

【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11月19日提出
【計算期間】	第1期(自 2020年9月25日至 2021年8月20日)
【ファンド名】	埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S G
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単位型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	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
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		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資 産複合(債券、株 式、不動産投信) 資産配分変更 型))		アフリカ		
		中近東 (中東)		
		エマージング		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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

< 商品分類の定義 >

1. 単位型投信・追加型投信の区分

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

2. 投資対象地域による区分

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

3. 投資対象資産による区分

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

4. 独立した区分

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

< 補足として使用する商品分類 >

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

< 属性区分の定義 >

1. 投資対象資産による属性区分

(1) 株式

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

(2) 債券

- 一般：次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
公債：目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関

債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。

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

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

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

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

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

2. 決算頻度による属性区分

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

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

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

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

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

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

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

1

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

- 各マザーファンドは、以下の対象指数(インデックス)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。(RM国内債券マザーファンド(埼玉重視型)を除きます。)

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

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

- 投資対象資産のうち、国内債券については、わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債を主要投資対象とするマザーファンドを組み入れます。

※埼玉県が発行する公募地方債の発行状況や市況状況および純資産総額の水準等により、当該地方債に投資を行わない、もしくは投資比率が低位となる場合があります。

- 投資対象資産のうち、国内株式および先進国株式については、ESG関連インデックス*に連動する投資成果を目指すマザーファンドを組み入れます。

*ESG関連インデックスとは、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数(配当込み)およびMSCI-KOKUSAI ESG リーダーズ指数(配当込み、円換算ベース)をいいます。

ESGとは

[ESG]とは、Environment(環境)、Social(社会)、Governance(ガバナンス)の頭文字を取ったものです。

ESG評価の高い企業は、持続的な企業価値の向上が期待されています。

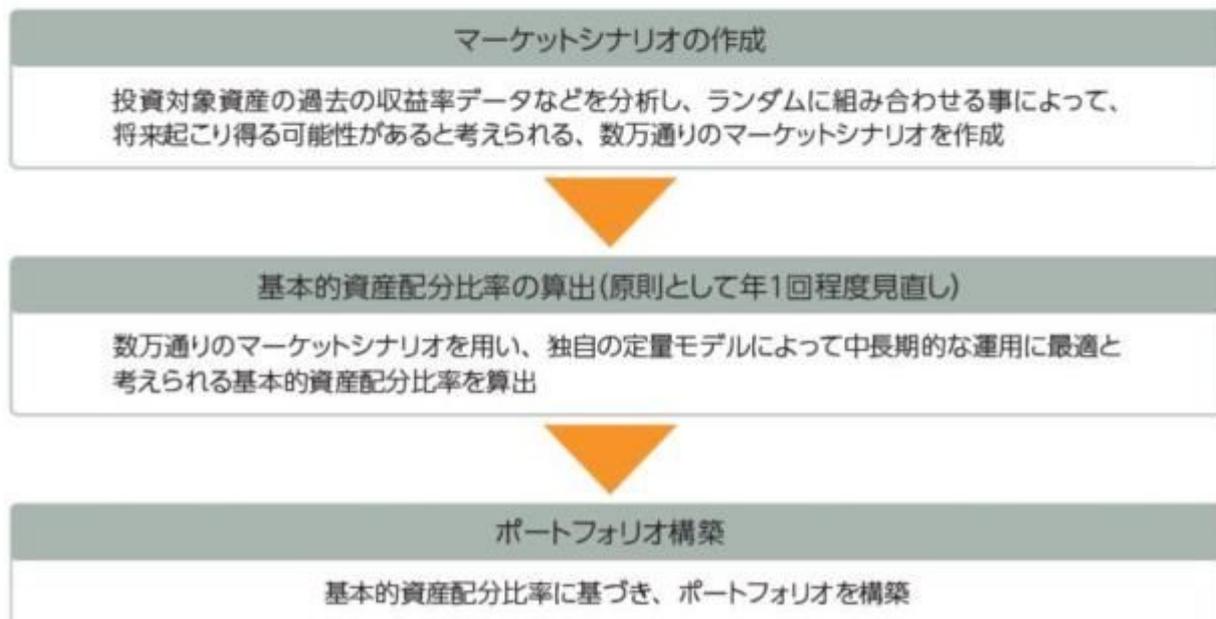
ESG投資は、従来の財務情報に加え、非財務情報であるESGの評価を重視して銘柄選別を行う運用手法です。

2 中長期的な運用に理想的なポートフォリオ構築を目指します。

- 独自の定量モデルを用いて算出した基本的資産配分比率に基づき、ポートフォリオを構築します。基本的資産配分比率は、原則として年1回程度見直します。

当ファンドでは、過去に起きていなかった事象も今後起こり得ると考え、過去のデータをランダムに組み合わせ、将来起こり得る可能性のある数万通りのシナリオを作成します。このように作成されたマーケット・シナリオを用いてシミュレーションを行い、中長期的な運用に最適と考えられるポートフォリオを構築します。

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

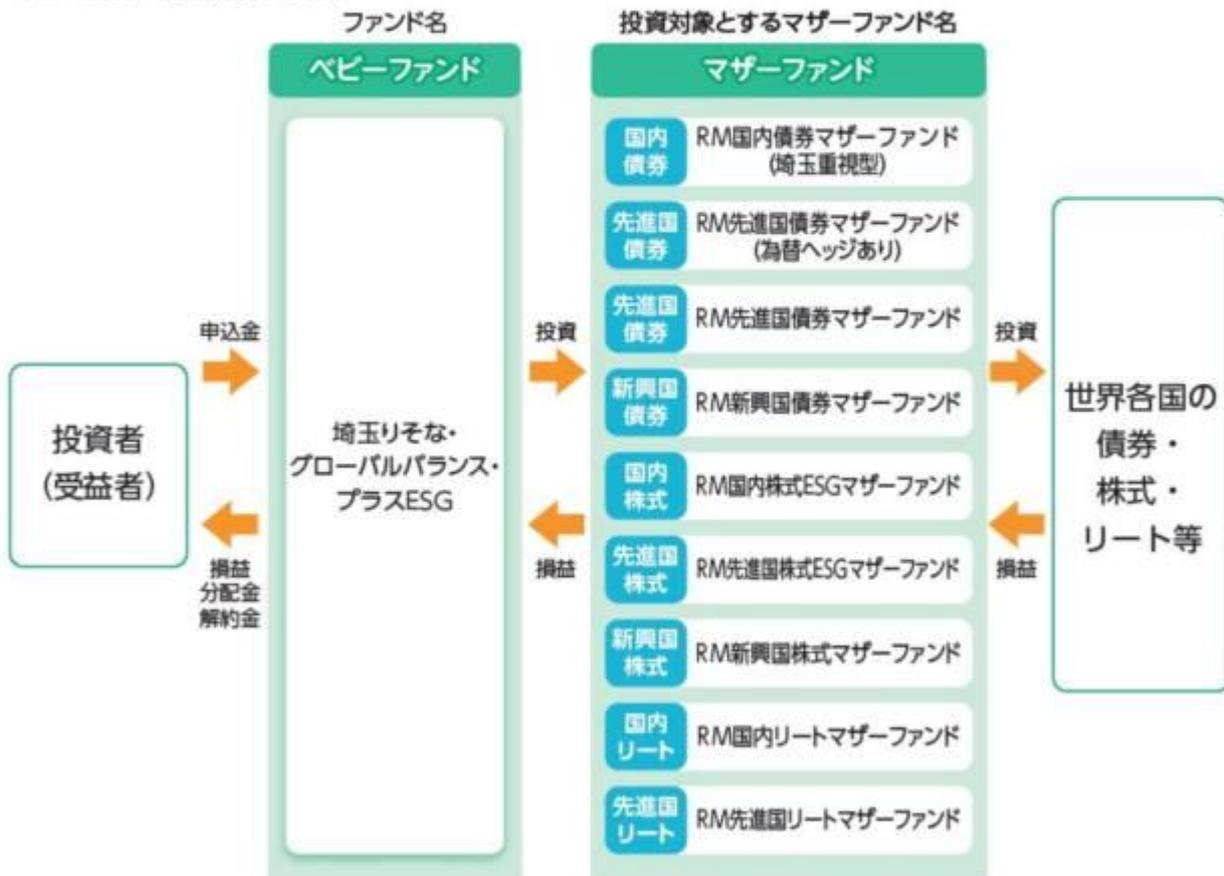
3 実質組入外貨建資産の一部について、対円での為替ヘッジを行います。

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

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

ファンドの仕組み

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



主な投資制限

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

分配方針

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

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

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

各マザーファンドが対象とする指数の著作権等について

●RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RM先進国債券マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

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

●RM国内株式ESGマザーファンド

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

●RM先進国株式ESGマザーファンド

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

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM国内リートマザーファンド

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

●RM先進国リートマザーファンド

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

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。

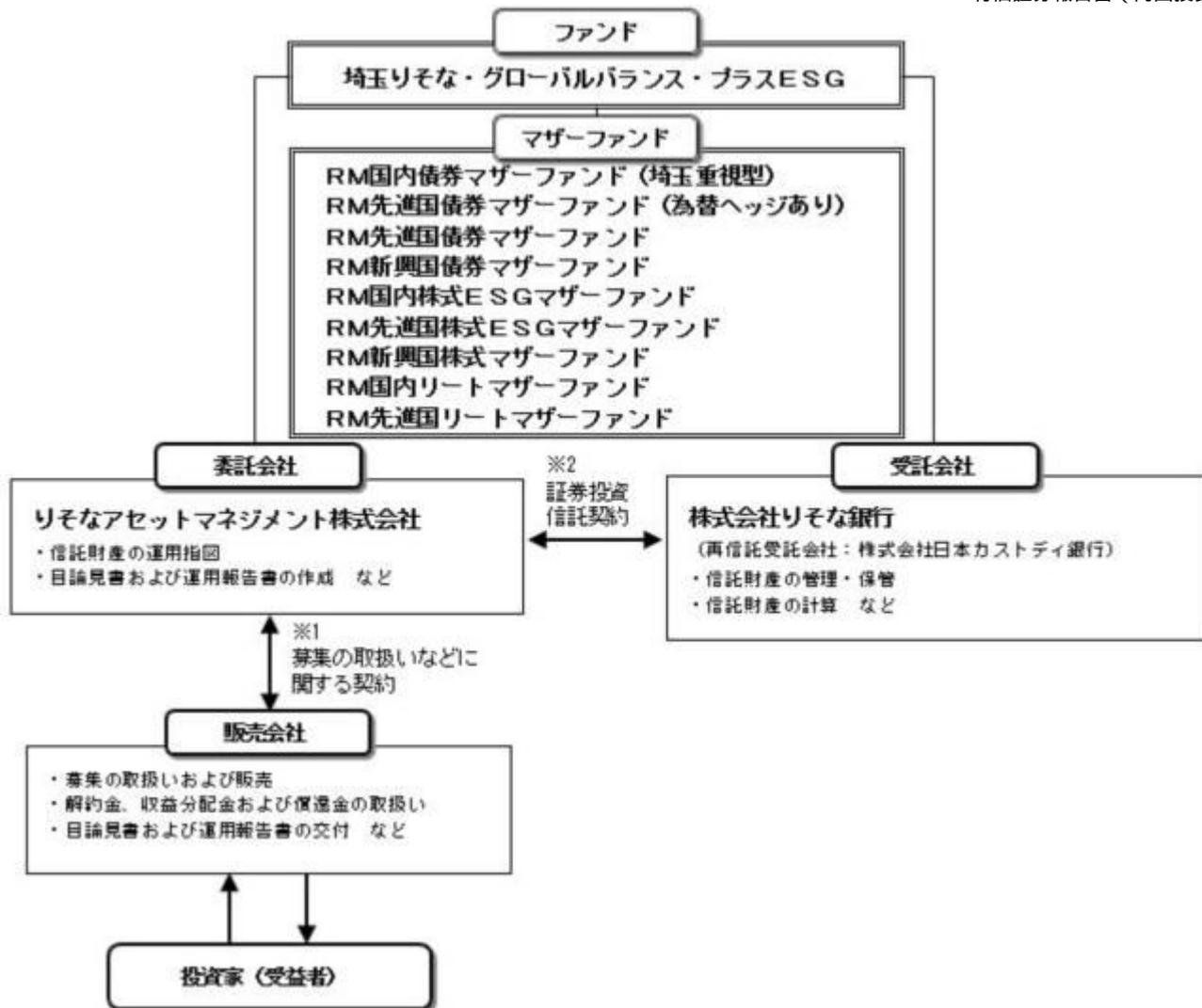
(2)【ファンドの沿革】

2020年9月25日

- ・ファンドの信託契約締結、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



- 1 投資信託を販売するルールを委託会社と販売会社の間で規定したものの。販売会社が行なう募集の取扱い、収益分配金・償還金の支払い、解約請求の受付の業務範囲の取決めの内容などが含まれています。
- 2 投資信託を運営するルールを委託会社と受託会社の間で規定したものの。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。

