85	58,410.00	
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	5.67	3,969.00	
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	8.83	5,298.00	
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.20	58,240.00	
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	45.70	50,270.00	
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.08	17,544.00	
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	196.01	148,183.56	
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	128.07	153,684.00	
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	63.59	127,180.00	
INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	146.77	58,708.00	
JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	57.05	68,460.00	
JCET GROUP CO LTD-A	1,900	35.88	68,172.00	
LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	4,940	92.29	455,912.60	
MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	64.16	45,810.24	
NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	373.38	186,690.00	
SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	40.50	178,200.00	
SG MICRO CORP-A	150	285.17	42,775.50	

	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	112.63	28,157.50	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	168.22	50,466.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	48.87	112,401.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	13.80	26,220.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	21.66	17,328.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	171.03	85,515.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	302.12	241,696.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	59.20	53,280.00	
オフショア人民元 小計		1,927,215		39,367,575.93 (671,150,244)	
サウジアラビアリアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	28.00	110,068.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	34,823	34.90	1,215,322.70	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	72.10	135,475.90	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	21.88	82,750.16	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	44.95	89,900.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,497	121.80	425,934.60	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	5,474	33.20	181,736.80	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	6,999	67.50	472,432.50	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	14,155	119.80	1,695,769.00	
	SAUDI CEMENT	1,265	63.70	80,580.50	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	36.70	109,476.10	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	10,947	19.52	213,685.44	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	69.00	251,091.00	
	JARIR MARKETING CO	911	202.00	184,022.00	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	116.00	47,096.00	
	ALMARAI CO	4,232	59.00	249,688.00	
	SAVOLA	4,558	41.60	189,612.80	
	DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	164.00	128,904.00	
	MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	749	179.40	134,370.60	
	AL RAJHI BANK	19,204	109.40	2,100,917.60	
	ALINMA BANK	16,108	21.72	349,865.76	
	ARAB NATIONAL BANK	8,707	22.18	193,121.26	
	BANK AL-JAZIRA	5,356	19.78	105,941.68	
	BANK ALBILAD	5,393	36.80	198,462.40	
	BANQUE SAUDI FRANSI	9,664	36.50	352,736.00	

	RIYAD BANK	21,695	26.05	565,154.75	
	SAUDI BRITISH BANK	11,978	30.10	360,537.80	
	THE SAUDI NATIONAL BANK	34,421	54.00	1,858,734.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	135.00	108,000.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	84.00	55,524.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	8,367	10.36	86,682.12	
	EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	12.62	54,202.90	
	ETIHAD ETISALAT CO	5,584	32.00	178,688.00	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	14.26	74,152.00	
	SAUDI TELECOM CO	9,462	126.20	1,194,104.40	
	SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	26.20	323,805.80	
サウジアラビアリアル 小計		286,270		14,158,546.57 (417,960,294)	
合　計		38,474,264		14,099,949,331 (14,099,949,331)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	45,800	986,532.00	
	メキシコペソ 小計		45,800	986,532.00 (5,432,733)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	709,472.40	
	南アフリカランド 小計		48,594	709,472.40 (5,278,474)	
合計				10,711,207 (10,711,207)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	74銘柄	100.0%	—	9.3%
メキシコペソ	株式	22銘柄	97.9%	—	1.8%
	投資証券	1銘柄	—	2.1%	0.0%
ブラジルレアル	株式	53銘柄	100.0%	—	5.2%
チリペソ	株式	13銘柄	100.0%	—	0.4%
コロンビアペソ	株式	5銘柄	100.0%	—	0.1%
ユーロ	株式	5銘柄	100.0%	—	0.2%
英ポンド	株式	1銘柄	100.0%	—	0.1%
トルコリラ	株式	11銘柄	100.0%	—	0.2%
チェココルナ	株式	3銘柄	100.0%	—	0.1%
ハンガリーフォリント	株式	3銘柄	100.0%	—	0.2%
ポーランドズロチ	株式	14銘柄	100.0%	—	0.7%
ロシアルーブル	株式	4銘柄	100.0%	—	0.2%
香港ドル	株式	211銘柄	100.0%	—	25.5%
マレーシアリンギット	株式	36銘柄	100.0%	—	1.3%
タイバーツ	株式	43銘柄	100.0%	—	1.6%
フィリピンペソ	株式	17銘柄	100.0%	—	0.6%
インドネシアルピア	株式	22銘柄	100.0%	—	1.2%
韓国ウォン	株式	103銘柄	100.0%	—	13.3%
新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%	—	14.3%
インドルピー	株式	101銘柄	100.0%	—	10.5%
カタールリアル	株式	12銘柄	100.0%	—	0.7%
南アフリカランド	株式	36銘柄	98.9%	—	3.5%
	投資証券	1銘柄	—	1.1%	0.0%
アラブディルハム	株式	9銘柄	100.0%	—	0.7%
クウェートディナール	株式	6銘柄	100.0%	—	0.5%
オフショア人民元	株式	477銘柄	100.0%	—	4.8%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%	—	3.0%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	
流動資産	
金銭信託	84,343
コール・ローン	1,073,089,895
国債証券	89,379,159,300
地方債証券	5,530,459,425
特殊債券	6,589,335,364
社債券	4,351,197,000
未収入金	181,586,000
未収利息	158,333,820
前払費用	12,951,448
流動資産合計	107,276,196,595
資産合計	107,276,196,595
負債の部	
流動負債	
未払金	540,000,900
未払解約金	23,124,000
未払利息	2,910
流動負債合計	563,127,810
負債合計	563,127,810
純資産の部	
元本等	
元本	101,039,516,066
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,673,552,719
元本等合計	106,713,068,785
純資産合計	106,713,068,785
負債純資産合計	107,276,196,595

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26日現在	
１．　投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	80,757,065,940円
期中追加設定元本額	49,051,573,194円
期中一部解約元本額	28,769,123,068円
期末元本額	101,039,516,066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	596,559,273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	83,731,130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	57,489,763,216円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　国内債券インデックス	1,241,184,826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	2,342,406,355円
りそな・リスクコントロールファンド２０１９－０９	4,342,991,388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	363,785,905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	
	101,039,516,066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	1.0562円
(10,000口当たり純資産額)	(10,562円)

（注）※は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	219,685,920
地方債証券	4,504,505
特殊債券	1,672,154
社債券	14,204,000
合計	240,066,579

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

2　デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第４１５回利付国債（２年）	240,000,000	240,583,200	
	第４１６回利付国債（２年）	120,000,000	120,316,800	
	第４１７回利付国債（２年）	350,000,000	351,011,500	

第４１８回利付国債（２年）	440,000,000	441,364,000	
第４２０回利付国債（２年）	820,000,000	822,878,200	
第４２１回利付国債（２年）	600,000,000	602,232,000	
第４２３回利付国債（２年）	780,000,000	781,965,600	
第４２４回利付国債（２年）	600,000,000	601,536,000	
第４２５回利付国債（２年）	350,000,000	350,906,500	
第１３３回利付国債（５年）	1,280,000,000	1,283,456,000	
第１３４回利付国債（５年）	830,000,000	832,788,800	
第１３５回利付国債（５年）	1,000,000,000	1,003,960,000	
第１３６回利付国債（５年）	1,180,000,000	1,185,274,600	
第１３７回利付国債（５年）	1,070,000,000	1,075,414,200	
第１３８回利付国債（５年）	1,240,000,000	1,247,316,000	
第１３９回利付国債（５年）	1,680,000,000	1,691,155,200	
第１４０回利付国債（５年）	1,420,000,000	1,430,124,600	
第１４１回利付国債（５年）	580,000,000	584,495,000	
第１４２回利付国債（５年）	800,000,000	806,832,000	
第１４３回利付国債（５年）	910,000,000	918,335,600	
第１４４回利付国債（５年）	1,080,000,000	1,090,584,000	
第１４５回利付国債（５年）	1,020,000,000	1,030,648,800	
第１４６回利付国債（５年）	1,050,000,000	1,061,382,000	
第１４７回利付国債（５年）	790,000,000	795,356,200	
第１回利付国債（４０年）	40,000,000	58,143,600	
第２回利付国債（４０年）	100,000,000	141,119,000	
第３回利付国債（４０年）	110,000,000	155,881,000	
第４回利付国債（４０年）	170,000,000	241,498,600	
第５回利付国債（４０年）	170,000,000	233,117,600	
第６回利付国債（４０年）	210,000,000	283,361,400	
第７回利付国債（４０年）	230,000,000	298,657,300	
第８回利付国債（４０年）	230,000,000	279,553,500	
第９回利付国債（４０年）	390,000,000	355,391,400	
第１０回利付国債（４０年）	370,000,000	393,916,800	
第１１回利付国債（４０年）	300,000,000	309,651,000	
第１２回利付国債（４０年）	300,000,000	279,210,000	
第１３回利付国債（４０年）	350,000,000	324,268,000	
第１４回利付国債（４０年）	70,000,000	69,353,900	
第３２５回利付国債（１０年）	330,000,000	333,554,100	
第３２６回利付国債（１０年）	280,000,000	283,278,800	
第３２７回利付国債（１０年）	387,000,000	392,073,570	
第３２８回利付国債（１０年）	411,000,000	415,981,320	
第３２９回利付国債（１０年）	297,000,000	302,256,900	
第３３０回利付国債（１０年）	257,000,000	262,152,850	
第３３１回利付国債（１０年）	90,000,000	91,416,600	

	第３３２回利付国債（１０年）	652,000,000	663,533,880	
	第３３３回利付国債（１０年）	225,000,000	229,421,250	
	第３３４回利付国債（１０年）	261,000,000	266,658,480	
	第３３５回利付国債（１０年）	345,000,000	352,041,450	
	第３３６回利付国債（１０年）	210,000,000	214,664,100	
	第３３７回利付国債（１０年）	170,000,000	172,612,900	
	第３３８回利付国債（１０年）	631,000,000	643,720,960	
	第３３９回利付国債（１０年）	385,000,000	393,300,600	
	第３４０回利付国債（１０年）	934,000,000	955,453,980	
	第３４１回利付国債（１０年）	440,000,000	448,668,000	
	第３４２回利付国債（１０年）	380,000,000	384,263,600	
	第３４３回利付国債（１０年）	680,000,000	687,874,400	
	第３４４回利付国債（１０年）	810,000,000	819,865,800	
	第３４５回利付国債（１０年）	970,000,000	982,396,600	
	第３４６回利付国債（１０年）	1,070,000,000	1,084,605,500	
	第３４７回利付国債（１０年）	500,000,000	507,135,000	
	第３４８回利付国債（１０年）	810,000,000	822,052,800	
	第３４９回利付国債（１０年）	830,000,000	842,591,100	
	第３５０回利付国債（１０年）	930,000,000	944,340,600	
	第３５１回利付国債（１０年）	260,000,000	264,162,600	
	第３５２回利付国債（１０年）	830,000,000	843,778,000	
	第３５３回利付国債（１０年）	810,000,000	823,608,000	
	第３５４回利付国債（１０年）	420,000,000	426,963,600	
	第３５５回利付国債（１０年）	580,000,000	589,465,600	
	第３５６回利付国債（１０年）	1,020,000,000	1,035,912,000	
	第３５７回利付国債（１０年）	670,000,000	680,197,400	
	第３５８回利付国債（１０年）	580,000,000	588,317,200	
	第３５９回利付国債（１０年）	990,000,000	1,003,266,000	
	第３６０回利付国債（１０年）	710,000,000	718,796,900	
	第３６１回利付国債（１０年）	900,000,000	910,170,000	
	第３６２回利付国債（１０年）	710,000,000	717,192,300	
	第１回利付国債（３０年）	60,000,000	74,146,200	
	第７回利付国債（３０年）	40,000,000	49,706,400	
	第１１回利付国債（３０年）	50,000,000	59,511,500	
	第１２回利付国債（３０年）	40,000,000	49,663,200	
	第１３回利付国債（３０年）	90,000,000	110,943,900	
	第１４回利付国債（３０年）	60,000,000	77,185,800	
	第１５回利付国債（３０年）	160,000,000	208,500,800	
	第１６回利付国債（３０年）	100,000,000	130,727,000	
	第１７回利付国債（３０年）	50,000,000	64,905,500	
	第１８回利付国債（３０年）	60,000,000	77,302,200	
	第１９回利付国債（３０年）	100,000,000	129,183,000	
	第２０回利付国債（３０年）	100,000,000	132,379,000	