委託会社の概況（2021年8月末現在）

- 1) 資本金
1,000百万円
- 2) 沿革
2015年8月3日：りそなアセットマネジメント株式会社設立
2020年1月1日：株式会社りそな銀行の資産運用事業に関する権利義務の一部を承継
- 3) 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

を主要投資対象とします。

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債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）等への分散投資を行います。また、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）等を利用することがあります。

各マザーファンド受益証券への投資比率は、信託財産の中長期的な成長を目的に独自の定量モデルにて算出した基本的資産配分比率に基づき決定します。また、基本的資産配分比率は原則として年1回程度見直します。

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

各マザーファンド受益証券への投資比率の合計は、原則として高位を保ちますが、市場環境等を勘案して、投資比率を引き下げることがあります。

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。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）
 - イ) 有価証券
 - ロ) デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条、第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。）
 - ハ) 約束手形（イ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ) 金銭債権（イ）、ロ）およびハ）に掲げるものに該当するものを除きます。）
- 2) 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ) 為替手形

有価証券の指図範囲

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

- 1) 株券または新株引受権証券
- 2) 国債証券
- 3) 地方債証券
- 4) 特別の法律により法人の発行する債券
- 5) 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10) コマーシャル・ペーパー
- 11) 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1) から11) までの証券または証書の性質を有するもの
- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

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

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、わが国の国債および埼玉県が発行する公募地方債に投資を行い、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指します。なお、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。</p> <p>投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、金利変動に対するリスク分散効果や、利息収入の平準化を図り、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年8月20日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり） >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）に採用されている先進国の債券に投資し、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）への連動性を高めるため、先進国債券の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）または海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行います。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年12月10日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M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	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 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	<p>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。</p> <p>債券またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使等により取得したものに限り、</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M新興国債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、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	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の債券 ・ 新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、 J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）に採用されている新興国の現地通貨建て債券または新興国債券の指数を対象指数とした E T F（上場投資信託証券）に投資し、 J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、 J P モルガン G B I E M グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の債券先物取引を活用することがあります。</p> <p>債券または E T F（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年1月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M国内株式 E S G 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 ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式を主要投資対象とします。
投資方針	<p>主として、国内の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）のうち、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）に採用されている株式に投資し、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（配当込み）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、MSCI ジャパン ESG セレクト・リーダーズ指数（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）、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。</p> <p>株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。</p> <p>資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。
申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	<p>組入る有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。</p> <p>上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。</p>
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）

委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M先進国株式 E S G 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 ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	金融商品取引所上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みません。）されている日本を除く先進国の株式 [*] のうち、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式を主要投資対象とします。 [*] 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。
投資方針	主として、金融商品取引所に上場または店頭登録（上場予定および店頭登録予定を含みます。）されている日本を除く先進国の株式のうち、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）に採用されている株式に投資し、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。なお、MSCI - KOKUSAI ESG リーダーズ指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、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）、海外の金融商品取引所に上場されている株価指数先物取引を活用することがあります。 株式（ETF（上場投資信託証券）、株価指数先物取引を含みます。）の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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。 資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。 投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。 デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
収益分配	収益分配は行いません。
ファンドに係る費用	
信託報酬	ありません。

申込手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
その他の費用など	組入有価証券の売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に関する租税など。 上記費用に付随する消費税等相当額を含みます。
その他	
決算日	毎年11月25日（休業日の場合は翌営業日）
委託会社	りそなアセットマネジメント株式会社
受託会社	株式会社りそな銀行

< R M新興国株式マザーファンド >

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

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

< R M国内リートマザーファンド >

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

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

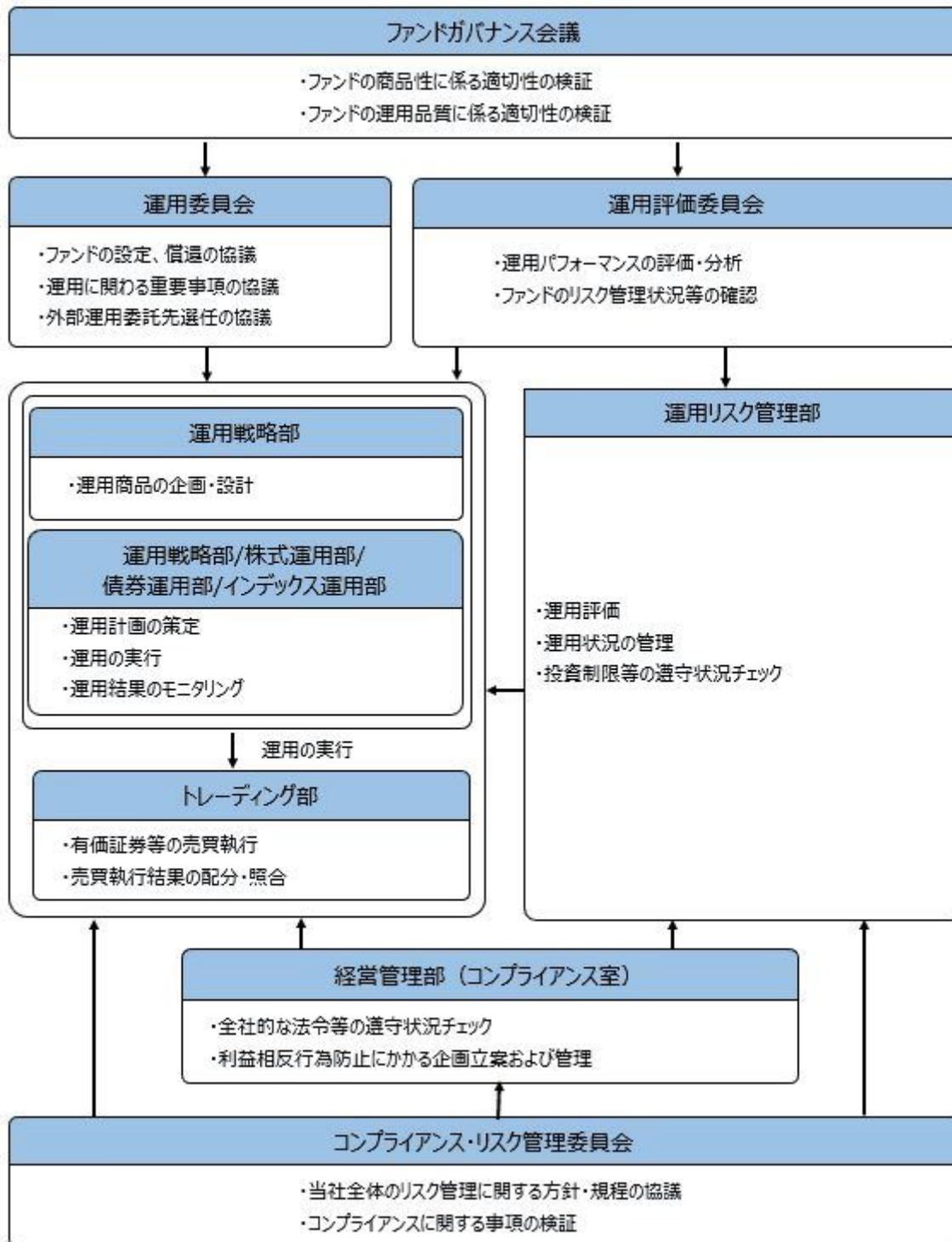
< R M先進国リートマザーファンド >

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

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

（3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2021年8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）【配分方針】

収益配分方針

原則として毎決算時に以下の収益配分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。

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】

約款に定める投資制限

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

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

1. 委託者は、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。)、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。))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。))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。))。
2. 委託者は、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行うことの指図をすることができます。
3. 委託者は、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行うことの指図をすることができます。

11) スワップ取引の運用指図

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

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図

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

13) 直物為替先渡取引の運用指図

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

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。

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

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

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

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

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

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

17) 資金の借入れ

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、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。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利(債券価格)変動リスク

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

- ・リートの価格変動リスク

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

- ・為替変動リスク

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

資産配分リスク

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

信用リスク

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

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

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）

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

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

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

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

（２）リスク管理体制

委託会社における投資リスクに対する管理体制

運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス評価を実施するとともに、法令・主な投資制限等の遵守状況および運用事務状況をモニタリングし、定期的に運用評価委員会に報告します。

運用評価委員会は、運用実績および主な投資制限等の遵守状況や運用事務状況等を確認することを通

じ、信託財産の適切な運用に寄与することを目的に運用部門に対する管理・指導、改善提案等を行います。

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

上記体制は2021年8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、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。

ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

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



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	-	42.1	59.8	62.7	6.2	11.4	19.3
最小値	-	-16.0	-12.4	-19.4	-11.4	-9.4	-
平均値	-	8.9	13.7	12.8	0.4	2.5	3.7

* 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9月から2021年8月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
 なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
 * 決算日に対応した数値とは異なります。

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

各資産クラスの指数

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

○代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに株式会社野村総合研究所が計算しており、その内容について、信頼性、正確性、完全性、最新性、網羅性、遅延性を皆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責任について、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権その他一切の権利は、FTSE Fixed Income LLCに帰属します。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円ベース)

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料につきましては、販売会社が定めるものとします。申込手数料率につきましては、販売会社にお問い合わせください。

- ・販売会社における申込手数料率は2.2%（税抜2.0%）が上限となっております。
- ・申込手数料の額（1口当たり）は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込手数料率を乗じて得た額とします。
- ・＜分配金再投資コース（自動けいぞく投資コース）＞の場合、収益分配金の再投資により取得する口数については、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、商品および関連する投資環境の説明や情報提供など、ならびに購入に関する事務コストの対価です。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し年0.88%（税抜0.80%）の率を乗じて得た額とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

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
0.385%	0.385%	0.030%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

信託報酬（信託報酬に係る消費税等相当額を含みます。）は、日々計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日とします。）および毎計算期末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】

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

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

信託財産中から都度支払われます。（消費税等相当額を含みます。）

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

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」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。

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。

個別元本

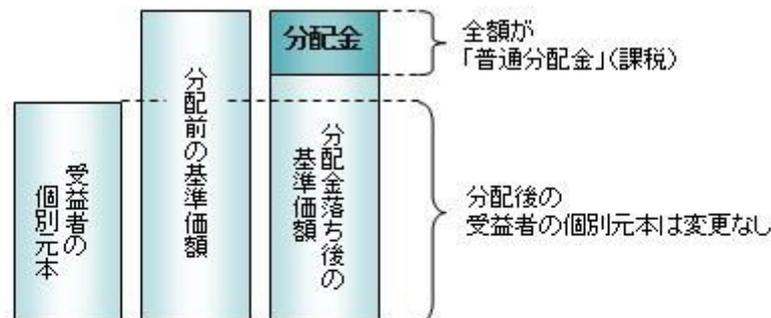
- 1) 各受益者の買付時の基準価額（申込手数料および当該手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が個別元本になります。
- 2) 受益者が同一ファンドを複数回お申込みの場合、1口当たりの個別元本は、申込口数で加重平均した値となります。ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問い合わせください。

普通分配金と元本払戻金(特別分配金)