第２１回利付国債（３０年）	90,000,000	116,945,100	
第２２回利付国債（３０年）	50,000,000	66,601,000	
第２３回利付国債（３０年）	160,000,000	213,859,200	
第２４回利付国債（３０年）	170,000,000	227,830,600	
第２５回利付国債（３０年）	100,000,000	131,373,000	
第２６回利付国債（３０年）	145,000,000	193,250,200	
第２７回利付国債（３０年）	215,000,000	291,454,000	
第２８回利付国債（３０年）	110,000,000	149,913,500	
第２９回利付国債（３０年）	70,000,000	94,672,200	
第３０回利付国債（３０年）	190,000,000	254,752,000	
第３１回利付国債（３０年）	130,000,000	172,664,700	
第３２回利付国債（３０年）	215,000,000	290,675,700	
第３３回利付国債（３０年）	290,000,000	377,232,000	
第３４回利付国債（３０年）	315,000,000	422,900,100	
第３５回利付国債（３０年）	316,000,000	413,751,440	
第３６回利付国債（３０年）	365,000,000	479,577,150	
第３７回利付国債（３０年）	380,000,000	493,076,600	
第３８回利付国債（３０年）	220,000,000	281,637,400	
第３９回利付国債（３０年）	250,000,000	325,832,500	
第４０回利付国債（３０年）	205,000,000	263,129,800	
第４１回利付国債（３０年）	195,000,000	246,606,750	
第４２回利付国債（３０年）	250,000,000	316,500,000	
第４３回利付国債（３０年）	130,000,000	164,759,400	
第４４回利付国債（３０年）	210,000,000	266,433,300	
第４５回利付国債（３０年）	290,000,000	355,592,200	
第４６回利付国債（３０年）	280,000,000	343,568,400	
第４７回利付国債（３０年）	270,000,000	337,726,800	
第４８回利付国債（３０年）	283,000,000	341,190,460	
第４９回利付国債（３０年）	290,000,000	349,800,900	
第５０回利付国債（３０年）	280,000,000	298,757,200	
第５１回利付国債（３０年）	300,000,000	284,820,000	
第５２回利付国債（３０年）	270,000,000	268,498,800	
第５３回利付国債（３０年）	260,000,000	264,368,000	
第５４回利付国債（３０年）	270,000,000	287,107,200	
第５５回利付国債（３０年）	180,000,000	191,284,200	
第５６回利付国債（３０年）	280,000,000	297,021,200	
第５７回利付国債（３０年）	230,000,000	243,816,100	
第５８回利付国債（３０年）	420,000,000	444,402,000	
第５９回利付国債（３０年）	280,000,000	289,161,600	
第６０回利付国債（３０年）	230,000,000	248,722,000	
第６１回利付国債（３０年）	260,000,000	267,690,800	
第６２回利付国債（３０年）	260,000,000	254,134,400	

	第６３回利付国債（３０年）	280,000,000	265,980,400	
	第６４回利付国債（３０年）	260,000,000	246,290,200	
	第６５回利付国債（３０年）	220,000,000	208,060,600	
	第６６回利付国債（３０年）	260,000,000	245,486,800	
	第６７回利付国債（３０年）	190,000,000	188,837,200	
	第６８回利付国債（３０年）	310,000,000	307,709,100	
	第６９回利付国債（３０年）	280,000,000	284,860,800	
	第７０回利付国債（３０年）	370,000,000	375,997,700	
	第５８回利付国債（２０年）	100,000,000	102,345,000	
	第５９回利付国債（２０年）	40,000,000	41,029,200	
	第６０回利付国債（２０年）	30,000,000	30,645,900	
	第６１回利付国債（２０年）	50,000,000	50,936,500	
	第６２回利付国債（２０年）	80,000,000	81,416,000	
	第６３回利付国債（２０年）	60,000,000	62,203,800	
	第６４回利付国債（２０年）	120,000,000	125,253,600	
	第６５回利付国債（２０年）	380,000,000	398,570,600	
	第６７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,081,000	
	第６８回利付国債（２０年）	90,000,000	95,580,900	
	第６９回利付国債（２０年）	60,000,000	63,561,600	
	第７０回利付国債（２０年）	110,000,000	118,131,200	
	第７１回利付国債（２０年）	100,000,000	106,810,000	
	第７２回利付国債（２０年）	210,000,000	224,884,800	
	第７３回利付国債（２０年）	180,000,000	193,192,200	
	第７５回利付国債（２０年）	100,000,000	108,230,000	
	第７６回利付国債（２０年）	100,000,000	107,496,000	
	第７７回利付国債（２０年）	20,000,000	21,572,600	
	第７８回利付国債（２０年）	50,000,000	54,009,000	
	第７９回利付国債（２０年）	20,000,000	21,682,000	
	第８０回利付国債（２０年）	90,000,000	97,921,800	
	第８１回利付国債（２０年）	30,000,000	32,687,100	
	第８２回利付国債（２０年）	170,000,000	185,935,800	
	第８３回利付国債（２０年）	10,000,000	10,991,700	
	第８４回利付国債（２０年）	120,000,000	131,368,800	
	第８５回利付国債（２０年）	150,000,000	165,675,000	
	第８６回利付国債（２０年）	100,000,000	111,385,000	
	第８７回利付国債（２０年）	90,000,000	99,826,200	
	第８８回利付国債（２０年）	185,000,000	207,212,950	
	第８９回利付国債（２０年）	120,000,000	133,816,800	
	第９０回利付国債（２０年）	170,000,000	190,588,700	
	第９１回利付国債（２０年）	80,000,000	90,103,200	
	第９２回利付国債（２０年）	255,000,000	286,000,350	
	第９３回利付国債（２０年）	80,000,000	89,743,200	
	第９４回利付国債（２０年）	140,000,000	157,848,600	

第９５回利付国債（２０年）	185,000,000	211,847,200	
第９６回利付国債（２０年）	70,000,000	79,325,400	
第９７回利付国債（２０年）	130,000,000	148,872,100	
第９８回利付国債（２０年）	70,000,000	79,727,900	
第９９回利付国債（２０年）	85,000,000	97,232,350	
第１００回利付国債（２０年）	151,000,000	174,587,710	
第１０１回利付国債（２０年）	20,000,000	23,392,400	
第１０２回利付国債（２０年）	145,000,000	170,535,950	
第１０３回利付国債（２０年）	100,000,000	116,915,000	
第１０４回利付国債（２０年）	10,000,000	11,552,300	
第１０５回利付国債（２０年）	12,000,000	13,926,360	
第１０６回利付国債（２０年）	40,000,000	46,710,000	
第１０７回利付国債（２０年）	80,000,000	93,294,400	
第１０８回利付国債（２０年）	220,000,000	253,272,800	
第１０９回利付国債（２０年）	80,000,000	92,435,200	
第１１０回利付国債（２０年）	195,000,000	228,319,650	
第１１１回利付国債（２０年）	50,000,000	59,179,000	
第１１２回利付国債（２０年）	205,000,000	241,002,100	
第１１３回利付国債（２０年）	85,000,000	100,283,850	
第１１４回利付国債（２０年）	160,000,000	189,496,000	
第１１５回利付国債（２０年）	100,000,000	119,281,000	
第１１６回利付国債（２０年）	140,000,000	167,573,000	
第１１７回利付国債（２０年）	225,000,000	267,356,250	
第１１８回利付国債（２０年）	131,000,000	155,003,130	
第１１９回利付国債（２０年）	150,000,000	174,804,000	
第１２０回利付国債（２０年）	240,000,000	275,395,200	
第１２１回利付国債（２０年）	205,000,000	241,414,150	
第１２２回利付国債（２０年）	190,000,000	222,005,500	
第１２３回利付国債（２０年）	265,000,000	317,907,250	
第１２４回利付国債（２０年）	200,000,000	238,046,000	
第１２５回利付国債（２０年）	120,000,000	145,536,000	
第１２６回利付国債（２０年）	100,000,000	119,350,000	
第１２７回利付国債（２０年）	130,000,000	153,900,500	
第１２８回利付国債（２０年）	225,000,000	267,050,250	
第１２９回利付国債（２０年）	240,000,000	282,482,400	
第１３０回利付国債（２０年）	220,000,000	259,668,200	
第１３１回利付国債（２０年）	140,000,000	163,825,200	
第１３２回利付国債（２０年）	170,000,000	199,432,100	
第１３３回利付国債（２０年）	305,000,000	360,967,500	
第１３４回利付国債（２０年）	45,000,000	53,396,100	
第１３５回利付国債（２０年）	40,000,000	47,039,200	
第１３６回利付国債（２０年）	410,000,000	477,805,800	

	第１３７回利付国債（２０年）	170,000,000	200,404,500	
	第１３８回利付国債（２０年）	90,000,000	104,145,300	
	第１３９回利付国債（２０年）	280,000,000	327,042,800	
	第１４０回利付国債（２０年）	420,000,000	496,293,000	
	第１４１回利付国債（２０年）	185,000,000	219,226,850	
	第１４２回利付国債（２０年）	310,000,000	370,862,300	
	第１４３回利付国債（２０年）	335,000,000	393,983,450	
	第１４４回利付国債（２０年）	190,000,000	221,258,800	
	第１４５回利付国債（２０年）	445,000,000	529,652,350	
	第１４６回利付国債（２０年）	460,000,000	549,010,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	495,000,000	585,941,400	
	第１４８回利付国債（２０年）	465,000,000	545,617,050	
	第１４９回利付国債（２０年）	470,000,000	552,381,600	
	第１５０回利付国債（２０年）	530,000,000	617,026,000	
	第１５１回利付国債（２０年）	485,000,000	552,618,700	
	第１５２回利付国債（２０年）	580,000,000	661,437,800	
	第１５３回利付国債（２０年）	410,000,000	473,545,900	
	第１５４回利付国債（２０年）	308,000,000	351,834,560	
	第１５５回利付国債（２０年）	480,000,000	535,243,200	
	第１５６回利付国債（２０年）	520,000,000	535,178,800	
	第１５７回利付国債（２０年）	450,000,000	449,671,500	
	第１５８回利付国債（２０年）	250,000,000	260,645,000	
	第１５９回利付国債（２０年）	430,000,000	454,338,000	
	第１６０回利付国債（２０年）	430,000,000	460,869,700	
	第１６１回利付国債（２０年）	410,000,000	432,931,300	
	第１６２回利付国債（２０年）	360,000,000	379,854,000	
	第１６３回利付国債（２０年）	360,000,000	379,548,000	
	第１６４回利付国債（２０年）	570,000,000	591,352,200	
	第１６５回利付国債（２０年）	430,000,000	445,621,900	
	第１６６回利付国債（２０年）	570,000,000	609,176,100	
	第１６７回利付国債（２０年）	380,000,000	392,889,600	
	第１６８回利付国債（２０年）	410,000,000	416,170,500	
	第１６９回利付国債（２０年）	370,000,000	368,434,900	
	第１７０回利付国債（２０年）	470,000,000	467,184,700	
	第１７１回利付国債（２０年）	330,000,000	327,429,300	
	第１７２回利付国債（２０年）	450,000,000	453,937,500	
	第１７３回利付国債（２０年）	420,000,000	422,969,400	
	第１７４回利付国債（２０年）	400,000,000	402,144,000	
	第１７５回利付国債（２０年）	420,000,000	429,492,000	
	第１７６回利付国債（２０年）	460,000,000	469,660,000	
	国債証券合計	83,611,000,000	89,379,159,300	
地方債証券	第１４回東京都公募公債	100,000,000	115,035,000	

	第７２３回東京都公募公債	100,000,000	101,626,000	
	第７４６回東京都公募公債	100,000,000	101,927,000	
	第７６１回東京都公募公債	100,000,000	100,282,000	
	第７８９回東京都公募公債	100,000,000	100,258,000	
	第８０８回東京都公募公債	100,000,000	100,363,000	
	平成２８年度第８回北海道公募公債	100,000,000	100,157,000	
	第２１１回神奈川県公募公債	100,000,000	101,473,000	
	第２２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,348,000	
	第１６４回大阪府公募公債	100,000,000	99,972,000	
	第３７６回大阪府公募公債	110,000,000	111,934,900	
	第４４４回大阪府公募公債	100,000,000	100,288,000	
	第４５１回大阪府公募公債	100,000,000	99,941,000	
	平成２７年度第１３回京都府公募公債	100,000,000	100,487,000	
	平成２９年度第４回京都府公募公債	100,000,000	100,942,000	
	平成２９年度第１回兵庫県公募公債	100,000,000	100,911,000	
	令和元年度第２回兵庫県公募公債	100,000,000	100,428,000	
	平成２６年度第６回静岡県公募公債	100,000,000	101,730,000	
	平成３０年度第１４回静岡県公募公債	100,000,000	100,737,000	
	平成２２年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	116,527,000	
	平成２８年度第８回愛知県公募公債	100,000,000	100,228,000	
	平成２９年度第１１回愛知県公募公債	100,000,000	101,154,000	
	平成２９年度第３回広島県公募公債	100,000,000	100,677,000	
	平成３０年度第１回広島県公募公債	100,000,000	101,089,000	
	第８回埼玉県公募公債	100,000,000	117,282,000	
	第１６回埼玉県公募公債	100,000,000	113,344,000	
	平成２６年度第６回埼玉県公募公債	100,000,000	101,740,000	
	平成２４年度第２回福岡県公募公債	100,000,000	116,405,000	
	平成２７年度第１回福岡県公募公債	100,000,000	102,244,000	
	第１９回千葉県公募公債	100,000,000	112,734,000	
	平成２９年度第６回千葉県公募公債	100,000,000	101,329,000	
	第１１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,006,000	
	第１２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,653,000	
	第１３３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,879,000	
	第１５６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,443,000	
	第１６９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,003,000	
	第１８５回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,376,000	
	第１９１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,679,000	
	第２０７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,798,000	
	第２０９回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,496,000	
	第２１６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,237,000	
	第２１７回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,248,000	
	平成２７年度第１回静岡市公募公債	100,000,000	102,041,000	

	第１１回大阪市公募公債	100,000,000	118,879,000	
	第１７回名古屋市公募公債	100,000,000	112,973,000	
	令和元年度第４回京都市公募公債	114,500,000	115,284,325	
	第２６回横浜市公募公債	100,000,000	118,464,000	
	平成２６年度第５回福岡市公募公債	100,000,000	101,740,000	
	平成２７年度第２回広島市公募公債	100,000,000	102,027,000	
	平成２９年度第３回千葉市公募公債	120,000,000	121,345,200	
	平成２９年度第１回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,018,000	
	平成２９年度第５回福井県公募公債	100,000,000	101,010,000	
	平成２９年度第２回岡山県公募公債	100,000,000	101,267,000	
	地方債証券合計	5,344,500,000	5,530,459,425	
特殊債券	第２８回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,596,000	
	第４９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,313,000	
	第８９回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,193,000	
	第１３１回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,636,000	
	第８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,229,000	
	第１６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	135,063,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	106,355,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	174,090,000	
	第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,129,520	
	第２２７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	129,156,460	
	第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,559,000	
	第２４９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,861,000	
	第２５１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,259,820	
	第２６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	134,860,670	
	第３００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,550,000	
	第３３０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,919,000	
	第３３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,185,000	
	第３４５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,708,000	
	第３７５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,454,000	
	第３８７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,808,000	
	第１回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	127,000,000	
	第１３回公営企業債券	100,000,000	108,343,000	

	第５３回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,953,260	
	第７８回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,600,000	
	Ｆ８２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,516,000	
	第９７回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	145,980,200	
	第９７回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,710,000	
	第１１１回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,463,350	
	Ｆ１３２回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,288,000	
	Ｆ２２８回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	111,278,000	
	Ｆ３０５回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,888,000	
	第１０回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	100,000,000	117,820,000	
	第９７回都市再生債券	100,000,000	107,590,000	
	第２回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	112,277,000	
	第６回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	77,023,000	76,861,251	
	第７回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	82,484,000	82,559,060	
	第１８回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,584,000	
	第９７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	118,337,000	
	第１１７回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,337,000	
	第１２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,671,000	84,083,847	
	第１２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,788,000	83,980,975	
	第１２７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,138,000	85,225,904	
	第１２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,351,000	84,532,917	
	第１３５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,625,000	87,696,551	
	第１３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,861,000	89,459,191	
	第１５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,931,000	92,953,303	
	第１５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,789,000	95,424,086	
	第１６１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,411,000	98,468,883	
	第１６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,441,000	100,944,547	
	第１７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,169,000	
	第１７１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,523,000	
	第１回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	52,940,000	52,944,764	
	第２回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	54,594,000	54,633,853	
	第３回貸付債権担保Ｔ種住宅金融支援機構債券	58,483,000	58,561,952	
	第３４０回信金中金債	100,000,000	100,126,000	
	第３５８回信金中金債（５年）	100,000,000	99,904,000	
	第３７２回信金中金債	100,000,000	100,064,000	
	第３７６回信金中金債	100,000,000	100,023,000	
	第３１回国際協力機構債券	100,000,000	102,072,000	
	第８７回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,046,000	
	第２９回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,180,000	
	第５２回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,965,000	
	第１１６回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,042,000	

	特殊債券合計	6,329,530,000	6,589,335,364	
社債券	第２４回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	100,000,000	100,356,000	
	第３回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,161,000	
	第１２回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	99,929,000	
	第１回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	99,559,000	
	第１回コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	100,037,000	
	第１２回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	99,978,000	
	第３回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,485,000	
	第１２回Ｚホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,803,000	
	第１０回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,881,000	
	第１４回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,438,000	
	第１５回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,867,000	
	第１２回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,957,000	
	第１８回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,944,000	
	第１７回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,129,000	
	第５回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	100,279,000	
	第１７回株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	99,993,000	
	第１４７回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,592,000	
	第１９回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,978,000	
	第１４回ＮＴＴファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,933,000	
	第２０５回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,095,000	
	第１６回三井住友ファイナンス＆リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,506,000	
	第７５回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,459,000	
	第５８回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,045,000	
	第１２０回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,671,000	
	第９８回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,827,000	
	第１１２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,642,000	
	第１２５回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,446,000	
	第２６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	118,391,000	
	第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,081,000	
	第２２回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	100,000,000	100,507,000	
	第５４３回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,179,000	
	第５３６回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,280,000	
	第４１３回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,568,000	

	第３３８回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,399,000	
	第３４３回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,239,000	
	第５３１回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,000,000	
	第２８９回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,822,000	
	第４６２回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,825,000	
	第４９３回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,216,000	
	第１４回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,504,000	
	第２８回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	103,337,000	
	第７０回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,098,000	
	第７回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,761,000	
	社債券合計	4,300,000,000	4,351,197,000	
合計			105,850,151,089	

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ＲＭ先進国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	
流動資産	
預金	135,469,713
コール・ローン	190,509,568
国債証券	39,128,111,758
派生商品評価勘定	724,333
未収利息	191,655,533
前払費用	17,675,604
流動資産合計	39,664,146,509
資産合計	39,664,146,509
負債の部	
流動負債	
未払金	199,224,654
未払利息	516
流動負債合計	199,225,170
負債合計	199,225,170
純資産の部	
元本等	
元本	35,815,881,257
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,649,040,082

	2021年 7月26日現在
元本等合計	39,464,921,339
純資産合計	39,464,921,339
負債純資産合計	39,664,146,509

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	国債証券 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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4.収益及び費用の計上基準	為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。
5.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	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26日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	24,423,897,140円
期中追加設定元本額	17,528,866,890円
期中一部解約元本額	6,136,882,773円
期末元本額	35,815,881,257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	49,844,026円
ＦＷりそな先進国＋新興国債券アクティブファンド	26,775,178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）	27,564,701,587円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国債券インデックス（為替ヘッジなし）	790,705,825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	
	35,815,881,257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	1.1019円
(10,000口当たり純資産額)	(11,019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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
国債証券	△341,837,749
合計	△341,837,749

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2021年 7月26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	170,880,621	－	171,604,954	724,333
	米ドル	80,670,099	－	81,002,433	332,334
	カナダドル	3,403,060	－	3,435,647	32,587
	ユーロ	71,688,736	－	71,913,087	224,351
	英ポンド	11,525,673	－	11,637,736	112,063
	オーストラリアドル	3,593,053	－	3,616,051	22,998
合計		170,880,621	－	171,604,954	724,333

（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。

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	390,000.00	397,483.20	
		US TREASURY N/B	410,000.00	416,457.54	
		US TREASURY N/B	510,000.00	510,302.58	
		US TREASURY N/B	450,000.00	457,352.14	
		US TREASURY N/B	360,000.00	367,049.73	
		US TREASURY N/B	400,000.00	407,333.04	
		US TREASURY N/B	270,000.00	274,423.00	
		US TREASURY N/B	390,000.00	397,655.27	
		US TREASURY N/B	480,000.00	488,146.84	
		US TREASURY N/B	860,000.00	860,419.85	
		US TREASURY N/B	560,000.00	568,946.84	
		US TREASURY N/B	520,000.00	530,186.69	
		US TREASURY N/B	350,000.00	357,362.28	
		US TREASURY N/B	600,000.00	600,175.74	
		US TREASURY N/B	430,000.00	436,668.35	
		US TREASURY N/B	430,000.00	439,590.97	
		US TREASURY N/B	410,000.00	419,801.54	
		US TREASURY N/B	910,000.00	910,159.88	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,356,236.24	
		US TREASURY N/B	670,000.00	686,985.50	
		US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,379,953.35	
		US TREASURY N/B	460,000.00	469,622.23	
		US TREASURY N/B	720,000.00	740,475.00	
		US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,429,804.37	
		US TREASURY N/B	560,000.00	571,243.73	
		US TREASURY N/B	400,000.00	409,750.00	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,137,210.89	
		US TREASURY N/B	650,000.00	668,725.52	
		US TREASURY N/B	300,000.00	306,468.75	
		US TREASURY N/B	390,000.00	398,775.00	
		US TREASURY N/B	410,000.00	426,079.66	
		US TREASURY N/B	930,000.00	931,416.76	
		US TREASURY N/B	490,000.00	502,517.93	
		US TREASURY N/B	420,000.00	439,047.63	

		US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,097,032.98	
		US TREASURY N/B	640,000.00	658,087.48	
		US TREASURY N/B	530,000.00	529,523.79	
		US TREASURY N/B	320,000.00	328,487.48	
		US TREASURY N/B	400,000.00	418,921.84	
		US TREASURY N/B	350,000.00	349,589.83	
		US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,021,195.23	
		US TREASURY N/B	470,000.00	480,758.58	
		US TREASURY N/B	200,000.00	209,351.56	
		US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,557,836.59	
		US TREASURY N/B	400,000.00	408,437.48	
		US TREASURY N/B	320,000.00	336,400.00	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,256,296.80	
		US TREASURY N/B	530,000.00	542,846.24	
		US TREASURY N/B	130,000.00	136,896.08	
		US TREASURY N/B	890,000.00	912,180.40	
		US TREASURY N/B	480,000.00	507,562.46	
		US TREASURY N/B	940,000.00	937,539.83	
		US TREASURY N/B	540,000.00	556,853.88	
		US TREASURY N/B	150,000.00	158,906.25	
		US TREASURY N/B	710,000.00	750,783.39	
		US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,140,044.46	
		US TREASURY N/B	440,000.00	459,198.43	
		US TREASURY N/B	340,000.00	360,798.41	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,491,601.50	
		US TREASURY N/B	140,000.00	146,701.94	
		US TREASURY N/B	450,000.00	475,646.44	
		US TREASURY N/B	420,000.00	440,721.07	
		US TREASURY N/B	440,000.00	464,440.59	
		US TREASURY N/B	690,000.00	733,340.62	
		US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,324,518.93	
		US TREASURY N/B	490,000.00	513,198.41	
		US TREASURY N/B	340,000.00	358,255.07	
		US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,614,473.30	
		US TREASURY N/B	320,000.00	334,743.74	

		US TREASURY N/B	700,000.00	736,968.75	
		US TREASURY N/B	850,000.00	901,713.83	
		US TREASURY N/B	2,010,000.00	2,004,975.00	
		US TREASURY N/B	650,000.00	680,519.51	
		US TREASURY N/B	520,000.00	518,435.89	
		US TREASURY N/B	390,000.00	408,646.87	
		US TREASURY N/B	420,000.00	437,046.07	
		US TREASURY N/B	220,000.00	231,524.21	
		US TREASURY N/B	730,000.00	760,255.06	
		US TREASURY N/B	790,000.00	838,001.74	
		US TREASURY N/B	400,000.00	418,265.60	
		US TREASURY N/B	600,000.00	615,867.18	
		US TREASURY N/B	220,000.00	231,971.08	
		US TREASURY N/B	710,000.00	734,655.81	
		US TREASURY N/B	310,000.00	328,369.91	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,066,130.44	
		US TREASURY N/B	750,000.00	794,956.05	
		US TREASURY N/B	400,000.00	422,468.72	
		US TREASURY N/B	450,000.00	465,890.62	
		US TREASURY N/B	400,000.00	424,500.00	
		US TREASURY N/B	860,000.00	897,960.91	
		US TREASURY N/B	430,000.00	460,494.69	
		US TREASURY N/B	550,000.00	567,327.14	
		US TREASURY N/B	730,000.00	769,123.40	
		US TREASURY N/B	340,000.00	367,432.39	
		US TREASURY N/B	960,000.00	981,918.72	
		US TREASURY N/B	250,000.00	269,418.92	
		US TREASURY N/B	600,000.00	600,035.10	
		US TREASURY N/B	250,000.00	272,026.35	
		US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,054,265.18	
		US TREASURY N/B	570,000.00	604,277.91	
		US TREASURY N/B	240,000.00	261,464.04	
		US TREASURY N/B	700,000.00	692,289.01	
		US TREASURY N/B	290,000.00	314,780.26	
		US TREASURY N/B	470,000.00	513,080.24	

		US TREASURY N/B	630,000.00	622,063.44	
		US TREASURY N/B	810,000.00	856,274.40	
		US TREASURY N/B	310,000.00	337,264.25	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	986,464.80	
		US TREASURY N/B	230,000.00	252,851.74	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,162,876.07	
		US TREASURY N/B	570,000.00	627,478.68	
		US TREASURY N/B	770,000.00	758,074.00	
		US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,390,466.74	
		US TREASURY N/B	480,000.00	526,378.08	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,561,257.52	
		US TREASURY N/B	300,000.00	326,121.09	
		US TREASURY N/B	500,000.00	494,072.25	
		US TREASURY N/B	330,000.00	358,952.31	
		US TREASURY N/B	590,000.00	582,532.78	
		US TREASURY N/B	670,000.00	698,854.48	
		US TREASURY N/B	350,000.00	379,004.85	
		US TREASURY N/B	430,000.00	461,158.18	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,003,105.40	
		US TREASURY N/B	450,000.00	485,525.38	
		US TREASURY N/B	870,000.00	872,175.00	
		US TREASURY N/B	730,000.00	761,923.19	
		US TREASURY N/B	470,000.00	501,816.79	
		US TREASURY N/B	730,000.00	731,539.78	
		US TREASURY N/B	450,000.00	475,259.76	
		US TREASURY N/B	520,000.00	549,514.05	
		US TREASURY N/B	610,000.00	633,196.65	
		US TREASURY N/B	320,000.00	330,187.48	
		US TREASURY N/B	400,000.00	417,796.84	
		US TREASURY N/B	350,000.00	365,544.90	
		US TREASURY N/B	850,000.00	904,436.46	
		US TREASURY N/B	300,000.00	313,324.20	
		US TREASURY N/B	440,000.00	462,515.59	
		US TREASURY N/B	140,000.00	150,956.63	
		US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,240,682.78	