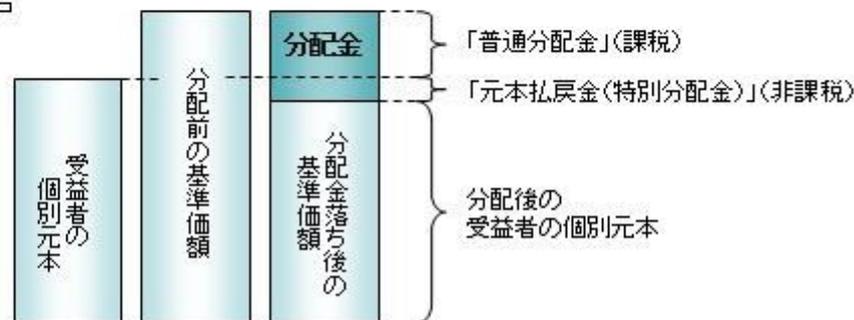
- 1) 収益分配金には課税扱いとなる「普通分配金」と非課税扱いとなる「元本払戻金(特別分配金)」(元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。
- 2) 受益者が収益分配金を受け取る際
 - イ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本と同額かまたは上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。
 - ロ) 収益分配金落ち後の基準価額が、受益者の1口当たりの個別元本を下回っている場合には、収益分配金の範囲内でその下回っている部分の額が元本払戻金(特別分配金)となり、収益分配金から元本払戻金(特別分配金)を控除した金額が普通分配金となります。
 - 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8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】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

以下の運用状況は2021年8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	6,217,133,059	99.38
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		38,477,560	0.62
合計(純資産総額)		6,255,610,619	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)	2,340,837,439	1.0597	2,480,800,618	1.0567	2,473,562,921	39.54
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式E S Gマザーファンド	935,297,195	1.4168	1,325,129,065	1.4522	1,358,238,586	21.71
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド(埼玉重視型)	1,059,066,708	1.0013	1,060,546,644	1.0009	1,060,019,868	16.95
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式E S Gマザーファンド	302,435,396	1.1902	359,958,608	1.2412	375,382,813	6.00
日本	親投資信託受益証券	R M先進国リートマザーファンド	182,637,122	1.3350	243,822,858	1.3638	249,080,506	3.98
日本	親投資信託受益証券	R M新興国株式マザーファンド	147,364,110	1.5751	232,121,491	1.6416	241,912,922	3.87
日本	親投資信託受益証券	R M先進国債券マザーファンド	193,890,666	1.0953	212,368,467	1.0986	213,008,285	3.41
日本	親投資信託受益証券	R M国内リートマザーファンド	80,022,848	1.5244	121,994,090	1.5471	123,803,348	1.98
日本	親投資信託受益証券	R M新興国債券マザーファンド	110,659,488	1.0829	119,838,209	1.1036	122,123,810	1.95

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.38
合計	99.38

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期別	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	分配落ち	分配付き	分配落ち	分配付き
第1計算期間末 (2021年 8月20日)	6,158	6,158	1.1133	1.1133
2020年 9月末日	2,353		1.0082	
10月末日	2,932		0.9954	
11月末日	3,151		1.0374	
12月末日	3,414		1.0477	
2021年 1月末日	3,765		1.0547	
2月末日	3,981		1.0542	
3月末日	4,703		1.0773	
4月末日	4,929		1.0874	
5月末日	5,248		1.0952	
6月末日	5,788		1.1064	
7月末日	5,999		1.1145	
8月末日	6,255		1.1239	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	11.33

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

(4) 【設定及び解約の実績】

期	期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	2020年 9月25日～2021年 8月20日	6,141,844,751	609,918,666

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	291,782,800	27.53
地方債証券	日本	755,433,500	71.27
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		12,766,422	1.20
合計（純資産総額）		1,059,982,722	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	地方債証券	令和2年度第7回 埼玉県公募公債	150,000,000	100.59	150,886,500	100.53	150,796,500	0.125	2030/10/16	14.23
日本	国債証券	第362回利付国 債(10年)	130,000,000	101.05	131,368,900	100.90	131,177,800	0.100	2031/3/20	12.38
日本	地方債証券	平成27年度第6 回埼玉県公募公債	100,000,000	102.05	102,055,000	102.03	102,035,000	0.505	2025/9/29	9.63
日本	地方債証券	平成29年度第9 回埼玉県公募公債	100,000,000	101.08	101,086,000	101.01	101,015,000	0.200	2028/3/27	9.53
日本	地方債証券	平成24年度第7 回埼玉県公募公債	100,000,000	101.03	101,033,000	101.00	101,001,000	0.815	2022/11/28	9.53
日本	地方債証券	令和2年度第9回 埼玉県公募公債	100,000,000	100.70	100,707,000	100.56	100,563,000	0.140	2031/2/18	9.49
日本	国債証券	第425回利付国 債(2年)	100,000,000	100.27	100,273,800	100.24	100,245,000	0.005	2023/6/1	9.46
日本	地方債証券	令和3年度第2回 埼玉県公募公債 (5年)	100,000,000	100.02	100,023,000	100.02	100,023,000	0.010	2026/4/15	9.44
日本	地方債証券	令和3年度第6回 埼玉県公募公債	100,000,000	100.01	100,010,000	100.00	100,000,000	0.005	2026/7/28	9.43
日本	国債証券	第139回利付国 債(5年)	60,000,000	100.63	60,379,200	100.60	60,360,000	0.100	2024/3/20	5.69

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	27.53
地方債証券	71.27
合計	98.80

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	123,802,817,298	44.68
	カナダ	5,503,970,396	1.99
	メキシコ	1,946,990,326	0.70
	ドイツ	20,513,243,732	7.40
	イタリア	26,240,637,577	9.47
	フランス	28,110,696,306	10.14
	オランダ	5,169,683,142	1.87
	スペイン	16,400,577,723	5.92
	ベルギー	6,601,496,218	2.38
	オーストリア	4,117,300,417	1.49
	フィンランド	1,668,992,787	0.60
	アイルランド	2,211,022,684	0.80
	イギリス	17,437,559,748	6.29
	スウェーデン	805,300,645	0.29
	ノルウェー	664,047,921	0.24
	デンマーク	1,352,954,146	0.49
	ポーランド	1,580,714,913	0.57
	オーストラリア	5,224,162,960	1.89
	シンガポール	1,200,725,335	0.43
	マレーシア	1,299,917,456	0.47
イスラエル	1,295,825,566	0.47	
	小計	273,148,637,296	98.58
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		3,945,769,667	1.42
合計（純資産総額）		277,094,406,963	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
為替予約取引	売建		274,991,542,262	99.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	20,170,000	10,646.14	2,147,326,483	10,823.43	2,183,086,286	0.750	2028/1/31	0.79
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,650,000	10,466.95	1,638,077,778	10,426.33	1,631,721,081	0.625	2030/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,850,000	11,271.00	1,561,034,184	11,354.04	1,572,535,060	1.625	2031/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,450,000	10,977.79	1,476,512,974	10,979.48	1,476,740,257	0.125	2023/7/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,280,000	10,983.75	1,238,968,039	10,989.14	1,239,575,057	0.125	2023/2/28	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,910,000	11,648.11	1,154,328,359	12,198.04	1,208,825,819	2.375	2051/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,900,000	10,982.43	1,197,085,215	10,986.56	1,197,535,653	0.125	2023/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,580,000	10,992.91	1,163,050,132	11,002.44	1,164,059,154	0.375	2024/4/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,450,000	10,581.40	1,105,756,701	10,641.84	1,112,072,290	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,890,000	10,567.71	1,045,146,673	10,866.36	1,074,683,251	1.125	2031/2/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	10,829.30	1,061,271,673	10,892.11	1,067,427,737	0.500	2026/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,120,000	10,586.91	1,071,395,827	10,456.38	1,058,186,045	0.625	2030/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,390,000	12,518.91	1,050,337,031	12,339.27	1,035,265,563	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,190,000	10,867.56	998,729,033	11,155.27	1,025,170,104	1.250	2028/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,230,000	10,987.60	1,014,155,612	10,991.93	1,014,555,226	0.125	2022/12/31	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,280,000	24,162.59	1,034,159,098	23,136.66	990,249,145	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,890,000	10,995.75	977,522,854	10,988.28	976,858,293	0.375	2024/7/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,417.56	970,493,388	11,361.12	965,695,778	1.500	2024/10/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,760,000	10,990.00	962,724,825	10,997.41	963,373,839	0.125	2022/8/31	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,110,000	15,913.63	972,323,360	15,601.44	953,248,449	2.750	2027/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	10,077.77	866,688,330	10,909.29	938,199,081	1.875	2051/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,360,000	10,714.76	895,754,017	11,119.64	929,602,474	1.875	2041/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,400,000	10,946.60	919,515,139	10,995.36	923,610,687	0.750	2026/5/31	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	10,928.41	907,058,466	10,956.51	909,390,709	0.250	2024/6/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,700,000	10,083.49	877,264,318	10,218.98	889,051,456	1.375	2040/11/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,140,000	22,234.47	920,507,375	21,454.53	888,217,910	5.750	2032/10/25	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,310,000	14,083.82	888,689,339	14,042.05	886,053,675	0.750	2028/11/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	10,911.66	869,659,349	11,007.17	877,271,598	0.750	2026/3/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,110,000	10,667.31	865,118,977	10,654.71	864,097,644	0.375	2027/7/31	0.31
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	5,330,000	16,545.63	881,882,317	16,133.63	859,922,508	2.500	2030/5/25	0.31

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.58
合計	98.58

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
為替予約取引	米ドル	売建	1,133,559,000.00	124,404,710,454	124,528,937,638	44.94
	カナダドル	売建	63,344,000.00	5,508,307,607	5,517,680,470	1.99
	メキシコペソ	売建	364,917,000.00	1,971,862,132	1,980,769,476	0.71
	ユーロ	売建	862,865,000.00	111,890,530,473	111,936,801,568	40.40
	英ポンド	売建	115,954,000.00	17,531,694,163	17,535,120,459	6.33
	スウェーデンクローナ	売建	63,792,000.00	811,240,680	812,710,080	0.29
	ノルウェークローネ	売建	53,113,000.00	670,039,615	672,410,580	0.24
	デンマーククローネ	売建	78,425,000.00	1,367,598,677	1,367,865,322	0.49
	ポーランドズロチ	売建	56,278,000.00	1,593,191,348	1,599,972,284	0.58
	オーストラリアドル	売建	65,462,000.00	5,252,475,457	5,247,951,069	1.89
	シンガポールドル	売建	14,936,000.00	1,217,042,036	1,220,641,612	0.44
	マレーシアリングット	売建	48,310,000.00	1,252,519,357	1,277,389,269	0.46
	イスラエルシェケル	売建	37,846,000.00	1,291,661,272	1,293,292,435	0.47

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M先進国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	18,686,933,147	45.15
	カナダ	829,800,739	2.00
	メキシコ	293,052,022	0.71
	ドイツ	3,107,494,298	7.51
	イタリア	3,965,980,243	9.58
	フランス	4,261,440,913	10.30
	オランダ	778,961,141	1.88
	スペイン	2,474,377,319	5.98
	ベルギー	986,569,772	2.38
	オーストリア	615,596,423	1.49
	フィンランド	240,626,226	0.58
	アイルランド	336,138,171	0.81
	イギリス	2,624,004,035	6.34
	スウェーデン	118,112,948	0.29