		US TREASURY N/B	300,000.00	296,648.43	
		US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,107,841.37	
		US TREASURY N/B	580,000.00	630,285.53	
		US TREASURY N/B	1,960,000.00	1,919,192.01	
		US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,692,696.87	
		US TREASURY N/B	800,000.00	864,203.12	
		US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,323,768.64	
		US TREASURY N/B	690,000.00	745,833.35	
		US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,156,307.72	
		US TREASURY N/B	500,000.00	489,414.05	
		US TREASURY N/B	900,000.00	887,097.60	
		US TREASURY N/B	850,000.00	946,438.45	
		US TREASURY N/B	920,000.00	928,373.38	
		US TREASURY N/B	600,000.00	609,832.02	
		US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,235,062.50	
		US TREASURY N/B	840,000.00	943,720.26	
		US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,573,734.37	
		US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,238,014.03	
		US TREASURY N/B	120,000.00	156,787.50	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,316,661.25	
		US TREASURY N/B	890,000.00	1,018,910.89	
		US TREASURY N/B	1,010,000.00	1,121,849.51	
		US TREASURY N/B	680,000.00	743,471.06	
		US TREASURY N/B	850,000.00	881,775.37	
		US TREASURY N/B	980,000.00	1,026,224.54	
		US TREASURY N/B	560,000.00	574,010.92	
		US TREASURY N/B	120,000.00	171,173.43	
		US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,111,728.49	
		US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,524,783.18	
		US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,546,000.00	
		US TREASURY N/B	1,010,000.00	1,390,012.50	
		US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,450,246.87	
		US TREASURY N/B	920,000.00	948,893.70	
		US TREASURY N/B	80,000.00	111,871.87	
		US TREASURY N/B	90,000.00	133,657.02	

		US TREASURY N/B	280,000.00	393,465.59	
		US TREASURY N/B	100,000.00	142,644.53	
		US TREASURY N/B	70,000.00	89,550.77	
		US TREASURY N/B	140,000.00	195,797.64	
		US TREASURY N/B	190,000.00	273,670.49	
		US TREASURY N/B	40,000.00	56,873.43	
		US TREASURY N/B	190,000.00	278,528.12	
		US TREASURY N/B	210,000.00	299,725.77	
		US TREASURY N/B	950,000.00	843,254.85	
		US TREASURY N/B	150,000.00	201,626.94	
		US TREASURY N/B	950,000.00	840,286.11	
		US TREASURY N/B	210,000.00	296,058.96	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,107,562.43	
		US TREASURY N/B	230,000.00	344,604.67	
		US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,226,100.00	
		US TREASURY N/B	250,000.00	358,984.37	
		US TREASURY N/B	800,000.00	853,500.00	
		US TREASURY N/B	230,000.00	305,760.73	
		US TREASURY N/B	130,000.00	158,767.57	
		US TREASURY N/B	180,000.00	220,116.78	
		US TREASURY N/B	200,000.00	239,968.74	
		US TREASURY N/B	200,000.00	231,125.00	
		US TREASURY N/B	290,000.00	335,012.29	
		US TREASURY N/B	320,000.00	391,912.48	
		US TREASURY N/B	590,000.00	695,808.17	
		US TREASURY N/B	360,000.00	474,848.42	
		US TREASURY N/B	320,000.00	430,487.48	
		US TREASURY N/B	410,000.00	543,025.77	
		US TREASURY N/B	390,000.00	498,742.95	
		US TREASURY N/B	430,000.00	529,521.47	
		US TREASURY N/B	380,000.00	459,131.99	
		US TREASURY N/B	530,000.00	589,480.04	
		US TREASURY N/B	450,000.00	545,062.50	
		US TREASURY N/B	410,000.00	487,115.21	
		US TREASURY N/B	290,000.00	352,282.02	

		US TREASURY N/B	530,000.00	590,763.65	
		US TREASURY N/B	460,000.00	513,079.67	
		US TREASURY N/B	370,000.00	394,107.79	
		US TREASURY N/B	350,000.00	417,867.17	
		US TREASURY N/B	440,000.00	537,461.71	
		US TREASURY N/B	350,000.00	427,963.86	
		US TREASURY N/B	480,000.00	562,003.10	
		US TREASURY N/B	420,000.00	492,097.24	
		US TREASURY N/B	520,000.00	637,700.75	
		US TREASURY N/B	760,000.00	953,399.16	
		US TREASURY N/B	630,000.00	773,927.91	
		US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,431,178.50	
		US TREASURY N/B	640,000.00	788,262.46	
		US TREASURY N/B	680,000.00	819,838.26	
		US TREASURY N/B	680,000.00	726,471.06	
		US TREASURY N/B	530,000.00	581,830.23	
		US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,378,726.52	
		US TREASURY N/B	780,000.00	659,313.25	
		US TREASURY N/B	1,030,000.00	898,172.05	
		US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,058,240.56	
		US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,222,562.50	
		US TREASURY N/B	1,280,000.00	1,410,699.87	
		米ドル 小計	154,270,000.00	161,318,295.61 (17,832,124,396)	
	カナダドル	GOV OF CANADA	250,000.00	250,065.00	
		GOV OF CANADA	380,000.00	383,223.16	
		GOV OF CANADA	270,000.00	269,901.72	
		GOV OF CANADA	290,000.00	289,662.15	
		GOV OF CANADA	300,000.00	306,769.80	
		GOV OF CANADA	260,000.00	259,349.74	
		GOV OF CANADA	270,000.00	275,502.60	
		GOV OF CANADA	170,000.00	169,302.32	
		GOV OF CANADA	340,000.00	350,966.02	
		GOV OF CANADA	210,000.00	219,349.41	
		GOV OF CANADA	450,000.00	446,301.00	

		GOV OF CANADA	70,000.00	73,829.21	
		GOV OF CANADA	280,000.00	287,694.68	
		GOV OF CANADA	200,000.00	204,137.40	
		GOV OF CANADA	150,000.00	158,988.45	
		GOV OF CANADA	460,000.00	455,825.50	
		GOV OF CANADA	300,000.00	292,599.60	
		GOV OF CANADA	130,000.00	134,295.20	
		GOV OF CANADA	70,000.00	70,458.08	
		GOV OF CANADA	220,000.00	221,280.18	
		GOV OF CANADA	150,000.00	160,108.20	
		GOV OF CANADA	120,000.00	162,292.20	
		GOV OF CANADA	300,000.00	327,165.60	
		GOV OF CANADA	500,000.00	504,171.50	
		GOV OF CANADA	460,000.00	431,295.08	
		GOV OF CANADA	140,000.00	143,099.04	
		GOV OF CANADA	100,000.00	147,553.60	
		GOV OF CANADA	120,000.00	178,789.08	
		GOV OF CANADA	160,000.00	224,147.52	
		GOV OF CANADA	180,000.00	243,591.30	
		GOV OF CANADA	220,000.00	267,379.64	
		GOV OF CANADA	660,000.00	694,046.76	
		GOV OF CANADA	70,000.00	88,908.68	
	カナダドル 小計		8,250,000.00	8,692,049.42 (763,770,382)	
	メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,820,000.00	4,906,663.60	
		UNITED MEXICAN STATE	4,050,000.00	4,229,075.20	
		UNITED MEXICAN STATE	4,600,000.00	4,823,606.00	
		UNITED MEXICAN STATE	3,530,000.00	3,921,426.16	
		UNITED MEXICAN STATE	5,460,000.00	5,285,240.68	
		UNITED MEXICAN STATE	4,780,000.00	4,954,452.30	
		UNITED MEXICAN STATE	4,720,000.00	5,170,662.29	
		UNITED MEXICAN STATE	2,210,000.00	2,329,980.90	
		UNITED MEXICAN STATE	2,540,000.00	2,677,617.20	
		UNITED MEXICAN STATE	980,000.00	1,226,914.52	
		UNITED MEXICAN STATE	3,040,000.00	3,328,742.24	
		UNITED MEXICAN STATE	2,700,000.00	2,746,692.72	

	UNITED MEXICAN STATE	3,920,000.00	4,077,197.09	
	メキシコペソ 小計	47,350,000.00	49,678,270.90 (273,573,270)	
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	181,494.00	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	126,582.36	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	182,226.96	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	131,850.55	
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	232,340.68	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	194,011.85	
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	161,698.80	
	GOV OF AUSTRIA	40,000.00	41,002.60	
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	226,994.85	
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	151,165.04	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	193,021.20	
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	201,847.64	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	183,815.97	
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	140,671.96	
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	191,956.01	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	163,998.40	
	GOV OF AUSTRIA	300,000.00	305,671.70	
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	78,676.68	
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	343,425.40	
	GOV OF AUSTRIA	100,000.00	95,127.00	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	264,136.56	
	GOV OF AUSTRIA	160,000.00	205,372.00	
	GOV OF AUSTRIA	70,000.00	76,469.96	
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	132,185.88	
	GOV OF AUSTRIA	60,000.00	63,076.56	
	GOV OF AUSTRIA	84,000.00	155,414.86	
	GOV OF AUSTRIA	40,000.00	57,784.56	
	GOV OF BELGIUM	260,000.00	275,304.56	
	GOV OF BELGIUM	160,000.00	169,195.84	
	GOV OF BELGIUM	200,000.00	204,196.00	
	GOV OF BELGIUM	260,000.00	285,416.82	
	GOV OF BELGIUM	210,000.00	218,346.07	

		GOV OF BELGIUM	350,000.00	370,477.80	
		GOV OF BELGIUM	130,000.00	161,964.27	
		GOV OF BELGIUM	290,000.00	313,380.03	
		GOV OF BELGIUM	240,000.00	259,343.76	
		GOV OF BELGIUM	140,000.00	144,506.60	
		GOV OF BELGIUM	260,000.00	366,975.96	
		GOV OF BELGIUM	270,000.00	293,694.12	
		GOV OF BELGIUM	350,000.00	384,736.45	
		GOV OF BELGIUM	250,000.00	257,979.02	
		GOV OF BELGIUM	180,000.00	201,218.40	
		GOV OF BELGIUM	80,000.00	80,851.20	
		GOV OF BELGIUM	70,000.00	101,194.87	
		GOV OF BELGIUM	400,000.00	461,306.40	
		GOV OF BELGIUM	120,000.00	165,780.36	
		GOV OF BELGIUM	260,000.00	435,516.12	
		GOV OF BELGIUM	220,000.00	261,910.66	
		GOV OF BELGIUM	100,000.00	126,734.30	
		GOV OF BELGIUM	80,000.00	80,009.00	
		GOV OF BELGIUM	250,000.00	433,180.00	
		GOV OF BELGIUM	140,000.00	241,960.04	
		GOV OF BELGIUM	190,000.00	235,464.72	
		GOV OF BELGIUM	140,000.00	178,042.42	
		GOV OF BELGIUM	100,000.00	147,591.60	
		GOV OF BELGIUM	110,000.00	164,595.75	
		GOV OF BELGIUM	80,000.00	72,730.06	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	82,130.80	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	93,485.25	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	60,955.20	
		GOV OF FINLAND	30,000.00	32,272.50	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	51,139.85	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	95,105.03	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	85,220.56	
		GOV OF FINLAND	90,000.00	94,992.84	
		GOV OF FINLAND	80,000.00	85,207.52	
		GOV OF FINLAND	100,000.00	123,139.90	

		GOV OF FINLAND	140,000.00	149,713.34	
		GOV OF FINLAND	120,000.00	128,572.44	
		GOV OF FINLAND	160,000.00	163,909.76	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	65,876.82	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	61,815.24	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	57,449.60	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	60,443.47	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	50,622.20	
		GOV OF FINLAND	60,000.00	90,511.80	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	64,034.25	
		GOV OF FINLAND	50,000.00	46,756.45	
		GOV OF FRANCE	480,000.00	497,789.76	
		GOV OF FRANCE	300,000.00	303,321.00	
		GOV OF FRANCE	660,000.00	667,625.37	
		GOV OF FRANCE	1,050,000.00	1,097,439.00	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	623,041.55	
		GOV OF FRANCE	90,000.00	91,578.85	
		GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,151,058.68	
		GOV OF FRANCE	600,000.00	650,702.10	
		GOV OF FRANCE	520,000.00	562,684.20	
		GOV OF FRANCE	790,000.00	809,151.07	
		GOV OF FRANCE	750,000.00	783,487.50	
		GOV OF FRANCE	340,000.00	437,866.28	
		GOV OF FRANCE	610,000.00	653,699.18	
		GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,058,550.57	
		GOV OF FRANCE	440,000.00	527,261.24	
		GOV OF FRANCE	760,000.00	800,839.36	
		GOV OF FRANCE	640,000.00	667,932.34	
		GOV OF FRANCE	160,000.00	164,521.60	
		GOV OF FRANCE	630,000.00	686,281.05	
		GOV OF FRANCE	780,000.00	940,742.40	
		GOV OF FRANCE	880,000.00	951,426.08	
		GOV OF FRANCE	800,000.00	866,885.98	
		GOV OF FRANCE	620,000.00	906,705.17	
		GOV OF FRANCE	690,000.00	734,729.94	