	ノルウェー	99,037,679	0.24
	デンマーク	202,057,619	0.49
	ポーランド	230,711,310	0.56
	オーストラリア	777,656,076	1.88
	シンガポール	185,249,719	0.45
	マレーシア	192,062,873	0.46
	イスラエル	190,720,743	0.46
	小計	41,196,583,416	99.54
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		190,620,439	0.46
合計(純資産総額)		41,387,203,855	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	10,874.74	391,490,883	10,857.77	390,879,936	0.375	2025/11/30	0.94
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	10,985.26	340,543,155	10,985.06	340,536,927	0.125	2023/4/30	0.82
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,500,000	10,977.12	274,428,020	10,955.65	273,891,406	0.125	2023/12/15	0.66
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,380,000	10,991.09	261,588,156	10,993.00	261,633,511	0.125	2022/11/30	0.63
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,200,000	10,999.30	241,984,740	11,150.98	245,321,689	1.250	2028/4/30	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,870,000	11,762.49	219,958,640	12,198.04	228,103,355	2.375	2051/5/15	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,010,000	10,959.51	220,286,310	10,961.66	220,329,478	0.250	2024/5/15	0.53
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,960,000	10,817.53	212,023,658	10,751.31	210,725,683	0.500	2027/5/31	0.51
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,760,000	11,260.55	198,185,803	11,354.04	199,831,171	1.625	2031/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,720,000	10,553.10	181,513,443	10,866.36	186,901,435	1.125	2031/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,730,000	10,690.78	184,950,622	10,742.72	185,849,142	0.500	2027/6/30	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,540,000	11,584.34	178,398,966	11,502.15	177,133,116	2.125	2024/3/31	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,550,000	11,026.40	170,909,314	11,146.26	172,767,084	1.250	2028/5/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,560,000	10,963.05	171,023,711	10,982.05	171,320,097	0.125	2023/6/30	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,600,000	10,600.30	169,604,943	10,641.84	170,269,441	0.875	2030/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,610,000	10,543.53	169,750,853	10,426.33	167,863,957	0.625	2030/8/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,090,000	14,159.93	154,343,255	14,520.53	158,273,859	3.375	2048/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	10,991.75	157,182,145	10,991.93	157,184,612	0.125	2022/12/31	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,410,000	10,417.32	146,884,221	11,119.64	156,787,020	1.875	2041/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	11,201.50	152,340,450	11,229.54	152,721,836	2.000	2050/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,010,000	14,971.06	151,207,717	15,100.51	152,515,223	5.375	2031/2/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,300,000	11,953.34	155,393,441	11,721.09	152,374,198	2.250	2025/11/15	0.37
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	650,000	24,049.72	156,323,229	23,136.66	150,388,301	4.500	2041/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,430,000	10,350.55	148,012,960	10,456.38	149,526,287	0.625	2030/5/15	0.36
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	1,130,000	13,220.11	149,387,276	13,199.23	149,151,397	0.000	2024/3/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	11,287.93	150,129,484	11,193.05	148,867,654	1.625	2022/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,340,000	10,127.16	135,704,037	10,909.29	146,184,507	1.875	2051/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,949.66	145,630,552	10,956.51	145,721,643	0.250	2024/6/15	0.35

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,330,000	10,934.83	145,433,242	10,947.06	145,596,028	0.125	2024/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	1,360,000	10,752.18	146,229,677	10,690.77	145,394,603	0.500	2027/10/31	0.35

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.54
合計	99.54

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

- ・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	アメリカ	1,975,044,476	30.39
	アイルランド	4,512,287,226	69.43
	小計	6,487,331,702	99.82
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,746,573	0.18
合計(純資産総額)		6,499,078,275	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	746,647	6,322.54	4,720,710,750	6,043.40	4,512,287,226	69.43
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	579,532	3,525.35	2,043,053,631	3,407.99	1,975,044,476	30.39

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.82
合計	99.82

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

R M国内株式E S Gマザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	2,015,240,390	93.73
投資証券	日本	38,553,600	1.79
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		96,142,541	4.47
合計(純資産総額)		2,149,936,531	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	94,296,000	4.39

(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	15,600	8,229.98	128,387,688	9,592.00	149,635,200	6.96
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	9,300	10,696.15	99,474,195	11,360.00	105,648,000	4.91
日本	株式	キーエンス	電気機器	1,400	52,594.60	73,632,440	66,130.00	92,582,000	4.31
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	10,000	4,923.44	49,234,400	6,500.00	65,000,000	3.02
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1,100	41,306.82	45,437,502	47,240.00	51,964,000	2.42

日本	株式	ダイキン工業	機械	1,800	22,668.90	40,804,020	27,405.00	49,329,000	2.29
日本	株式	信越化学工業	化学	2,600	17,557.03	45,648,278	18,205.00	47,333,000	2.20
日本	株式	任天堂	その他製品	800	58,957.78	47,166,224	52,900.00	42,320,000	1.97
日本	株式	KDDI	情報・通信業	11,800	3,236.22	38,187,396	3,370.00	39,766,000	1.85
日本	株式	村田製作所	電気機器	4,200	8,782.96	36,888,432	9,119.00	38,299,800	1.78
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	9,600	3,537.54	33,960,384	3,801.00	36,489,600	1.70
日本	株式	第一三共	医薬品	12,500	3,083.42	38,542,750	2,614.50	32,681,250	1.52
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	21,100	1,374.46	29,001,106	1,473.50	31,090,850	1.45
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	400	82,963.80	33,185,520	72,520.00	29,008,000	1.35
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	8,700	3,078.61	26,783,907	3,311.00	28,805,700	1.34
日本	株式	富士通	電気機器	1,400	15,948.83	22,328,362	20,300.00	28,420,000	1.32
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	9,400	2,675.40	25,148,760	2,936.00	27,598,400	1.28
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	13,700	1,682.00	23,043,400	1,857.00	25,440,900	1.18
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	1,500	16,679.12	25,018,680	16,660.00	24,990,000	1.16
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,600	5,366.50	24,685,900	5,377.00	24,734,200	1.15
日本	株式	デンソー	輸送用機器	3,200	6,319.32	20,221,824	7,710.00	24,672,000	1.15
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	2,600	7,628.64	19,834,464	9,068.00	23,576,800	1.10
日本	株式	花王	化学	3,500	7,366.24	25,781,840	6,646.00	23,261,000	1.08
日本	株式	パナソニック	電気機器	16,200	1,241.12	20,106,144	1,312.00	21,254,400	0.99
日本	株式	資生堂	化学	2,900	7,575.42	21,968,718	7,293.00	21,149,700	0.98
日本	株式	中外製薬	医薬品	4,900	4,437.09	21,741,741	4,308.00	21,109,200	0.98
日本	株式	三菱電機	電気機器	13,400	1,564.98	20,970,732	1,505.50	20,173,700	0.94
日本	株式	オリックス	その他金融業	9,000	1,735.70	15,621,300	2,051.50	18,463,500	0.86
日本	株式	クボタ	機械	7,500	2,299.97	17,249,775	2,274.50	17,058,750	0.79
日本	株式	小松製作所	機械	6,400	2,866.16	18,343,424	2,662.50	17,040,000	0.79

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.04
		鉱業	0.26
		建設業	2.29
		食料品	3.05
		繊維製品	0.45
		パルプ・紙	0.09
		化学	9.09
		医薬品	6.69
		石油・石炭製品	0.45
		ガラス・土石製品	0.58
		鉄鋼	0.20
		非鉄金属	0.47

	機械	5.75
	電気機器	20.97
	輸送用機器	8.58
	精密機器	0.55
	その他製品	2.69
	電気・ガス業	1.23
	陸運業	3.80
	海運業	0.50
	情報・通信業	6.41
	卸売業	1.92
	小売業	2.56
	銀行業	2.73
	証券、商品先物取引業	0.56
	保険業	3.21
	その他金融業	1.51
	不動産業	1.85
	サービス業	5.23
投資証券		1.79
合 計		95.53

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等(円)	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物	買建	48	日本円	92,535,280	94,296,000	4.39

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

R M先進国株式ESGマザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	1,149,228,596	53.56
	カナダ	67,713,366	3.16
	ドイツ	47,448,081	2.21
	イタリア	9,235,101	0.43

	フランス	56,714,148	2.64
	オランダ	42,956,533	2.00
	スペイン	12,325,931	0.57
	ベルギー	3,751,733	0.17
	オーストリア	1,530,644	0.07
	ルクセンブルク	186,957	0.01
	フィンランド	7,928,360	0.37
	アイルランド	49,305,199	2.30
	ポルトガル	608,377	0.03
	イギリス	66,783,965	3.11
	スイス	58,776,003	2.74
	スウェーデン	19,900,420	0.93
	ノルウェー	3,675,796	0.17
	デンマーク	22,333,899	1.04
	ケイマン	402,982	0.02
	オーストラリア	32,746,551	1.53
	バミューダ	5,137,371	0.24
	ニュージーランド	3,457,214	0.16
	香港	8,569,173	0.40
	シンガポール	6,891,786	0.32
	イスラエル	1,807,376	0.08
	キュラソー	2,492,594	0.12
	ジャージー	7,419,627	0.35
	小計	1,689,327,783	78.73
投資証券	アメリカ	32,895,093	1.53
	カナダ	155,027	0.01
	フランス	1,815,640	0.08
	イギリス	1,340,607	0.06
	オーストラリア	4,043,796	0.19
	シンガポール	600,144	0.03
	小計	40,850,307	1.90
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		415,579,242	19.37
合計（純資産総額）		2,145,757,332	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	325,744,248	15.18
	買建	ドイツ	85,789,930	4.00

(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		3,866,045	0.18
--------	----	--	-----------	------

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	3,980	24,158.10	96,149,272	33,364.54	132,790,873	6.19
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	167	204,005.35	34,068,894	317,809.91	53,074,256	2.47
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	164	204,870.29	33,598,729	319,741.96	52,437,682	2.44
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	428	64,023.27	27,401,961	80,327.00	34,379,960	1.60
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	1,376	14,629.31	20,129,938	24,934.11	34,309,338	1.60
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,461	16,290.70	23,800,720	19,085.23	27,883,527	1.30
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	943	23,263.86	21,937,828	25,412.17	23,963,683	1.12
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	600	30,246.62	18,147,977	35,948.29	21,568,974	1.01
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	1,370	14,936.85	20,463,494	15,708.00	21,519,970	1.00
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	233	50,378.92	11,738,290	92,028.02	21,442,530	1.00
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	1,010	17,518.98	17,694,171	19,779.80	19,977,600	0.93
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	266	51,121.66	13,598,364	73,192.30	19,469,152	0.91
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	493	37,981.88	18,725,071	38,800.19	19,128,496	0.89
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	391	36,123.95	14,124,465	43,859.41	17,149,033	0.80
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	540	27,495.81	14,847,742	29,120.20	15,724,910	0.73
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2,351	4,820.58	11,333,206	6,498.38	15,277,708	0.71
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	2,278	5,797.61	13,206,956	6,174.18	14,064,787	0.66
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	2,309	6,534.34	15,087,800	6,019.22	13,898,386	0.65

アメリカ	株式	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	219	51,930.74	11,372,833	61,382.44	13,442,756	0.63
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	2,256	5,445.62	12,285,341	5,928.00	13,373,582	0.62
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	768	15,571.69	11,959,060	17,144.39	13,166,899	0.61
アメリカ	株式	NIKE INC -CL B	耐久消費財・アパレル	710	14,826.13	10,526,554	18,466.49	13,111,213	0.61
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	454	21,894.26	9,939,998	28,827.87	13,087,853	0.61
アイルランド	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	353	27,783.35	9,807,524	37,036.30	13,073,814	0.61
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,409	8,239.37	11,609,278	8,407.34	11,845,956	0.55
イギリス	株式	ASTRAZENECA PLC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	859	12,398.09	10,649,963	12,956.27	11,129,441	0.52
アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	消費者サービス	417	24,049.26	10,028,543	26,001.23	10,842,517	0.51
デンマーク	株式	NOVO NORDISK A/S-B	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	961	7,371.66	7,084,171	11,234.84	10,796,689	0.50
アメリカ	株式	TEXAS INSTRUMENTS INC	半導体・半導体製造装置	511	18,056.81	9,227,031	21,038.15	10,750,498	0.50
カナダ	株式	SHOPIFY INC - CLASS A	ソフトウェア・サービス	63	118,200.50	7,446,632	170,116.79	10,717,358	0.50

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	1.53
		素材	3.80
		資本財	4.91
		商業・専門サービス	1.08
		運輸	2.07
		自動車・自動車部品	2.00
		耐久消費財・アパレル	1.97
		消費者サービス	1.71
		メディア・娯楽	6.60
		小売	3.43
		食品・生活必需品小売り	0.64
		食品・飲料・タバコ	2.16
		家庭用品・パーソナル用品	2.67

	ヘルスケア機器・サービス	2.77
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
	銀行	3.80
	各種金融	4.20
	保険	3.28
	不動産	0.26
	ソフトウェア・サービス	13.33
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.39
	電気通信サービス	1.29
	公益事業	1.47
	半導体・半導体製造装置	4.32
投資証券		1.90
合計		80.63

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	SP500MIC2109	買建	131	米ドル	2,829,420.5	310,953,312	2,964,006	325,744,248	15.18
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002109	買建	28	ユーロ	641,430	83,187,060	661,500	85,789,930	4.00

(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	24,000.00	2,635,933	2,637,547	0.12
	カナダドル	買建	4,000.00	346,209	348,594	0.02
	ユーロ	買建	5,000.00	646,557	648,457	0.03
	英ポンド	買建	1,000.00	150,468	151,268	0.01
	オーストラリアドル	買建	1,000.00	79,464	80,179	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	52,489,218	0.31
	アルゼンチン	1,085,812	0.01
	メキシコ	264,122,554	1.55
	ブラジル	694,557,521	4.09
	チリ	63,725,449	0.38
	コロンビア	22,535,728	0.13
	ペルー	2,666,921	0.02
	オランダ	44,687,529	0.26
	ルクセンブルク	39,807,812	0.23
	ギリシャ	25,588,207	0.15
	トルコ	39,259,188	0.23
	チェコ	17,372,348	0.10
	キプロス	21,986,750	0.13
	ハンガリー	34,988,109	0.21
	ポーランド	95,291,908	0.56
	ロシア	407,647,668	2.40
	ケイマン	2,878,319,760	16.94
	バミューダ	84,127,212	0.50
	香港	160,532,290	0.94
	シンガポール	2,881,615	0.02
	マレーシア	188,480,393	1.11
	タイ	237,515,503	1.40
	フィリピン	87,446,908	0.51
	インドネシア	171,640,010	1.01
	韓国	1,768,559,979	10.41
	台湾	1,991,171,709	11.72
	中国	1,511,241,347	8.89
	インド	1,609,387,309	9.47
	カタール	97,048,330	0.57
	エジプト	8,926,130	0.05
	南アフリカ	419,795,243	2.47
	ジャージー	11,483,056	0.07
	英ヴァージン諸島	3,612,747	0.02
アラブ首長国連邦	106,635,796	0.63	
マン島	4,720,698	0.03	
クウェート	80,599,944	0.47	
サウジアラビア	436,819,014	2.57	
小計	13,688,757,715	80.56	
投資証券	メキシコ	5,545,756	0.03
	南アフリカ	5,510,491	0.03

	小計	11,056,247	0.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		3,293,170,895	19.38
合計(純資産総額)		16,992,984,857	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	3,285,204,433	19.33

(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		61,763,069	0.36

(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	2,537.86	971,241,285	2,393.98	916,178,059	5.39
ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・娯楽	89,500	9,482.34	848,669,858	6,572.43	588,233,201	3.46
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	235,440	3,441.92	810,367,989	2,232.20	525,549,639	3.09
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	8,089.62	600,751,931	7,042.24	522,970,827	3.08
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	56,100	5,159.76	289,462,566	3,222.72	180,794,816	1.06
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	44,465	3,099.25	137,808,582	3,428.07	152,429,466	0.90
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	53,107	2,062.97	109,558,429	2,564.05	136,169,295	0.80
ブラジル	株式	VALE SA	素材	61,700	2,064.98	127,409,591	2,120.32	130,824,338	0.77
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,495,000	84.86	126,879,510	78.73	117,707,031	0.69
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	13,420	10,111.91	135,701,837	8,428.23	113,106,860	0.67
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	26,702	3,898.09	104,086,944	4,161.10	111,109,879	0.65
ケイマン	株式	MUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	52,500	1,713.24	89,945,146	1,690.37	88,744,845	0.52
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	98,500	1,319.36	129,957,733	886.10	87,281,638	0.51
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	79,821	836.05	66,735,040	1,077.61	86,016,028	0.51
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	23,500	3,579.47	84,117,712	3,608.78	84,806,424	0.50

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	7,250.82	93,216,582	6,579.67	84,588,366	0.50
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,800	476.14	92,753,643	431.31	84,019,772	0.49
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	20,100	6,475.03	130,148,140	4,154.22	83,499,822	0.49
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	8,517	12,060.66	102,720,657	9,770.40	83,214,497	0.49
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	92,693	662.52	61,411,790	887.77	82,290,268	0.48
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	41,932	1,610.15	67,516,861	1,937.53	81,244,801	0.48
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	14,446	4,967.06	71,754,155	5,588.96	80,738,160	0.48
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	415.81	92,893,497	350.63	78,331,524	0.46
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	1,928	33,491.68	64,571,973	40,403.20	77,897,370	0.46
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	6,800	17,370.12	118,116,842	10,438.30	70,980,454	0.42
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,150	26,749.83	111,011,802	16,834.48	69,863,100	0.41
韓国	株式	KAKAO CORP	メディア・娯楽	4,858	9,757.67	47,402,781	14,301.60	69,477,173	0.41
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	19,204	2,299.20	44,153,930	3,539.60	67,974,670	0.40
ケイマン	株式	NETEASE INC-ADR	メディア・娯楽	6,310	12,768.90	80,571,805	9,849.23	62,148,692	0.37
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	73,669.03	63,502,711	72,027.19	62,087,446	0.37

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	4.31
		素材	7.22
		資本財	2.32
		商業・専門サービス	0.24
		運輸	1.50
		自動車・自動車部品	3.06
		耐久消費財・アパレル	1.44
		消費者サービス	0.88
		メディア・娯楽	6.20
		小売	6.69
		食品・生活必需品小売り	1.03
		食品・飲料・タバコ	2.79
		家庭用品・パーソナル用品	0.88
ヘルスケア機器・サービス	0.95		

	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	2.89
	銀行	11.41
	各種金融	2.03
	保険	2.14
	不動産	1.40
	ソフトウェア・サービス	2.34
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.03
	電気通信サービス	2.25
	公益事業	1.76
	半導体・半導体製造装置	7.82
投資証券		0.07
合計		80.62

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	467	米ドル	30,779,830	3,382,703,331	29,892,670	3,285,204,433	19.33

(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	562,000.00	61,819,550	61,763,069	0.36

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	32,236,934,330	98.51
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		488,630,581	1.49
合計(純資産総額)		32,725,564,911	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	458,602,000	1.40

(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	3,129	632,068.07	1,977,740,996	715,000	2,237,235,000	6.84
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,761	631,738.12	1,744,228,958	681,000	1,880,241,000	5.75
日本	投資証券	G L P投資法人	8,943	176,094.07	1,574,809,346	199,700	1,785,917,100	5.46
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,375	338,969.35	1,482,990,914	396,500	1,734,687,500	5.30
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	8,929	161,424.02	1,441,355,145	169,700	1,515,251,300	4.63
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	13,932	101,570.13	1,415,075,096	106,900	1,489,330,800	4.55
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3,940	285,765.96	1,125,917,901	325,500	1,282,470,000	3.92
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,502	181,735.48	999,908,663	196,100	1,078,942,200	3.30
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,761	326,001.35	900,089,729	374,500	1,033,994,500	3.16
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,216	144,029.62	895,288,118	155,600	967,209,600	2.96
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,920	194,792.85	763,587,989	221,200	867,104,000	2.65
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,121	81,080.16	658,451,980	94,000	763,374,000	2.33
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,815	386,417.8	701,348,322	411,500	746,872,500	2.28
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	854	703,956.05	601,178,472	808,000	690,032,000	2.11
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	1,026	544,050.47	558,195,792	652,000	668,952,000	2.04
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,380	169,588.78	573,210,102	192,000	648,960,000	1.98
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,384	445,083.65	615,995,777	461,500	638,716,000	1.95
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,804	315,362.37	568,913,729	353,000	636,812,000	1.95
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	953	591,238.65	563,450,437	661,000	629,933,000	1.92
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,459	57,742.21	488,441,379	65,000	549,835,000	1.68
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,153	38,351.2	466,082,145	42,750	519,540,750	1.59
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,247	150,509.92	488,705,729	159,500	517,896,500	1.58
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,247	145,072.33	471,049,880	151,000	490,297,000	1.50
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	584	698,670.38	408,023,503	792,000	462,528,000	1.41
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	968	447,467.7	433,148,740	476,500	461,252,000	1.41
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,427	165,875.76	402,580,474	185,200	449,480,400	1.37
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,612	103,459.02	373,693,989	123,500	446,082,000	1.36
日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,886	197,416.17	372,326,897	236,200	445,473,200	1.36
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,243	313,595.85	389,799,643	353,000	438,779,000	1.34
日本	投資証券	N T T都市開発リート投資法人	2,494	139,745.12	348,524,348	159,300	397,294,200	1.21

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資証券	98.51
合 計	98.51

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

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	214	日本円	453,999,540	458,602,000	1.40

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

R M先進国リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 8月31日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	69,820,569	0.26
	オーストラリア	24,785,610	0.09
	小計	94,606,179	0.36
投資証券	アメリカ	19,699,948,308	74.23
	カナダ	510,860,407	1.92
	ドイツ	75,436,080	0.28
	イタリア	3,506,738	0.01
	フランス	585,840,829	2.21
	オランダ	47,802,220	0.18
	スペイン	119,321,045	0.45
	ベルギー	376,163,590	1.42
	アイルランド	31,399,267	0.12
	イギリス	1,494,600,716	5.63
	オーストラリア	1,763,645,557	6.65
	ニュージーランド	112,303,306	0.42
	香港	373,210,910	1.41
	シンガポール	940,734,841	3.54
	韓国	40,169,877	0.15
イスラエル	16,607,606	0.06	

	ガンジー	67,638,336	0.25
	小計	26,259,189,633	98.94
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		186,142,971	0.70
合計(純資産総額)		26,539,938,783	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		62,641,951	0.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

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	112,795	11,658.19	1,314,985,767	14,696.92	1,657,739,881	6.25
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	13,657	79,981.92	1,092,313,122	92,319.29	1,260,804,639	4.75
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	23,205	26,447.43	613,712,729	35,228.44	817,476,066	3.08
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	42,918	15,735.48	675,335,416	17,849.95	766,084,497	2.89
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,078	11,420.80	571,931,223	14,661.75	734,231,567	2.77
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	63,603	7,452.31	473,989,845	9,425.02	599,459,801	2.26
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,282	19,419.32	413,282,181	25,081.37	533,781,887	2.01
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	52,450	7,283.07	381,997,179	9,271.16	486,272,552	1.83
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,899	19,026.98	397,645,002	22,630.60	472,957,077	1.78
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	255,907	1,469.69	376,106,364	1,812.86	463,926,072	1.75
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	56,923	6,834.68	389,050,547	7,919.39	450,795,665	1.70
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,371	13,897.95	283,115,221	20,402.93	415,628,189	1.57
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	86,515	3,480.53	301,118,312	4,538.86	392,680,338	1.48
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,043	16,847.67	287,134,840	22,227.27	378,819,448	1.43
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,448	15,631.07	272,731,032	21,170.03	369,374,806	1.39
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,906	28,532.23	282,640,350	35,915.32	355,777,160	1.34
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	182,276	1,506.64	274,625,990	1,939.28	353,484,457	1.33
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	57,095	5,632.37	321,580,451	6,091.75	347,808,866	1.31
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	57,088	4,601.51	262,691,174	5,701.61	325,493,626	1.23
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,009	3,434.37	281,649,660	3,934.42	322,657,850	1.22
香港	投資証券	LINK REIT	316,600	988.82	313,063,197	1,015.21	321,416,910	1.21
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	81,735	3,005.76	245,676,202	3,379.42	276,217,302	1.04
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	21,619	10,651.50	230,274,951	12,305.50	266,032,669	1.00
アメリカ	投資証券	UDR INC	45,224	4,589.42	207,552,111	5,875.25	265,702,487	1.00
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	14,933	12,020.27	179,498,713	16,352.02	244,184,730	0.92
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,829	7,235.81	186,893,891	9,230.50	238,414,610	0.90
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	27,251	7,636.50	208,102,467	8,563.40	233,361,431	0.88
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	43,936	3,702.53	162,674,402	5,131.23	225,445,765	0.85

アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	91,461	1,902.36	173,992,571	2,399.11	219,425,640	0.83
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,006	8,075.79	169,640,177	9,678.76	203,312,131	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	0.36
投資証券			98.94
合計			99.30

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	570,000.00	62,640,188	62,641,951	0.24

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

参考情報

運用実績

2021年8月31日現在

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口当たり、税引前)

2021年8月20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国内債券マザーファンド(埼玉重複型)	16.9
RM先進国債券マザーファンド(輪替ヘッジあり)	39.5
RM新興国債券マザーファンド	3.4
RM新興国債券マザーファンド	2.0
RM国内株式ESGマザーファンド	6.0
RM先進国株式ESGマザーファンド	21.7
RM新興国株式マザーファンド	3.9
RM国内リートマザーファンド	2.0
RM先進国リートマザーファンド	4.0
その他	0.6
合計	100.0

※比率はファンドの純資産総額に対する組入比率であり、四捨五入の関係で合計が100%にならない場合があります。

※その他には未収・未払項目が含まれるためマイナスとなる場合があります。

■通貨別組入比率

通貨	比率(%)
日本円	65.2
米ドル	21.5
ユーロ	4.3
豪ポンド	1.2
香港ドル	0.9
その他	7.0
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。

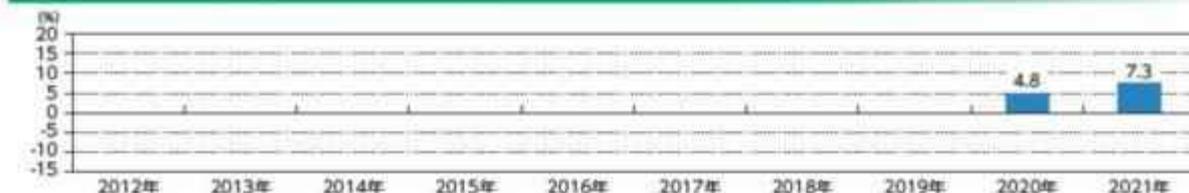
※為替ヘッジをかけている外貨建て資産については、日本円に含めています。

■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(%)
国内債券	日本	令和2年度第7回埼玉無公募債	2030/10/16	14.2
国内債券	日本	第362回利付国債(10年)	2031/3/20	12.4
国内債券	日本	平成27年度第6回埼玉無公募債	2025/9/29	9.6
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2028/1/31	0.8
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2030/8/15	0.6
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2031/5/15	0.6
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2025/11/30	0.9
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2023/4/30	0.8
先進国債券	アメリカ	US TREASURY N/B	2023/12/15	0.7
新興国債券	アイルランド	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	—	69.4
新興国債券	アメリカ	VANECK VECTORS JP, MORGAN E	—	30.4
国内株式ESG	日本	トヨタ自動車	—	7.0
国内株式ESG	日本	ソニーグループ	—	4.9
国内株式ESG	日本	キーエンス	—	4.3
国内株式ESG	アメリカ	MICROSOFT CORP	—	6.2
国内株式ESG	アメリカ	ALPHABET INC-CL A	—	2.5
国内株式ESG	アメリカ	ALPHABET INC-CL C	—	2.4
新興国株式	台湾	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	—	5.4
新興国株式	中国	TENCENT HOLDINGS LTD	—	3.5
新興国株式	中国	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	—	3.1
国内リート	日本	日本ビルファンド投資法人	—	6.8
国内リート	日本	ジャパセンリアルエステイト投資法人	—	5.7
国内リート	日本	GLP投資法人	—	5.5
先進国リート	アメリカ	PROLOGIS INC	—	6.2
先進国リート	アメリカ	EQUINIX INC	—	4.8
先進国リート	アメリカ	PUBLIC STORAGE	—	3.1

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に対する組入比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※ファンドにベンチマークはありません。

※2020年9月25日が設定日のため、2019年以前の実績はありません。2020年は9月25日から12月末までの騰落率です。2021年は8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に、申込手数料と当該手数料に係る消費税等相当額を加算した額です。
- (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号口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。

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。

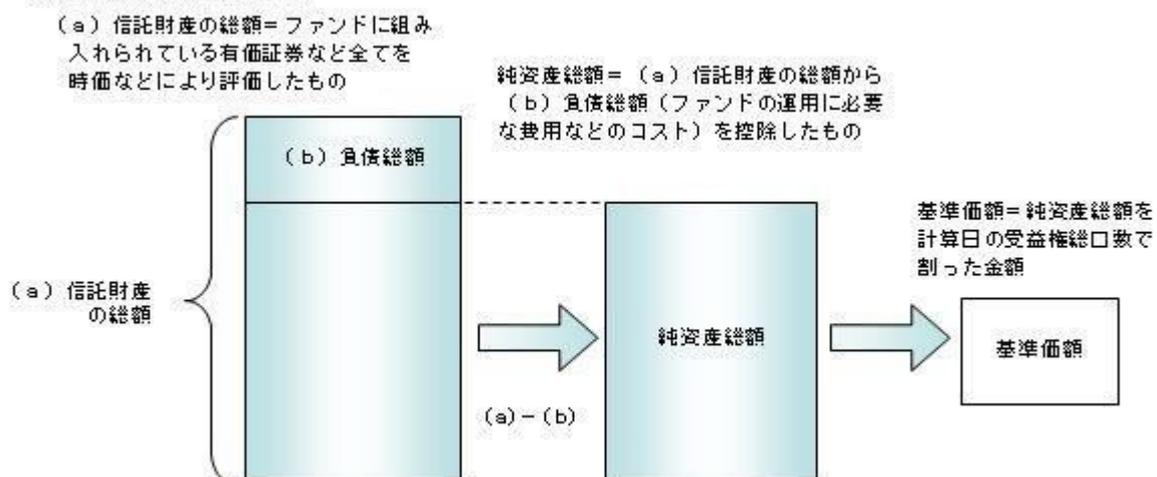
3【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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。

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債(国内・外国)

原則として、基準価額計算日^{*}における以下のいずれかの価額で評価します。

- ・日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)
 - ・金融商品取引業者(第一種金融商品取引業者および外国の法令に準拠して設立された法人でこの者に類する者をいいます。)、銀行などの提示する価額(売気配相場を除きます。)
 - ・価格情報会社の提供する価額
- 残存期間1年以内の公社債などについては、一部償却原価法により評価することができます。

*外国公社債については、基準価額計算日に知りうる直近の日とします。

国内上場不動産投信

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

海外上場不動産投信

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

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

基準価額の照会方法

販売会社または委託会社の照会先にお問い合わせください。

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時)

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

2030年8月20日までとします(2020年9月25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8月21日から翌年8月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき

ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき

ハ) やむを得ない事情が発生したとき

- 2) この場合、委託会社は書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行ないます。(後述の「書面決議」をご覧ください。)
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 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。)
- 二) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

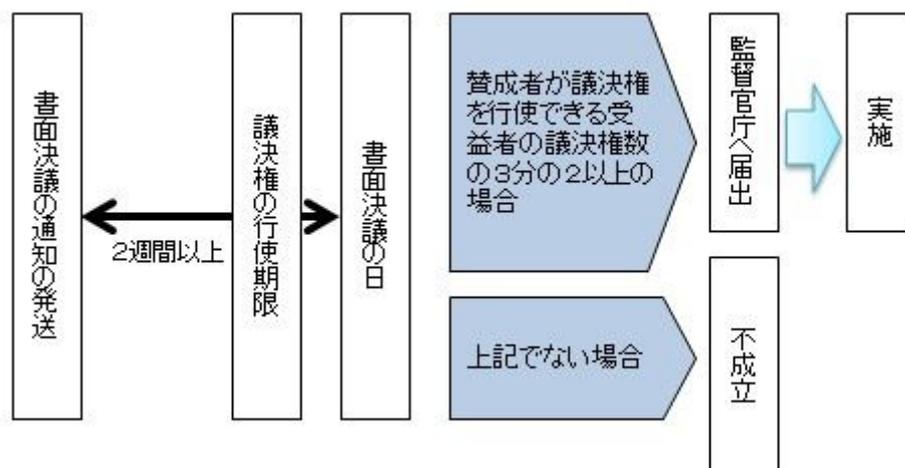
信託約款の変更など

- 1) 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、この信託約款を変更すること、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。

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週間前までに知っている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行ないません。
- 5) 当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、併合にかかる他のファンドにおいて併合の書面決議が否決された場合は、当該他のファンドとの併合を行なうことはできません。
- 6) 当ファンドは、受益者からの換金請求に対して、投資信託契約の一部を解約することにより応じることができるため、受益者の保護に欠けるおそれがないものとして、書面決議において反対した受益者からの買取請求は受け付けません。

＜書面決議の主な流れ＞



公告

公告は電子公告により行ない、委託会社のホームページに掲載します。

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

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

運用報告書の作成

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

関係法人との契約について

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

他の受益者の氏名などの開示の請求の制限

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

(1) 収益分配金・償還金受領権

- ・受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を、自己に帰属する受益権の口数に応じて受領する権利を有します。
- ・ただし、受益者が収益分配金については支払開始日から5年間、償還金については支払開始日から10年間請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間(2020年 9月25日から2021年 8月20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】

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 2021年 8月20日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	50,165,277
親投資信託受益証券	6,128,292,050
流動資産合計	6,178,457,327
資産合計	6,178,457,327
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	727,850
未払委託者報酬	18,681,458
未払利息	136
その他未払費用	189,564
流動負債合計	19,599,008
負債合計	19,599,008
純資産の部	
元本等	
元本	5,531,926,085
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	626,932,234
（分配準備積立金）	397,415,671
元本等合計	6,158,858,319
純資産合計	6,158,858,319
負債純資産合計	6,178,457,327

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日
営業収益	
有価証券売買等損益	460,358,050
営業収益合計	460,358,050
営業費用	
支払利息	46,615
受託者報酬	1,283,939
委託者報酬	32,954,400
その他費用	334,057
営業費用合計	34,619,011
営業利益又は営業損失（ ）	425,739,039
経常利益又は経常損失（ ）	425,739,039
当期純利益又は当期純損失（ ）	425,739,039
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（ ）	28,323,368
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	239,431,750
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	239,431,750
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,915,187
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	9,915,187
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	626,932,234

(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、信託約款の規定により、設定日（2020年 9月25日）から2021年 8月20日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2021年 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首元本額	2,185,671,585円
期中追加設定元本額	3,956,173,166円
期中一部解約元本額	609,918,666円
2. 計算期間の末日における受益権の総数	5,531,926,085口
3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1133円
(10,000口当たり純資産額)	(11,133円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日	
分配金の計算過程	
A 費用控除後の配当等収益額	55,987,149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	341,428,522円
C 収益調整金額	229,516,563円
D 分配準備積立金額	0円
E 当ファンドの分配対象収益額(E=A+B+C+D)	626,932,234円
F 当ファンドの期末残存口数	5,531,926,085口
G 10,000口当たり収益分配対象額(G=E/F×10,000)	1,133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

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期

自 2020年 9月25日

至 2021年 8月20日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

第1期

2021年 8月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

親投資信託受益証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期

自 2020年 9月25日

至 2021年 8月20日

該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2020年 9月25日 至 2021年 8月20日
	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	427,781,297
合計	427,781,297

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）	1,052,175,599	1,053,648,644	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	2,328,237,987	2,467,466,618	
	R M先進国債券マザーファンド	193,878,816	212,355,467	
	R M新興国債券マザーファンド	110,183,036	119,317,209	
	R M国内株式E S Gマザーファンド	302,435,396	359,958,608	
	R M先進国株式E S Gマザーファンド	935,297,195	1,325,129,065	
	R M新興国株式マザーファンド	145,390,595	228,917,491	

	R M国内リートマザーファンド	77,726,408	118,556,090	
	R M先進国リートマザーファンド	181,979,669	242,942,858	
	合計	5,327,304,701	6,128,292,050	

(注)券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

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

R M国内債券マザーファンド（埼玉重視型）

貸借対照表

(単位：円)