		GOV OF FRANCE	880,000.00	900,051.68	
		GOV OF FRANCE	710,000.00	884,653.61	
		GOV OF FRANCE	750,000.00	762,318.75	
		GOV OF FRANCE	750,000.00	872,673.00	
		GOV OF FRANCE	490,000.00	494,087.87	
		GOV OF FRANCE	440,000.00	730,832.96	
		GOV OF FRANCE	560,000.00	642,928.16	
		GOV OF FRANCE	410,000.00	672,393.44	
		GOV OF FRANCE	870,000.00	1,003,195.26	
		GOV OF FRANCE	420,000.00	685,750.80	
		GOV OF FRANCE	430,000.00	539,683.66	
		GOV OF FRANCE	310,000.00	315,698.11	
		GOV OF FRANCE	600,000.00	1,073,080.80	
		GOV OF FRANCE	180,000.00	180,314.46	
		GOV OF FRANCE	380,000.00	615,554.40	
		GOV OF FRANCE	450,000.00	606,933.90	
		GOV OF FRANCE	520,000.00	636,236.64	
		GOV OF FRANCE	570,000.00	577,443.06	
		GOV OF FRANCE	300,000.00	596,258.40	
		GOV OF FRANCE	260,000.00	542,622.73	
		GOV OF FRANCE	210,000.00	283,491.18	
		GOV OF FRANCE	140,000.00	118,592.60	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	368,415.72	
		GOV OF GERMANY	260,000.00	266,501.30	
		GOV OF GERMANY	240,000.00	242,041.92	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	292,625.66	
		GOV OF GERMANY	220,000.00	222,264.06	
		GOV OF GERMANY	270,000.00	279,548.55	
		GOV OF GERMANY	560,000.00	566,719.93	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	293,808.86	
		GOV OF GERMANY	370,000.00	385,165.56	
		GOV OF GERMANY	230,000.00	233,200.22	
		GOV OF GERMANY	480,000.00	507,708.48	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	325,604.80	
		GOV OF GERMANY	320,000.00	341,070.40	

		GOV OF GERMANY	570,000.00	582,240.46	
		GOV OF GERMANY	290,000.00	308,912.06	
		GOV OF GERMANY	670,000.00	707,254.01	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	369,222.12	
		GOV OF GERMANY	380,000.00	397,738.40	
		GOV OF GERMANY	300,000.00	308,759.70	
		GOV OF GERMANY	380,000.00	407,825.88	
		GOV OF GERMANY	480,000.00	495,765.60	
		GOV OF GERMANY	520,000.00	550,475.64	
		GOV OF GERMANY	390,000.00	403,782.60	
		GOV OF GERMANY	530,000.00	549,923.76	
		GOV OF GERMANY	460,000.00	484,938.21	
		GOV OF GERMANY	140,000.00	201,722.36	
		GOV OF GERMANY	520,000.00	557,949.86	
		GOV OF GERMANY	550,000.00	572,948.20	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	241,247.00	
		GOV OF GERMANY	460,000.00	495,530.62	
		GOV OF GERMANY	190,000.00	263,502.45	
		GOV OF GERMANY	330,000.00	350,864.47	
		GOV OF GERMANY	60,000.00	62,610.32	
		GOV OF GERMANY	530,000.00	564,730.10	
		GOV OF GERMANY	630,000.00	659,085.51	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	335,390.58	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	324,452.82	
		GOV OF GERMANY	660,000.00	690,365.28	
		GOV OF GERMANY	170,000.00	178,861.76	
		GOV OF GERMANY	370,000.00	587,523.00	
		GOV OF GERMANY	160,000.00	167,154.56	
		GOV OF GERMANY	70,000.00	72,977.47	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	353,374.56	
		GOV OF GERMANY	650,000.00	670,092.80	
		GOV OF GERMANY	180,000.00	184,248.83	
		GOV OF GERMANY	440,000.00	735,883.72	
		GOV OF GERMANY	310,000.00	563,063.23	
		GOV OF GERMANY	340,000.00	664,333.48	

		GOV OF GERMANY	310,000.00	532,886.90	
		GOV OF GERMANY	470,000.00	751,834.56	
		GOV OF GERMANY	520,000.00	850,835.35	
		GOV OF GERMANY	440,000.00	584,684.76	
		GOV OF GERMANY	360,000.00	353,049.48	
		GOV OF GERMANY	210,000.00	208,296.48	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	120,964.68	
		GOV OF IRELAND	90,000.00	96,804.79	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	121,855.80	
		GOV OF IRELAND	180,000.00	219,808.98	
		GOV OF IRELAND	210,000.00	225,973.65	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	114,367.22	
		GOV OF IRELAND	150,000.00	163,287.45	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	133,048.32	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	135,621.09	
		GOV OF IRELAND	150,000.00	154,782.90	
		GOV OF IRELAND	150,000.00	171,812.55	
		GOV OF IRELAND	90,000.00	90,390.06	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	126,396.60	
		GOV OF IRELAND	90,000.00	92,692.80	
		GOV OF IRELAND	120,000.00	146,586.84	
		GOV OF IRELAND	50,000.00	50,986.30	
		GOV OF IRELAND	130,000.00	173,642.30	
		GOV OF IRELAND	110,000.00	134,343.88	
		GOV OF ITALY	210,000.00	213,038.70	
		GOV OF ITALY	270,000.00	273,825.90	
		GOV OF ITALY	230,000.00	245,144.28	
		GOV OF ITALY	610,000.00	623,474.90	
		GOV OF ITALY	340,000.00	365,695.50	
		GOV OF ITALY	260,000.00	262,006.68	
		GOV OF ITALY	240,000.00	245,387.30	
		GOV OF ITALY	200,000.00	204,574.96	
		GOV OF ITALY	370,000.00	402,465.65	
		GOV OF ITALY	280,000.00	285,566.84	
		GOV OF ITALY	340,000.00	375,612.28	

		GOV OF ITALY	180,000.00	182,590.27	
		GOV OF ITALY	340,000.00	361,129.30	
		GOV OF ITALY	440,000.00	450,136.72	
		GOV OF ITALY	460,000.00	463,726.00	
		GOV OF ITALY	200,000.00	225,129.20	
		GOV OF ITALY	490,000.00	493,838.35	
		GOV OF ITALY	230,000.00	243,903.66	
		GOV OF ITALY	550,000.00	582,642.50	
		GOV OF ITALY	270,000.00	303,705.66	
		GOV OF ITALY	200,000.00	211,178.24	
		GOV OF ITALY	340,000.00	371,182.31	
		GOV OF ITALY	300,000.00	305,965.41	
		GOV OF ITALY	290,000.00	344,630.20	
		GOV OF ITALY	350,000.00	371,652.12	
		GOV OF ITALY	270,000.00	287,490.60	
		GOV OF ITALY	340,000.00	366,698.77	
		GOV OF ITALY	220,000.00	244,854.96	
		GOV OF ITALY	400,000.00	436,860.08	
		GOV OF ITALY	240,000.00	246,293.37	
		GOV OF ITALY	270,000.00	327,129.32	
		GOV OF ITALY	540,000.00	541,117.08	
		GOV OF ITALY	240,000.00	258,971.40	
		GOV OF ITALY	300,000.00	331,639.20	
		GOV OF ITALY	590,000.00	628,427.23	
		GOV OF ITALY	390,000.00	406,709.55	
		GOV OF ITALY	210,000.00	235,838.82	
		GOV OF ITALY	240,000.00	267,616.96	
		GOV OF ITALY	290,000.00	304,120.68	
		GOV OF ITALY	450,000.00	627,649.06	
		GOV OF ITALY	420,000.00	469,315.98	
		GOV OF ITALY	460,000.00	460,871.59	
		GOV OF ITALY	70,000.00	71,076.83	
		GOV OF ITALY	350,000.00	460,090.75	
		GOV OF ITALY	440,000.00	520,102.00	
		GOV OF ITALY	490,000.00	591,713.22	

		GOV OF ITALY	360,000.00	503,140.75	
		GOV OF ITALY	320,000.00	402,903.68	
		GOV OF ITALY	510,000.00	548,887.50	
		GOV OF ITALY	280,000.00	290,865.12	
		GOV OF ITALY	370,000.00	407,223.06	
		GOV OF ITALY	490,000.00	504,774.48	
		GOV OF ITALY	400,000.00	606,937.60	
		GOV OF ITALY	390,000.00	389,133.30	
		GOV OF ITALY	180,000.00	185,017.32	
		GOV OF ITALY	330,000.00	362,736.00	
		GOV OF ITALY	320,000.00	496,497.60	
		GOV OF ITALY	330,000.00	391,542.16	
		GOV OF ITALY	370,000.00	556,314.61	
		GOV OF ITALY	260,000.00	339,281.80	
		GOV OF ITALY	250,000.00	264,826.50	
		GOV OF ITALY	270,000.00	315,630.00	
		GOV OF ITALY	390,000.00	550,861.74	
		GOV OF ITALY	240,000.00	234,845.52	
		GOV OF ITALY	290,000.00	369,277.30	
		GOV OF ITALY	400,000.00	645,498.00	
		GOV OF ITALY	200,000.00	260,752.00	
		GOV OF ITALY	280,000.00	457,138.08	
		GOV OF ITALY	280,000.00	302,833.85	
		GOV OF ITALY	230,000.00	380,467.61	
		GOV OF ITALY	210,000.00	212,662.17	
		GOV OF ITALY	300,000.00	408,979.80	
		GOV OF ITALY	310,000.00	386,880.31	
		GOV OF ITALY	220,000.00	311,430.90	
		GOV OF ITALY	220,000.00	333,715.80	
		GOV OF ITALY	250,000.00	299,205.00	
		GOV OF ITALY	190,000.00	193,528.30	
		GOV OF ITALY	130,000.00	160,960.28	
		GOV OF ITALY	110,000.00	113,568.95	
		GOV OF NETHERLANDS	200,000.00	205,823.80	
		GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	202,814.62	

		GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	304,562.40	
		GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	315,999.74	
		GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	292,438.62	
		GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	301,324.50	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	264,824.25	
		GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	310,199.40	
		GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	324,738.00	
		GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	210,201.91	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	272,639.50	
		GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	263,932.50	
		GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	341,014.08	
		GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	123,496.68	
		GOV OF NETHERLANDS	230,000.00	303,853.00	
		GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	460,247.76	
		GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	120,366.84	
		GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	175,396.00	
		GOV OF NETHERLANDS	260,000.00	461,145.36	
		GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	506,029.50	
		GOV OF NETHERLANDS	130,000.00	124,460.57	
		GOV OF SPAIN	270,000.00	273,692.52	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	305,539.02	
		GOV OF SPAIN	470,000.00	474,748.57	
		GOV OF SPAIN	470,000.00	478,652.70	
		GOV OF SPAIN	260,000.00	289,447.86	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	283,880.12	
		GOV OF SPAIN	400,000.00	448,238.80	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	286,412.00	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	365,539.68	
		GOV OF SPAIN	640,000.00	650,854.40	
		GOV OF SPAIN	370,000.00	399,200.40	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	410,617.82	
		GOV OF SPAIN	390,000.00	433,650.36	
		GOV OF SPAIN	390,000.00	396,718.92	
		GOV OF SPAIN	220,000.00	244,653.20	
		GOV OF SPAIN	360,000.00	474,218.70	

		GOV OF SPAIN	450,000.00	489,436.20	
		GOV OF SPAIN	330,000.00	364,344.75	
		GOV OF SPAIN	240,000.00	254,894.88	
		GOV OF SPAIN	640,000.00	706,941.11	
		GOV OF SPAIN	600,000.00	662,769.90	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	332,215.10	
		GOV OF SPAIN	200,000.00	276,706.00	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	496,405.10	
		GOV OF SPAIN	430,000.00	479,654.25	
		GOV OF SPAIN	420,000.00	440,078.94	
		GOV OF SPAIN	320,000.00	331,825.28	
		GOV OF SPAIN	370,000.00	431,682.70	
		GOV OF SPAIN	400,000.00	441,088.00	
		GOV OF SPAIN	370,000.00	366,263.69	
		GOV OF SPAIN	100,000.00	102,299.20	
		GOV OF SPAIN	310,000.00	494,538.97	
		GOV OF SPAIN	390,000.00	479,683.62	
		GOV OF SPAIN	360,000.00	423,201.60	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	460,727.33	
		GOV OF SPAIN	120,000.00	122,293.44	
		GOV OF SPAIN	350,000.00	607,047.13	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	264,629.16	
		GOV OF SPAIN	340,000.00	582,152.67	
		GOV OF SPAIN	250,000.00	469,799.03	
		GOV OF SPAIN	280,000.00	396,216.95	
		GOV OF SPAIN	240,000.00	330,989.52	
		GOV OF SPAIN	300,000.00	287,826.60	
		GOV OF SPAIN	240,000.00	393,192.96	
		GOV OF SPAIN	80,000.00	76,125.60	
		ユーロ 小計	103,864,000.00	121,181,185.66 (15,758,401,383)	
	英ポンド	UK TREASURY	470,000.00	472,032.84	
		UK TREASURY	320,000.00	326,006.40	
		UK TREASURY	580,000.00	580,476.97	
		UK TREASURY	310,000.00	314,211.35	