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	15,217,858
国債証券	281,995,600
地方債証券	755,800,500
未収利息	586,613
前払費用	29,051
流動資産合計	1,053,629,622
資産合計	1,053,629,622
負債の部	
流動負債	
未払利息	41
その他未払費用	68
流動負債合計	109
負債合計	109
純資産の部	

2021年 8月20日現在

元本等	
元本	1,052,175,599
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,453,914
元本等合計	1,053,629,513
純資産合計	1,053,629,513
負債純資産合計	1,053,629,622

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	372,063,000円
期中追加設定元本額	698,614,201円
期中一部解約元本額	18,501,602円
期末元本額	1,052,175,599円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S G	1,052,175,599円
2. 計算日における受益権の総数	1,052,175,599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	1.0014円
(10,000口当たり純資産額)	(10,014円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券、地方債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		823,250

地方債証券	930,000
合計	1,753,250

(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425回利付国債(2年)	90,000,000	90,247,500	
	第139回利付国債(5年)	60,000,000	60,379,200	
	第362回利付国債(10年)	130,000,000	131,368,900	
国債証券合計		280,000,000	281,995,600	
地方債証券	平成24年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,033,000	
	平成27年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,055,000	
	平成29年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	101,086,000	
	令和2年度第7回埼玉県公募公債	150,000,000	150,886,500	
	令和2年度第9回埼玉県公募公債	100,000,000	100,707,000	
	令和3年度第2回埼玉県公募公債(5年)	100,000,000	100,023,000	
	令和3年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	100,010,000	
地方債証券合計		750,000,000	755,800,500	
合計			1,037,796,100	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	394,459,386
コール・ローン	1,587,241,293
国債証券	268,965,222,509
派生商品評価勘定	2,021,789,307
未収入金	203,417
未収利息	1,039,734,565
前払費用	143,785,735
流動資産合計	274,152,436,212
資産合計	
274,152,436,212	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	182,932,012
未払金	16,466,664
未払解約金	47,189,000
未払利息	4,305
その他未払費用	4,733
流動負債合計	246,596,714
負債合計	
246,596,714	
純資産の部	
元本等	
元本	258,458,092,431
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	15,447,747,067
元本等合計	273,905,839,498
純資産合計	
273,905,839,498	
負債純資産合計	
274,152,436,212	

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 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	173,656,637,905円
期中追加設定元本額	149,980,062,446円
期中一部解約元本額	65,178,607,920円
期末元本額	258,458,092,431円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	25,678,903,483円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	14,142,767,839円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,113,688,165円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,670,551,517円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	623,215,187円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	178,978,250円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	159,206,272円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	47,783,697円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,479,120円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,144,809円
リスクコントロール・オープン	332,194,079円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,328,237,987円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,256,183,310円
FWりそな先進国債券インデックスファンド(為替ヘッジあり)	140,426,779,878円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,070,662,348円
Smart-i 8資産バランス 安定型	856,968,851円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	589,248,708円
Smart-i 8資産バランス 成長型	227,702,465円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	9,211,332,528円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	17,231,475,461円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	10,190,414,088円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	7,425,486,445円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,449,035,823円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,446,822,201円
りそなFT 先進国債券インデックス・為替ヘッジあり(適格機関投資家専用)	7,660,853,530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)	13,737,353円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	3,330,027,087円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	777,412,863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)	501,800円

りそなV I 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)	283,964円
りそなV I 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)	13,323円
2. 計算日における受益権の総数	258,458,092,431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	1.0598円
(10,000口当たり純資産額)	(10,598円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20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 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		3,001,547,406
合計		3,001,547,406

(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 8月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	271,649,669,249	-	269,810,811,954	1,838,857,295
	米ドル	122,772,864,948	-	122,949,284,421	176,419,473
	カナダドル	5,454,728,794	-	5,338,728,422	116,000,372

メキシコペソ	1,950,291,503	-	1,936,801,032	13,490,471
ユーロ	110,760,421,597	-	109,393,360,667	1,367,060,930
英ポンド	17,460,068,082	-	17,152,457,286	307,610,796
スウェーデンクローナ	756,024,746	-	739,427,520	16,597,226
ノルウェークローネ	661,940,022	-	645,854,080	16,085,942
デンマーククローネ	1,371,037,346	-	1,353,960,570	17,076,776
ポーランドズロチ	1,555,991,196	-	1,542,118,701	13,872,495
オーストラリアドル	5,220,085,304	-	5,078,376,098	141,709,206
シンガポールドル	1,182,035,240	-	1,177,565,810	4,469,430
マレーシアリンギット	1,223,409,213	-	1,222,702,338	706,875
イスラエルシケル	1,280,771,258	-	1,280,175,009	596,249
合計	271,649,669,249	-	269,810,811,954	1,838,857,295

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,464,356.42	
		US TREASURY N/B	2,950,000.00	3,000,152.95	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,003,330.00	
		US TREASURY N/B	2,750,000.00	2,792,031.55	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,535,085.25	
		US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,383,265.66	
		US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,715,174.35	
		US TREASURY N/B	8,760,000.00	8,764,556.95	
		US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,471,618.40	
		US TREASURY N/B	5,230,000.00	5,326,223.63	
		US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,774,663.93	
		US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,802,718.46	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,516,328.03	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,552,880.75	
		US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,896,171.15	
		US TREASURY N/B	7,180,000.00	7,314,063.52	
		US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,280,989.21	
		US TREASURY N/B	6,470,000.00	6,470,884.44	
		US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,620,445.13	
		US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,560,365.29	
		US TREASURY N/B	9,230,000.00	9,228,918.24	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,374,597.59	
		US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,414,943.63	
		US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,953,577.24	
		US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,757,595.85	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,545,654.25	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,347,482.35	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,556,660.10	
		US TREASURY N/B	11,280,000.00	11,275,152.98	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,518,730.25	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,186,143.75	
		US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,438,216.65	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,891,910.02			

US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,504,853.45
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,690,573.17
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,902,821.27
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,530,241.29
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,896,495.85
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,112,626.40
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,881,984.24
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,297,304.63
US TREASURY N/B	7,750,000.00	7,756,962.60
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,229,371.79
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,319,900.00
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,082,981.88
US TREASURY N/B	13,450,000.00	13,428,458.48
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,142,410.13
US TREASURY N/B	3,890,000.00	4,081,460.74
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,657,909.85
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,988,515.40
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,373,831.19
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,238,663.22
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,190,156.04
US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,409,347.56
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,038,609.37
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,913,406.06
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,902,937.50
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,782,898.23
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,997,656.00
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,521,668.31
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,367,197.37
US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,574,991.93
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,008,649.85
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,848,077.99
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,446,282.08
US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,571,841.66
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,192,059.17
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,175,278.06

US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,922,574.07	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,881,984.24	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,533,774.83	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,987,226.00	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,598,482.35	
US TREASURY N/B	10,580,000.00	10,584,132.54	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,422,406.19	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,088,492.93	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,179,677.76	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	6,038,694.85	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,280,563.98	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,266,281.25	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,488,680.32	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,638,027.99	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,792,077.54	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,554,433.49	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,157,968.40	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,465,859.23	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,755,087.36	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,541,321.72	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,650,921.81	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,850,346.66	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,557,448.25	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,781,230.15	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,772,670.17	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,369,367.09	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,042,031.12	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,540,437.44	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,959,421.78	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,796,747.55	
US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,386,707.90	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,148,555.33	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,478,699.19	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,225,548.96	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,717,970.90	

US TREASURY N/B	7,640,000.00	7,626,868.36	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,754,510.87	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,616,759.47	
US TREASURY N/B	3,950,000.00	4,177,279.05	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,681,590.08	
US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,252,460.47	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,294,237.50	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,587,696.97	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,448,720.67	
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,652,334.08	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,644,038.59	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,050,059.37	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,893,085.50	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,662,653.30	
US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,922,879.93	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,414,242.16	
US TREASURY N/B	7,180,000.00	7,057,154.50	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,940,753.12	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,880,645.24	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,727,613.10	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,842,574.07	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,398,925.50	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,058,928.73	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,100,534.69	
US TREASURY N/B	4,940,000.00	5,141,652.28	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,836,165.92	
US TREASURY N/B	9,800,000.00	9,708,890.38	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,856,482.67	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,979,650.87	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,690,332.00	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,706,616.61	
US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,643,151.15	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,875,763.52	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,401,968.12	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,844,492.12	

US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,537,577.80	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,740,765.56	
US TREASURY N/B	5,830,000.00	6,037,921.12	
US TREASURY N/B	2,880,000.00	2,966,174.78	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,459,470.21	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,627,001.46	
US TREASURY N/B	5,740,000.00	6,093,592.60	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,658,375.00	
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,853,768.51	
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,352,109.98	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,951,446.27	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,781.20	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,766,640.52	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,096,889.47	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	5,013,241.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,481,000.00	
US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,187,210.88	
US TREASURY N/B	8,110,000.00	7,866,382.89	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,988,905.10	
US TREASURY N/B	4,290,000.00	4,186,604.13	
US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,647,529.47	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,878,487.50	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,660,223.37	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,980,382.66	
US TREASURY N/B	5,100,000.00	4,994,812.50	
US TREASURY N/B	20,170,000.00	19,890,298.57	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,509,038.77	
US TREASURY N/B	9,190,000.00	9,344,721.92	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,839,711.88	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,603,593.75	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,310,250.00	
US TREASURY N/B	220,000.00	287,185.93	
US TREASURY N/B	8,390,000.00	9,441,699.08	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,420,232.44	
US TREASURY N/B	6,610,000.00	7,348,847.95	

US TREASURY N/B	6,010,000.00	6,580,480.01	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,197,851.50	
US TREASURY N/B	3,460,000.00	3,633,067.47	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,480,632.34	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,113,510.91	
US TREASURY N/B	10,120,000.00	9,660,646.11	
US TREASURY N/B	15,650,000.00	14,901,122.46	
US TREASURY N/B	10,450,000.00	10,155,685.15	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,428,922.06	
US TREASURY N/B	9,890,000.00	9,812,734.37	
US TREASURY N/B	13,850,000.00	14,365,046.87	
US TREASURY N/B	540,000.00	761,125.73	
US TREASURY N/B	130,000.00	194,720.69	
US TREASURY N/B	690,000.00	978,721.87	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,772,083.43	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,240,837.44	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,821,721.87	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,948,496.01	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,296,312.48	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,154,339.00	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,368,593.75	
US TREASURY N/B	4,640,000.00	4,172,012.38	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,914,185.12	
US TREASURY N/B	8,140,000.00	7,291,977.24	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,736,260.08	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,129,062.50	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,723,203.08	
US TREASURY N/B	7,960,000.00	8,091,837.49	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,637,926.07	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,475,312.20	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,449,731.19	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,282,775.00	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,655,685.10	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,297,082.35	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,914,828.08	

US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,171,550.00	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,772,087.36	
US TREASURY N/B	2,960,000.00	3,527,487.35	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,236,456.25	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,070,068.75	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,200,485.70	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,499,816.76	
US TREASURY N/B	3,930,000.00	4,889,625.82	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,417,421.84	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,800,123.18	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,059,667.75	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,108,101.01	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	2,234,618.74	
US TREASURY N/B	3,070,000.00	3,460,345.58	
US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,523,781.25	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,579,872.67	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,680,129.63	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,631,588.84	
US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,945,880.38	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	4,063,344.01	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,800,515.62	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	5,022,157.95	
US TREASURY N/B	3,940,000.00	4,998,566.89	
US TREASURY N/B	5,090,000.00	6,323,131.90	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	7,342,586.90	
US TREASURY N/B	5,280,000.00	6,582,055.92	
US TREASURY N/B	5,190,000.00	6,330,178.12	
US TREASURY N/B	5,670,000.00	6,133,566.72	
US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,610,228.36	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,353,696.40	
US TREASURY N/B	6,850,000.00	5,869,860.90	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	6,717,687.12	
US TREASURY N/B	7,120,000.00	6,695,025.00	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,580,514.98	
US TREASURY N/B	9,910,000.00	11,053,520.82	