		UK TREASURY	230,000.00	240,561.41	
		UK TREASURY	460,000.00	459,436.04	
		UK TREASURY	330,000.00	337,825.98	
		UK TREASURY	250,000.00	270,119.90	
		UK TREASURY	250,000.00	293,235.90	
		UK TREASURY	210,000.00	213,377.01	
		UK TREASURY	190,000.00	203,877.52	
		UK TREASURY	310,000.00	307,884.80	
		UK TREASURY	220,000.00	233,191.46	
		UK TREASURY	180,000.00	180,189.00	
		UK TREASURY	280,000.00	294,654.64	
		UK TREASURY	180,000.00	223,721.24	
		UK TREASURY	300,000.00	294,104.16	
		UK TREASURY	310,000.00	336,291.10	
		UK TREASURY	140,000.00	196,041.69	
		UK TREASURY	220,000.00	226,054.59	
		UK TREASURY	160,000.00	156,585.60	
		UK TREASURY	340,000.00	468,777.44	
		UK TREASURY	380,000.00	364,198.21	
		UK TREASURY	210,000.00	288,068.59	
		UK TREASURY	180,000.00	263,340.00	
		UK TREASURY	490,000.00	473,701.62	
		UK TREASURY	270,000.00	396,887.09	
		UK TREASURY	480,000.00	540,197.56	
		UK TREASURY	190,000.00	307,877.67	
		UK TREASURY	210,000.00	326,331.60	
		UK TREASURY	190,000.00	300,749.82	
		UK TREASURY	640,000.00	669,503.48	
		UK TREASURY	340,000.00	570,672.04	
		UK TREASURY	190,000.00	276,043.02	
		UK TREASURY	280,000.00	426,197.29	
		UK TREASURY	130,000.00	125,661.68	
		UK TREASURY	240,000.00	413,896.80	
		UK TREASURY	300,000.00	333,279.12	
		UK TREASURY	160,000.00	188,461.05	

	UK TREASURY	160,000.00	288,630.40	
	UK TREASURY	360,000.00	325,221.84	
	UK TREASURY	160,000.00	169,440.00	
	UK TREASURY	190,000.00	329,460.38	
	UK TREASURY	300,000.00	353,636.22	
	UK TREASURY	230,000.00	450,681.18	
	UK TREASURY	290,000.00	360,215.38	
	UK TREASURY	190,000.00	378,850.12	
	UK TREASURY	210,000.00	180,899.37	
	UK TREASURY	230,000.00	363,354.00	
	UK TREASURY	240,000.00	480,490.80	
	UK TREASURY	140,000.00	185,300.82	
英ポンド 小計		13,820,000.00	16,759,904.19 (2,546,332,243)	
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,680,000.00	1,750,906.74	
	GOV OF SWEDEN	1,170,000.00	1,294,243.00	
	GOV OF SWEDEN	1,100,000.00	1,168,381.50	
	GOV OF SWEDEN	1,060,000.00	1,117,589.80	
	GOV OF SWEDEN	910,000.00	962,925.60	
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	928,185.19	
	GOV OF SWEDEN	500,000.00	610,837.50	
	GOV OF SWEDEN	690,000.00	1,042,640.22	
スウェーデンクローナ 小計		8,040,000.00	8,875,709.55 (112,721,511)	
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,330,000.00	1,365,218.40	
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	1,122,317.40	
	GOV OF NORWAY	750,000.00	773,970.00	
	GOV OF NORWAY	790,000.00	810,181.65	
	GOV OF NORWAY	620,000.00	645,356.76	
	GOV OF NORWAY	640,000.00	679,264.00	
	GOV OF NORWAY	620,000.00	649,729.00	
	GOV OF NORWAY	920,000.00	936,454.20	
	GOV OF NORWAY	480,000.00	482,520.00	
ノルウェークローネ 小計		7,210,000.00	7,465,011.41 (93,014,042)	
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,110,000.00	1,122,205.43	

	GOV OF DENMARK	970,000.00	1,017,875.32	
	GOV OF DENMARK	1,070,000.00	1,177,949.71	
	GOV OF DENMARK	1,150,000.00	1,217,257.75	
	GOV OF DENMARK	1,740,000.00	1,855,353.30	
	GOV OF DENMARK	480,000.00	485,828.88	
	GOV OF DENMARK	1,910,000.00	3,452,197.03	
	GOV OF DENMARK	550,000.00	541,882.00	
デンマーククローネ 小計		8,980,000.00	10,870,549.42 (190,125,909)	
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	500,000.00	499,884.10	
	GOV OF POLAND	500,000.00	533,388.00	
	GOV OF POLAND	560,000.00	579,663.44	
	GOV OF POLAND	180,000.00	178,947.00	
	GOV OF POLAND	470,000.00	508,422.50	
	GOV OF POLAND	420,000.00	443,247.00	
	GOV OF POLAND	410,000.00	431,074.00	
	GOV OF POLAND	570,000.00	571,936.74	
	GOV OF POLAND	510,000.00	558,970.20	
	GOV OF POLAND	1,110,000.00	1,190,475.00	
	GOV OF POLAND	130,000.00	124,189.00	
	GOV OF POLAND	450,000.00	485,640.00	
	GOV OF POLAND	530,000.00	582,973.50	
	GOV OF POLAND	80,000.00	105,736.00	
	GOV OF POLAND	850,000.00	940,270.00	
	GOV OF POLAND	550,000.00	536,855.00	
ポーランドズロチ 小計		7,820,000.00	8,271,671.48 (234,857,568)	
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	320,000.00	337,833.88	
	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	422,175.56	
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	372,262.90	
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	236,332.31	
	GOV OF AUSTRALIA	550,000.00	549,747.47	
	GOV OF AUSTRALIA	240,000.00	265,752.90	
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	306,988.07	
	GOV OF AUSTRALIA	480,000.00	563,334.00	

		GOV OF AUSTRALIA	510,000.00	506,918.97	
		GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	159,689.15	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	347,749.97	
		GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	382,676.49	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	350,831.03	
		GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	468,912.00	
		GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	375,810.17	
		GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	527,051.37	
		GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	563,381.84	
		GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	340,590.88	
		GOV OF AUSTRALIA	520,000.00	510,142.77	
		GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	310,787.86	
		GOV OF AUSTRALIA	230,000.00	241,801.63	
		GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	243,687.69	
		GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	255,846.58	
		GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	220,450.30	
		GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	208,297.75	
		GOV OF AUSTRALIA	200,000.00	228,502.84	
		GOV OF AUSTRALIA	210,000.00	250,548.44	
		GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	241,717.00	
	オーストラリアドル 小計		9,050,000.00	9,789,821.82 (795,520,921)	
シンガポールドル		GOV OF SINGAPORE	140,000.00	144,284.00	
		GOV OF SINGAPORE	150,000.00	153,168.00	
		GOV OF SINGAPORE	110,000.00	115,038.00	
		GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,965.00	
		GOV OF SINGAPORE	140,000.00	150,738.00	
		GOV OF SINGAPORE	90,000.00	96,048.00	
		GOV OF SINGAPORE	80,000.00	79,320.00	
		GOV OF SINGAPORE	100,000.00	106,216.50	
		GOV OF SINGAPORE	120,000.00	136,680.00	
		GOV OF SINGAPORE	190,000.00	208,905.00	
		GOV OF SINGAPORE	30,000.00	33,720.00	
		GOV OF SINGAPORE	160,000.00	181,440.00	
		GOV OF SINGAPORE	90,000.00	108,270.00	
		GOV OF SINGAPORE	130,000.00	140,292.10	

	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	54,892.75	
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	93,280.00	
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	118,650.00	
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	123,843.60	
シンガポールドル 小計		1,930,000.00	2,096,750.95 (170,214,242)	
マレーシアリンギット	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,426.01	
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	153,521.64	
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	328,048.48	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,378.34	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	124,309.46	
	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	268,939.65	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	284,564.90	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	105,324.71	
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	105,157.20	
	GOV OF MALAYSIA	410,000.00	432,973.53	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	205,149.17	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	137,800.66	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	127,610.37	
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	281,543.47	
	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	829,454.41	
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	83,826.04	
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	200,138.24	
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	274,252.12	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	162,947.07	
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	224,955.27	
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	132,614.10	
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	305,537.56	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	221,742.48	
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	233,104.00	
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	363,511.26	
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	133,831.50	
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	165,443.09	
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	153,040.74	
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	191,275.66	

		GOV OF MALAYSIA	150,000.00	162,978.82	
		GOV OF MALAYSIA	240,000.00	236,973.45	
	マレーシアリンギット 小計		6,580,000.00	6,917,373.40 (180,846,426)	
	イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	380,000.00	382,755.00	
		GOV OF ISRAEL	190,000.00	194,664.50	
		GOV OF ISRAEL	240,000.00	240,360.00	
		GOV OF ISRAEL	520,000.00	542,178.00	
		GOV OF ISRAEL	390,000.00	432,568.50	
		GOV OF ISRAEL	430,000.00	434,278.50	
		GOV OF ISRAEL	280,000.00	300,706.00	
		GOV OF ISRAEL	210,000.00	283,111.50	
		GOV OF ISRAEL	310,000.00	337,295.50	
		GOV OF ISRAEL	280,000.00	313,614.00	
		GOV OF ISRAEL	490,000.00	489,853.00	
		GOV OF ISRAEL	210,000.00	202,524.00	
		GOV OF ISRAEL	340,000.00	555,373.00	
		GOV OF ISRAEL	390,000.00	515,170.50	
	イスラエルシュケル 小計		4,660,000.00	5,224,452.00 (176,609,465)	
合計				39,128,111,758 (39,128,111,758)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	国債証券	231銘柄	100.0%	45.5%
カナダドル	国債証券	33銘柄	100.0%	2.0%
メキシコペソ	国債証券	13銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券	341銘柄	100.0%	40.3%
英ポンド	国債証券	51銘柄	100.0%	6.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.3%
ノルウェークローネ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.2%

デンマーククローネ	国債証券	8銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券	16銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券	28銘柄	100.0%	2.0%
シンガポールドル	国債証券	18銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリンギット	国債証券	31銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシュケル	国債証券	14銘柄	100.0%	0.5%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	
流動資産	
預金	45,592,090
コール・ローン	19,399,272
投資信託受益証券	6,161,172,975
未収配当金	93,760,666
流動資産合計	6,319,925,003
資産合計	6,319,925,003
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	352,692
未払解約金	38,929,000
未払利息	52
流動負債合計	39,281,744
負債合計	39,281,744
純資産の部	
元本等	
元本	5,682,327,776
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	598,315,483

	2021年 7月26日現在
元本等合計	6,280,643,259
純資産合計	6,280,643,259
負債純資産合計	6,319,925,003

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26日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	4,492,026,466円
期中追加設定元本額	4,365,911,451円
期中一部解約元本額	3,175,610,141円
期末元本額	5,682,327,776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	15,766,249円
つみたてバランスファンド	700,909,161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	1,127,680,402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	
	5,682,327,776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	1.1053円
(10,000口当たり純資産額)	(11,053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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
１.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 ２.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 ３.金融商品に係るリスク管理体制

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

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

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在

1 .貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2 .時価の算定方法

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）

投資信託受益証券	△300,978,431
合計	△300,978,431

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2021年 7月26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				
	売建	39,441,240	－	39,793,932	△352,692
	米ドル	39,441,240	－	39,793,932	△352,692
合計		39,441,240	－	39,793,932	△352,692

（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。

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	698,547	38,287,361.07	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	564,532	17,449,684.12	
	米ドル 小計		1,263,079	55,737,045.19 (6,161,172,975)	
合計				6,161,172,975 (6,161,172,975)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	2021年 7月26日現在
資産の部	

	2021年 7月26日現在
流動資産	
コール・ローン	343,058,500
投資証券	30,790,045,150
派生商品評価勘定	1,013,080
未収配当金	150,725,604
差入委託証拠金	19,608,000
流動資産合計	31,304,450,334
資産合計	31,304,450,334
負債の部	
流動負債	
前受金	2,322,000
未払解約金	135,221,000
未払利息	930
流動負債合計	137,543,930
負債合計	137,543,930
純資産の部	
元本等	
元本	20,370,688,860
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	10,796,217,544
元本等合計	31,166,906,404
純資産合計	31,166,906,404
負債純資産合計	31,304,450,334

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26日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	15,468,007,281円
期中追加設定元本額	21,873,477,255円

期中一部解約元本額	16,970,795,676円
期末元本額	20,370,688,860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	1,006,436,019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	2,420,617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	4,241,726,789円
ＦＷりそな国内リートインデックスファンド	3,333,940,726円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　Ｊリートインデックス	2,538,581,341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	
	20,370,688,860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	1.5300円
(10,000口当たり純資産額)	(15,300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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、リートの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 デリバティブ取引 （その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。 3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでも名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
投資証券	3,484,684,314
合計	3,484,684,314

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(投資証券関連)

（2021年 7月26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	不動産投信指数先物取引				
	買建	363,454,920	－	364,468,000	1,013,080
合計		363,454,920	－	364,468,000	1,013,080

（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。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	431	67,236,000	
	サンケイリアルエステート投資法人	652	85,020,800	
	ＳＯＳｉＬＡ物流リート投資法人	700	118,440,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	918	628,830,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,128	514,243,200	
	産業ファンド投資法人	3,764	817,540,800	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,529	959,755,500	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,815	437,778,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,334	649,658,000	
	ＧＬＰ投資法人	8,593	1,641,263,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,197	448,276,500	
	日本プロロジスリート投資法人	4,210	1,528,230,000	
	星野リゾート・リート投資法人	405	274,995,000	
	Ｏｎｅリート投資法人	415	139,232,500	
	イオンリート投資法人	2,701	444,314,500	
	ヒューリックリート投資法人	2,207	414,916,000	
	日本リート投資法人	865	386,222,500	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	16,921	378,184,350	
	積水ハウス・リート投資法人	7,832	751,088,800	
	トーセイ・リート投資法人	589	82,695,600	
	ケネディクス商業リート投資法人	1,059	315,582,000	
	ヘルスケア＆メディカル投資法人	568	87,472,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	513	67,767,300	
	野村不動産マスターファンド投資法人	8,611	1,453,536,800	
	いちごホテルリート投資法人	466	42,266,200	
	ラサールロジポート投資法人	3,221	626,484,500	
	スターアジア不動産投資法人	2,736	171,820,800	
	マリモ地方創生リート投資法人	249	33,216,600	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	929	565,761,000	
	大江戸温泉リート投資法人	430	36,163,000	
	投資法人みらい	2,876	162,206,400	

	森トラスト・ホテルリート投資法人	577	80,203,000	
	三菱地所物流リート投資法人	670	329,305,000	
	ＣＲＥロジスティクスファンド投資法人	852	172,018,800	
	ザイマックス・リート投資法人	408	50,592,000	
	タカラレーベン不動産投資法人	800	101,920,000	
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,033	166,726,200	
	日本ビルファンド投資法人	2,997	2,067,930,000	
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,663	1,797,525,000	
	日本都市ファンド投資法人	13,263	1,493,413,800	
	オリックス不動産投資法人	5,305	1,103,440,000	
	日本プライムリアルティ投資法人	1,658	697,189,000	
	ＮＴＴ都市開発リート投資法人	2,405	377,825,500	
	東急リアル・エステート投資法人	1,785	362,712,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	1,849	232,049,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,695	892,406,500	
	森トラスト総合リート投資法人	1,903	296,297,100	
	インヴィンシブル投資法人	11,134	477,648,600	
	フロンティア不動産投資法人	933	469,299,000	
	平和不動産リート投資法人	1,721	297,733,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,740	591,600,000	
	福岡リート投資法人	1,377	248,548,500	
	ケネディクス・オフィス投資法人	824	647,664,000	
	いちごオフィスリート投資法人	2,182	211,435,800	
	大和証券オフィス投資法人	563	434,636,000	
	阪急阪神リート投資法人	1,203	195,126,600	
	スターツプロシード投資法人	415	102,173,000	
	大和ハウスリート投資法人	3,799	1,221,378,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,578	560,143,400	
	大和証券リビング投資法人	3,477	414,458,400	
	ジャパンエクセレント投資法人	2,471	366,449,300	
合計		167,144	30,790,045,150	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

ＲＭ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26日現在
資産の部	
流動資産	
預金	22,436,973
コール・ローン	176,653,169
株式	84,504,526
投資証券	25,052,789,674
派生商品評価勘定	1,496
未収入金	22,172,558
未収配当金	44,070,561
流動資産合計	25,402,628,957
資産合計	25,402,628,957
負債の部	
流動負債	
未払解約金	165,979,000
未払利息	479
流動負債合計	165,979,479
負債合計	165,979,479
純資産の部	
元本等	
元本	18,755,516,279
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,481,133,199
元本等合計	25,236,649,478
純資産合計	25,236,649,478
負債純資産合計	25,402,628,957

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26日現在	
1． 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 7月28日
期首元本額	21,226,241,671円
期中追加設定元本額	19,397,208,417円
期中一部解約元本額	21,867,933,809円
期末元本額	18,755,516,279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	589,245,476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	15,409,280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	5,163,771,429円
ＦＷりそな先進国リートインデックスファンド	3,949,716,333円
Ｓｍａｒｔ－ｉ　先進国リートインデックス	1,764,832,136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	
	18,755,516,279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	1.3456円
(10,000口当たり純資産額)	(13,456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）

Ⅰ金融商品の状況に関する事項

2021年 7月26日現在
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第４項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

Ⅱ金融商品の時価等に関する事項

2021年 7月26日現在

1 .貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2 .時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2　デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3 .金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 7月26日現在
該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1　有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	2021年 7月26日現在
	損益に含まれた評価差額（円）
株式	8,454,502
投資証券	3,722,323,809
合計	3,730,778,311

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

2　デリバティブ取引に関する注記

(通貨関連)

（2021年 7月26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	24,316,446	－	24,317,942	1,496
	米ドル	24,316,446	－	24,317,942	1,496
合計		24,316,446	－	24,317,942	1,496

（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。

①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。

②計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

※上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第１　有価証券明細表

(1)株式

通 貨	銘　柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BROADSTONE NET LEASE INC-A	22,199	25.27	560,968.73	
米ドル 小計		22,199		560,968.73 (62,009,483)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	92,276	3.00	276,828.00	
オーストラリアドル 小計		92,276		276,828.00 (22,495,043)	

合　計	114,475		84,504,526 (84,504,526)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種　類	通貨	銘　柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	12,803	268,478.91	
		AGREE REALTY CORP	10,280	771,000.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,826	201,363.60	
		ALEXANDER'S INC	282	79,267.38	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,283	3,994,534.02	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,448	272,373.36	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20,624	1,037,799.68	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	14,353	120,565.20	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40,099	1,685,360.97	
		AMERICOLD REALTY TRUST	37,585	1,477,090.50	
		APARTMENT INCOME REIT CO	23,001	1,197,202.05	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	19,728	132,374.88	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	30,985	452,381.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	7,742	101,962.14	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,625	4,677,750.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	41,553.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	20,792	2,389,000.80	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	25,098	350,870.04	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	43,865	979,066.80	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	5,984	111,781.12	
		BRT APARTMENTS CORP	877	15,575.52	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	14,294	2,104,505.62	
		CARETRUST REIT INC	14,780	359,449.60	
		CENTERSPACE	1,720	157,242.40	
		CHATHAM LODGING TRUST	6,046	71,040.50	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	16,300.00	
		CITY OFFICE REIT INC	5,694	72,655.44	

		CLIPPER REALTY INC	1,350	11,124.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	16,563	282,896.04	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,585	177,708.45	
		COREPOINT LODGING INC	4,988	69,432.96	
		CORESITE REALTY CORP	6,358	878,166.96	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,284	486,077.40	
		COUSINS PROPERTIES INC	22,368	887,114.88	
		CTO REALTY GROWTH INC	900	48,807.00	
		CUBESMART	29,526	1,446,183.48	
		CYRUSONE INC	18,273	1,337,949.06	
		DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,908	279,514.08	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	41,545	6,433,658.70	
		DIGITALBRIDGE GROUP INC	71,816	485,476.16	
		DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	31,514	124,165.16	
		DOUGLAS EMMETT INC	24,802	831,115.02	
		DUKE REALTY CORP	54,950	2,818,935.00	
		EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	—	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,183	266,685.87	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	5,780	1,023,811.40	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,548	250,172.28	
		EPR PROPERTIES	10,836	573,116.04	
		EQUINIX INC	13,198	11,000,269.04	
		EQUITY COMMONWEALTH	17,650	468,254.50	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,814	2,044,673.60	
		EQUITY RESIDENTIAL	50,854	4,313,436.28	
		ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,154	499,867.56	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,523	3,160,778.93	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	19,545	3,350,208.45	
		FARMLAND PARTNERS INC	3,259	40,835.27	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,424	1,215,438.40	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,081	1,043,158.27	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,555	307,044.95	
		FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12,675	63,375.00	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32,262	1,524,702.12	

GEO GROUP INC/THE		15,904	106,238.72	
GETTY REALTY CORP		5,766	185,203.92	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP		5,761	132,099.73	
GLADSTONE LAND CORP		4,296	101,729.28	
GLOBAL MEDICAL REIT INC		8,379	130,628.61	
GLOBAL NET LEASE INC		13,494	249,504.06	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC		21,146	673,077.18	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A		31,904	926,492.16	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC		79,034	2,866,563.18	
HERSHA HOSPITALITY TRUST		5,878	55,488.32	
HIGHWOODS PROPERTIES INC		15,706	739,438.48	
HOST HOTELS & RESORTS INC		103,764	1,637,395.92	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN		21,671	595,735.79	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC		15,188	303,760.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT		9,736	262,093.12	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER		3,555	754,904.25	
INVITATION HOMES INC		84,055	3,405,908.60	
IRON MOUNTAIN INC		42,954	1,865,062.68	
JBG SMITH PROPERTIES		16,110	531,630.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT		87,700	68,406.00	
KILROY REALTY CORP		15,579	1,076,664.69	
KIMCO REALTY CORP		64,724	1,346,906.44	
KITE REALTY GROUP TRUST		12,509	242,424.42	
LEXINGTON REALTY TRUST		39,731	510,543.35	
LIFE STORAGE INC		11,266	1,306,067.38	
LTC PROPERTIES INC		5,856	229,379.52	
MACERICH CO/THE		24,792	408,324.24	
MACK-CALI REALTY CORP		12,808	227,726.24	
MANULIFE US REAL ESTATE INV		213,400	165,385.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC		86,537	1,817,277.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM		16,936	3,177,193.60	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR		14,510	273,513.50	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES		25,875	1,281,847.50	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES		10,157	555,689.47	
NATL HEALTH INVESTORS INC		6,595	447,536.70	

		NETSTREIT CORP	3,551	90,195.40	
		NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	112,925.70	
		NEXPOINT RESIDENTIAL	3,640	222,149.20	
		OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	205,807.46	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34,122	1,277,186.46	
		ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	66,310.95	
		PARAMOUNT GROUP INC	24,691	244,193.99	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	35,881	669,539.46	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,727	442,673.88	
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	18,814.90	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	32,660	615,967.60	
		PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18,539	349,830.93	
		PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	91,963.00	
		PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,628	68,400.96	
		PRIME US REIT	58,100	49,094.50	
		PROLOGIS INC	108,954	13,934,127.06	
		PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,989	464,849.28	
		PUBLIC STORAGE	22,455	7,046,379.00	
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,336	803,003.84	
		REALTY INCOME CORP	55,244	3,893,597.12	
		REGENCY CENTERS CORP	23,519	1,529,910.95	
		RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,513	306,827.76	
		RETAIL PROPERTIES OF AME - A	31,321	378,670.89	
		RETAIL VALUE INC	2,135	52,585.05	
		REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,002	1,222,522.24	
		RLJ LODGING TRUST	24,148	347,489.72	
		RPT REALTY	10,705	134,454.80	
		RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,192	650,526.72	
		SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,693	600,897.34	
		SAFEHOLD INC	1,886	164,742.10	
		SAUL CENTERS INC	2,130	95,189.70	
		SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,880	95,138.40	
		SERVICE PROPERTIES TRUST	23,127	263,416.53	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	48,478	6,018,543.70	
		SITE CENTERS CORP	24,350	369,146.00	

		SL GREEN REALTY CORP	10,063	745,668.30	
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,030	851,840.60	
		STAG INDUSTRIAL INC	24,006	964,321.02	
		STORE CAPITAL CORP	35,930	1,317,553.10	
		SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,766	124,857.62	
		SUN COMMUNITIES INC	16,387	3,084,033.40	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30,464	350,336.00	
		TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13,892	246,027.32	
		TERRENO REALTY CORP	9,938	675,982.76	
		UDR INC	43,422	2,385,170.46	
		UMH PROPERTIES INC	6,220	144,241.80	
		UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,693	103,002.12	
		URBAN EDGE PROPERTIES	16,309	307,098.47	
		URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,952	73,428.16	
		VENTAS INC	54,968	3,289,834.80	
		VEREIT INC	33,715	1,658,778.00	
		VICI PROPERTIES INC	78,827	2,519,310.92	
		VORNADO REALTY TRUST	23,088	1,016,333.76	
		WASHINGTON REIT	12,508	308,197.12	
		WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,645	565,345.80	
		WELLTOWER INC	61,625	5,408,210.00	
		WHITESTONE REIT	5,243	42,468.30	
		WP CAREY INC	26,421	2,098,620.03	
		XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,046	284,816.50	
	米ドル 小計		3,646,184	171,003,084.84 (18,902,680,998)	
	カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,935	407,167.95	
		ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,346	98,232.42	
		AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	44,520.00	
		BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,575	158,479.75	
		CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,806	789,617.96	
		CHOICE PROPERTIES REIT	22,900	334,569.00	
		COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,992	156,990.24	
		CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,406	117,614.16	
		CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,346	141,715.08	

		DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,853	206,804.77	
		DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	86,258.04	
		FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,077	289,225.23	
		GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,626	401,953.14	
		H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,239	335,157.84	
		INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	184,775.80	
		KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	164,131.20	
		MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,257	54,506.55	
		MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	41,865.55	
		NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,884	166,976.64	
		PLAZA RETAIL REIT	10,000	44,800.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,137	497,418.39	
		SLATE GROCERY REIT	2,561	33,472.27	
		SLATE OFFICE REIT	4,169	22,262.46	
		SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,562	319,078.02	
		SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,930	245,799.30	
		TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	40,291.15	
		WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,574	151,793.66	
	カナダドル 小計		256,547	5,535,476.57 (486,402,326)	
ユーロ	AEDIFICA		5,390	644,105.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG		26,281	460,968.74	
	ALTAREA		482	90,519.60	
	BEFIMMO		3,878	138,638.50	
	CARE PROPERTY INVEST		4,207	118,216.70	
	CARMILA		6,182	72,453.04	
	COFINIMMO		4,270	571,753.00	
	COVIVIO		7,095	560,221.20	
	CROMWELL REIT EUR		37,440	93,600.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV		5,323	113,166.98	
	GECINA SA		8,108	1,082,823.40	
	HAMBORNER REIT AG		9,356	86,758.18	
	HIBERNIA REIT PLC		105,660	136,301.40	
	ICADE		4,670	351,184.00	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		6,951	28,082.04	

		INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	38,000	341,240.00	
		INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,038	74,886.70	
		IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	68,224	106,838.78	
		KLEPIERRE	28,891	616,245.03	
		LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	41,768.57	
		MERCIALYS	5,259	55,745.40	
		MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	48,236	453,514.87	
		MONTEA NV	1,425	159,315.00	
		NSI NV	2,837	102,132.00	
		RETAIL ESTATES	1,743	118,698.30	
		UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,388	1,469,567.04	
		VASTNED RETAIL NV	2,828	71,407.00	
		WAREHOUSES DE PAUW SCA	19,741	711,860.46	
		WERELDHAVE NV	6,360	94,446.00	
		XIOR STUDENT HOUSING NV	2,620	143,576.00	
	ユーロ 小計		492,900	9,110,032.93 (1,184,668,682)	
英ポンド		AEW UK REIT PLC	20,000	20,560.00	
		ASSURA PLC	386,571	299,785.81	
		BIG YELLOW GROUP PLC	23,812	340,035.36	
		BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	123,187	113,332.04	
		BRITISH LAND CO PLC	139,048	701,080.01	
		CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	131,258	218,150.79	
		CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	107,803.44	
		CUSTODIAN REIT PLC	53,561	54,739.34	
		DERWENT LONDON PLC	16,878	604,907.52	
		EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	78,829	74,887.55	
		GCP STUDENT LIVING PLC	67,882	144,249.25	
		GREAT PORTLAND ESTATES PLC	36,909	276,079.32	
		HAMMERSON PLC	609,917	223,778.54	
		HOME REIT PLC	35,027	39,405.37	
		IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,357	63,771.26	
		INTU PROPERTIES PLC	117,549	—	
		LAND SECURITIES GROUP PLC	111,215	769,607.80	
		LONDONMETRIC PROPERTY PLC	139,144	344,798.83	
		LXI REIT PLC	85,508	123,473.55	

	NEWRIVER REIT PLC	39,505	34,329.84	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	70,311	63,350.21	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	201,064	324,718.36	
	REGIONAL REIT LTD	63,471	57,504.72	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	30,606	317,384.22	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	68,450	34,225.00	
	SEGRO PLC	175,815	2,120,328.90	
	SHAFTESBURY PLC	42,808	250,640.84	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	48,300.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	121,418	142,969.69	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	60,572.20	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	247,402	518,059.78	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	116,460	91,071.72	
	UNITE GROUP PLC	59,789	687,274.55	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,047	169,497.38	
英ポンド 小計		3,709,426	9,440,673.19 (1,434,321,477)	
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	62,398	199,673.60	
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	90,639.27	
	ARENA REIT	45,189	164,036.07	
	AVENTUS GROUP	48,838	154,328.08	
	BWP TRUST	77,963	329,783.49	
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	63,573	240,941.67	
	CENTURIA OFFICE REIT	49,819	123,052.93	
	CHARTER HALL GROUP	68,238	1,067,924.70	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	80,884	399,566.96	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	76,733	286,214.09	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	42,983	150,870.33	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	282,409	247,107.87	
	DEXUS/AU	161,349	1,678,029.60	
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	73,631.85	
	GOODMAN GROUP	247,033	5,565,653.49	
	GPT GROUP	280,941	1,334,469.75	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	46,211	182,071.34	
	HOME CONSORTIUM	23,930	130,657.80	

	HOMECO DAILY NEEDS REIT	68,755	102,444.95	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	96,064.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	40,374	237,399.12	
	IRONGATE GROUP	69,568	101,569.28	
	MIRVAC GROUP	581,102	1,661,951.72	
	NATIONAL STORAGE REIT	158,895	338,446.35	
	RURAL FUNDS GROUP	63,091	160,251.14	
	SCENTRE GROUP	765,242	1,959,019.52	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,342	412,528.16	
	STOCKLAND	353,099	1,546,573.62	
	VICINITY CENTRES	568,591	861,415.36	
	WAYPOINT REIT LTD	117,252	300,165.12	
オーストラリアドル 小計		4,734,376	20,196,481.23 (1,641,166,064)	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	135,240	221,793.60	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	157,709	383,232.87	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	226,618	268,542.33	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	173,901	286,936.65	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	63,535	201,405.95	
ニュージーランドドル 小計		757,003	1,361,911.40 (104,867,177)	
香港ドル	CHAMPION REIT	294,000	1,296,540.00	
	FORTUNE REIT	198,000	1,659,240.00	
	LINK REIT	309,200	23,282,760.00	
	PROSPERITY REIT	163,000	489,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	131,000	630,110.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	247,000	978,120.00	
香港ドル 小計		1,342,200	28,335,770.00 (403,218,007)	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	58,500	90,675.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	184,100	164,769.50	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	492,900	1,513,203.00	
	ASCOTT TRUST	298,296	301,278.96	
	CAPITALAND CHINA TRUST	133,600	181,696.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	671,132	1,409,377.20	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	122,600	148,346.00	

	EC WORLD REIT	50,000	39,750.00	
	ESR REIT	392,600	172,744.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	92,916.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	43,498.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	193,700	461,006.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	69,524.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCI	414,279	625,561.29	
	IREIT GLOBAL	55,000	35,475.00	
	KEPPEL DC REIT	191,300	491,641.00	
	KEPPEL REIT	300,900	358,071.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	119,626.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	55,124.20	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	323,800	692,932.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	285,800	823,104.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	422,000	886,200.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	325,300	335,059.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	156,145.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	53,900	251,713.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	91,400	40,673.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,300	61,406.50	
	SPH REIT	129,700	119,972.50	
	STARHILL GLOBAL REIT	178,700	106,326.50	
	SUNTEC REIT	329,100	490,359.00	
シンガポールドル 小計		7,619,707	10,338,172.65 (839,252,855)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	15,000	106,650,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	22,400,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	95,040,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	25,781,860.00	
	LOTTE REIT CO LTD	15,761	93,462,730.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	46,915,040.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	39,510,320.00	
韓国ウォン 小計		72,085	429,759,950.00 (41,213,979)	
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	25,765	443,673.30	

	イスラエルシュケル 小計	25,765	443,673.30 (14,998,109)	
合計			25,052,789,674 (25,052,789,674)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数		組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式	1銘柄	0.3%	—	0.2%
	投資証券	155銘柄	—	99.7%	75.3%
カナダドル	投資証券	27銘柄	—	100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券	30銘柄	—	100.0%	4.7%
英ポンド	投資証券	34銘柄	—	100.0%	5.7%
オーストラリアドル	株式	1銘柄	1.4%	—	0.1%
	投資証券	30銘柄	—	98.6%	6.5%
ニュージーランドドル	投資証券	5銘柄	—	100.0%	0.4%
香港ドル	投資証券	6銘柄	—	100.0%	1.6%
シンガポールドル	投資証券	30銘柄	—	100.0%	3.3%
韓国ウォン	投資証券	7銘柄	—	100.0%	0.2%
イスラエルシュケル	投資証券	1銘柄	—	100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第２　信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第３　デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

２【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 7月30日現在です。

【つみたてバランスファンド】

【純資産額計算書】

Ⅰ　資産総額	15,751,382,892円
Ⅱ　負債総額	6,662,911円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,744,719,981円
Ⅳ　発行済口数	12,487,033,181口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2609円

（参考）

ＲＭ国内株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	56,450,895,197円
Ⅱ　負債総額	414,492,083円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	56,036,403,114円
Ⅳ　発行済口数	40,686,722,287口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3773円

ＲＭ先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	110,001,468,443円
Ⅱ　負債総額	2,823,885,293円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	107,177,583,150円
Ⅳ　発行済口数	56,293,987,992口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9039円

ＲＭ新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	16,371,574,878円
Ⅱ　負債総額	94,041,317円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	16,277,533,561円
Ⅳ　発行済口数	9,892,924,109口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.6454円

ＲＭ国内債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	107,668,417,461円
Ⅱ　負債総額	14,067,778円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	107,654,349,683円
Ⅳ　発行済口数	101,909,886,285口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0564円

ＲＭ先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	39,748,676,441円
Ⅱ　負債総額	93,808円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	39,748,582,633円
Ⅳ　発行済口数	36,176,180,945口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.0988円

ＲＭ新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	6,328,145,129円
Ⅱ　負債総額	76,056円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,328,069,073円
Ⅳ　発行済口数	5,720,775,066口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.1062円

ＲＭ国内リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	32,119,809,624円
Ⅱ　負債総額	357,453,402円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	31,762,356,222円
Ⅳ　発行済口数	20,477,768,643口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5511円

ＲＭ先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

Ⅰ　資産総額	25,178,270,874円
Ⅱ　負債総額	13,919,586円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	25,164,351,288円
Ⅳ　発行済口数	18,835,034,137口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3360円

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求を行なわないものとします。

（２）受益者に対する特典
該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

①　譲渡制限はありません。

②　受益権の譲渡

・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

③　受益権の譲渡の対抗要件
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（４）受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情などにより受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

（５）受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社債、株式等の振替に関する法律に定めるところにしたがい、一

定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額

2021年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）委託会社の機構（2021年7月末現在）

①　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。

②　投資運用の意思決定機構

委託会社では、以下P.D.C.Aサイクルにて投資運用の意思決定を行っています。
○PLAN：計画
・運用戦略部は、運用基本方針や主な投資制限などを策定し、運用委員会にて協議します。
○DO：実行
・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。
○CHECK：検証→ACTION：改善
・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。
・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

当社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社として、証券投資信託の設定を行うとともに、「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として、その運用（投資運用業）を行っています。また、「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業および第二種金融商品取引業を行っています。
2021年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【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					
	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	△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					
	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

①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。

②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

①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。

②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）	1,159,040 1,059,624	未収運用受託報酬 未収投資助言報酬	1,224,680 350,629
							支払手数料（注3）	706,067	未払手数料	203,372

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２．親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

１．関連当事者との取引

（１）親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注1）連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

（２）兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

２．親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

（１株当たり情報）

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

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

（注）１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

	前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）	当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

当期純利益又は当期純損失（△）（千円）	1,785,287	2,770,298
普通株主に帰属しない金額（千円）	－	－
普通株式に係る当期純利益又は当期純損失（△）（千円）	1,785,287	2,770,298
普通株式の期中平均株式数（株）	3,960,000	3,960,000

（重要な後発事象）

前事業年度（自　2019年４月１日　至　2020年３月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自　2020年４月１日　至　2021年３月31日）

該当事項はありません。

４【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

（１）自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（２）運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

（３）通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下（４）、（５）において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。

（４）委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

（５）上記（３）、（４）に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

５【その他】

（１）定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項

該当事項はありません。

（２）訴訟事件その他の重要事項

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

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

（１）受託会社

名　　称	資本金の額（2021年3月末現在）	事業の内容

株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

＜再信託受託会社の概要＞

名称　　：株式会社日本カストディ銀行
資本金の額　：51,000百万円（2021年3月末現在）
事業の内容　：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。
再信託の目的：原信託契約にかかる信託業務の一部（信託財産の管理）を原信託受託者から再信託受託者（株式会社日本カストディ銀行）へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託者へ移管することを目的とします。

（2）販売会社

名　　称	資本金の額 （2021年3月末現在）	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（1）受託会社
ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行ないます。
（2）販売会社
日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行ないます。

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年10月27日	有価証券届出書

2020年10月27日	**有価証券報告書**
2021年 4月27日	**有価証券届出書**
2021年 4月27日	**半期報告書**

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

りそなアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人トーマツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山　田　　信　之　　印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	畑　中　　建　二　　印

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結

論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、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.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年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
業務執行社員　公認会計士　山田　信之　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、「ファンドの経理状況」に掲げられているつみたてバランスファンドの2020年7月28日から2021年7月26日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、つみたてバランスファンドの2021年7月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以　上

(注)1.上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2.ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。