		1,065,830,000.00	1,113,583,023.17 (122,371,638,416)
	米ドル 小計		
カナダドル	GOV OF CANADA	2,050,000.00	2,049,883.15
	GOV OF CANADA	2,110,000.00	2,126,033.89
	GOV OF CANADA	2,600,000.00	2,599,116.00
	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,247,801.75
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,849,287.86
	GOV OF CANADA	2,300,000.00	2,294,988.30
	GOV OF CANADA	1,170,000.00	1,193,118.03
	GOV OF CANADA	2,020,000.00	2,012,463.38
	GOV OF CANADA	2,580,000.00	2,660,477.94
	GOV OF CANADA	840,000.00	876,278.76
	GOV OF CANADA	2,630,000.00	2,609,351.87
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,242,660.36
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,139,609.25
	GOV OF CANADA	600,000.00	601,708.80
	GOV OF CANADA	730,000.00	744,775.20
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,323,047.50
	GOV OF CANADA	3,490,000.00	3,457,155.61
	GOV OF CANADA	2,260,000.00	2,204,216.42
	GOV OF CANADA	850,000.00	877,519.60
	GOV OF CANADA	1,640,000.00	1,651,032.28
	GOV OF CANADA	920,000.00	926,597.32
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,070,246.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	474,304.95
	GOV OF CANADA	1,340,000.00	1,467,391.12
	GOV OF CANADA	3,600,000.00	3,655,551.60
	GOV OF CANADA	3,750,000.00	3,543,986.25
	GOV OF CANADA	2,610,000.00	2,687,394.33
	GOV OF CANADA	950,000.00	1,409,727.80
	GOV OF CANADA	690,000.00	1,038,596.97
	GOV OF CANADA	960,000.00	1,360,376.64
	GOV OF CANADA	1,270,000.00	1,739,764.11
	GOV OF CANADA	1,190,000.00	1,467,636.52
GOV OF CANADA	4,680,000.00	5,000,107.32	

	GOV OF CANADA	500,000.00	643,390.00
	カナダドル 小計	59,280,000.00	62,245,596.88 (5,336,937,476)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	27,030,000.00	27,485,996.10
	UNITED MEXICAN STATE	29,990,000.00	31,318,865.88
	UNITED MEXICAN STATE	28,480,000.00	29,906,563.20
	UNITED MEXICAN STATE	28,740,000.00	31,945,783.18
	UNITED MEXICAN STATE	41,180,000.00	39,858,896.17
	UNITED MEXICAN STATE	32,110,000.00	33,201,855.59
	UNITED MEXICAN STATE	33,010,000.00	36,041,156.44
	UNITED MEXICAN STATE	26,246,000.00	27,560,924.60
	UNITED MEXICAN STATE	9,600,000.00	10,027,968.00
	UNITED MEXICAN STATE	7,500,000.00	9,302,463.75
	UNITED MEXICAN STATE	24,200,000.00	26,399,499.28
	UNITED MEXICAN STATE	20,500,000.00	20,828,344.40
	UNITED MEXICAN STATE	22,280,000.00	23,105,888.39
		メキシコペソ 小計	330,866,000.00
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	695,414.76
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,052,012.00
	GOV OF AUSTRIA	920,000.00	931,159.60
	GOV OF AUSTRIA	1,290,000.00	1,308,576.00
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,403,171.28
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,236,354.74
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,077,325.00
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	717,883.80
	GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	1,448,620.40
	GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,295,850.21
	GOV OF AUSTRIA	1,430,000.00	1,534,342.81
	GOV OF AUSTRIA	1,350,000.00	1,436,818.50
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,725,026.32
	GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,323,196.14
	GOV OF AUSTRIA	1,230,000.00	1,316,579.70
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,369,700.50
	GOV OF AUSTRIA	910,000.00	932,433.04
	GOV OF AUSTRIA	1,180,000.00	1,557,409.65

GOV OF AUSTRIA	1,450,000.00	2,389,924.80	
GOV OF AUSTRIA	420,000.00	405,159.30	
GOV OF AUSTRIA	740,000.00	1,237,153.83	
GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,280,212.22	
GOV OF AUSTRIA	610,000.00	681,168.70	
GOV OF AUSTRIA	410,000.00	921,353.34	
GOV OF AUSTRIA	420,000.00	446,794.74	
GOV OF AUSTRIA	690,000.00	1,284,322.53	
GOV OF AUSTRIA	280,000.00	411,588.94	
GOV OF BELGIUM	1,590,000.00	1,677,515.48	
GOV OF BELGIUM	1,570,000.00	1,656,680.64	
GOV OF BELGIUM	1,280,000.00	1,306,539.52	
GOV OF BELGIUM	1,550,000.00	1,698,786.35	
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,840,110.58	
GOV OF BELGIUM	2,400,000.00	2,540,414.40	
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,156,247.61	
GOV OF BELGIUM	2,020,000.00	2,182,850.38	
GOV OF BELGIUM	1,500,000.00	1,622,219.55	
GOV OF BELGIUM	1,010,000.00	1,044,026.90	
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,495,827.44	
GOV OF BELGIUM	2,230,000.00	2,430,035.46	
GOV OF BELGIUM	1,540,000.00	1,698,185.72	
GOV OF BELGIUM	1,740,000.00	1,804,774.11	
GOV OF BELGIUM	1,840,000.00	2,065,473.60	
GOV OF BELGIUM	1,600,000.00	1,626,292.80	
GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,638,491.75	
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,391,700.00	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	971,381.67	
GOV OF BELGIUM	2,220,000.00	3,733,263.00	
GOV OF BELGIUM	600,000.00	720,186.00	
GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,253,016.24	
GOV OF BELGIUM	640,000.00	646,993.92	
GOV OF BELGIUM	2,120,000.00	3,699,678.12	
GOV OF BELGIUM	1,060,000.00	1,850,669.90	
GOV OF BELGIUM	1,270,000.00	1,595,374.00	

GOV OF BELGIUM	1,140,000.00	1,474,248.00	
GOV OF BELGIUM	680,000.00	1,020,138.72	
GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,192,482.72	
GOV OF BELGIUM	590,000.00	550,573.01	
GOV OF FINLAND	530,000.00	543,369.25	
GOV OF FINLAND	660,000.00	684,979.68	
GOV OF FINLAND	660,000.00	670,404.57	
GOV OF FINLAND	510,000.00	547,891.47	
GOV OF FINLAND	460,000.00	470,472.36	
GOV OF FINLAND	520,000.00	617,013.48	
GOV OF FINLAND	670,000.00	713,463.57	
GOV OF FINLAND	840,000.00	886,807.32	
GOV OF FINLAND	740,000.00	789,692.54	
GOV OF FINLAND	470,000.00	578,981.15	
GOV OF FINLAND	510,000.00	546,280.89	
GOV OF FINLAND	1,240,000.00	1,333,446.40	
GOV OF FINLAND	360,000.00	370,924.56	
GOV OF FINLAND	490,000.00	541,129.54	
GOV OF FINLAND	410,000.00	425,454.13	
GOV OF FINLAND	390,000.00	452,307.18	
GOV OF FINLAND	580,000.00	591,847.66	
GOV OF FINLAND	470,000.00	483,539.76	
GOV OF FINLAND	490,000.00	751,770.69	
GOV OF FINLAND	410,000.00	536,717.06	
GOV OF FINLAND	400,000.00	385,464.80	
GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,643,112.00	
GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,143,532.00	
GOV OF FRANCE	5,720,000.00	5,786,472.12	
GOV OF FRANCE	5,910,000.00	6,168,343.83	
GOV OF FRANCE	4,030,000.00	4,470,680.50	
GOV OF FRANCE	3,690,000.00	3,755,154.33	
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,520,779.48	
GOV OF FRANCE	3,670,000.00	3,974,261.35	
GOV OF FRANCE	3,820,000.00	4,129,500.22	
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,552,616.56	

GOV OF FRANCE	5,250,000.00	5,484,738.00	
GOV OF FRANCE	3,250,000.00	4,169,915.75	
GOV OF FRANCE	4,190,000.00	4,488,998.40	
GOV OF FRANCE	4,970,000.00	5,110,084.42	
GOV OF FRANCE	4,910,000.00	5,873,572.77	
GOV OF FRANCE	4,540,000.00	4,784,578.88	
GOV OF FRANCE	4,310,000.00	4,501,001.96	
GOV OF FRANCE	1,230,000.00	1,266,272.70	
GOV OF FRANCE	4,150,000.00	4,524,330.00	
GOV OF FRANCE	5,710,000.00	6,889,383.37	
GOV OF FRANCE	5,560,000.00	6,022,614.24	
GOV OF FRANCE	6,310,000.00	6,852,660.00	
GOV OF FRANCE	4,240,000.00	6,198,366.96	
GOV OF FRANCE	4,730,000.00	5,052,779.93	
GOV OF FRANCE	5,330,000.00	5,472,577.50	
GOV OF FRANCE	5,330,000.00	6,660,352.01	
GOV OF FRANCE	5,650,000.00	5,772,350.75	
GOV OF FRANCE	5,390,000.00	6,298,565.35	
GOV OF FRANCE	2,720,000.00	2,759,755.52	
GOV OF FRANCE	4,140,000.00	6,892,996.50	
GOV OF FRANCE	4,420,000.00	5,108,600.64	
GOV OF FRANCE	2,910,000.00	4,796,401.68	
GOV OF FRANCE	4,900,000.00	5,701,581.20	
GOV OF FRANCE	2,780,000.00	4,576,057.92	
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	4,418,093.16	
GOV OF FRANCE	2,400,000.00	2,476,077.60	
GOV OF FRANCE	4,180,000.00	7,545,969.64	
GOV OF FRANCE	1,460,000.00	1,483,932.32	
GOV OF FRANCE	2,720,000.00	4,463,068.48	
GOV OF FRANCE	3,370,000.00	4,620,900.19	
GOV OF FRANCE	3,360,000.00	4,190,020.80	
GOV OF FRANCE	3,560,000.00	3,685,450.84	
GOV OF FRANCE	900,000.00	923,679.00	
GOV OF FRANCE	2,110,000.00	4,269,816.24	
GOV OF FRANCE	1,850,000.00	3,932,922.40	

GOV OF FRANCE	1,480,000.00	2,041,529.76	
GOV OF FRANCE	900,000.00	786,461.40	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,067,603.32	
GOV OF GERMANY	1,550,000.00	1,562,262.05	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,813,715.00	
GOV OF GERMANY	1,180,000.00	1,191,728.02	
GOV OF GERMANY	2,340,000.00	2,420,063.10	
GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,155,195.77	
GOV OF GERMANY	2,460,000.00	2,491,606.81	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,401,695.45	
GOV OF GERMANY	1,810,000.00	1,835,034.11	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,798,291.35	
GOV OF GERMANY	2,910,000.00	2,960,299.35	
GOV OF GERMANY	3,520,000.00	3,746,667.58	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,583,706.84	
GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,680,730.64	
GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,963,861.55	
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,831,265.96	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,076,530.66	
GOV OF GERMANY	2,120,000.00	2,182,546.36	
GOV OF GERMANY	3,000,000.00	3,219,330.00	
GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,431,581.88	
GOV OF GERMANY	350,000.00	362,391.50	
GOV OF GERMANY	3,410,000.00	3,611,476.44	
GOV OF GERMANY	2,660,000.00	2,758,066.22	
GOV OF GERMANY	3,770,000.00	3,917,506.89	
GOV OF GERMANY	3,490,000.00	3,685,597.05	
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,417,044.89	
GOV OF GERMANY	3,790,000.00	4,075,758.42	
GOV OF GERMANY	2,720,000.00	2,843,740.96	
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,452,385.72	
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,381,858.58	
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,580,895.00	
GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,436,841.24	
GOV OF GERMANY	1,080,000.00	1,132,666.08	

GOV OF GERMANY	2,860,000.00	3,061,012.24	
GOV OF GERMANY	3,150,000.00	3,312,873.90	
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,837,909.30	
GOV OF GERMANY	3,310,000.00	3,484,102.69	
GOV OF GERMANY	4,020,000.00	4,231,190.70	
GOV OF GERMANY	700,000.00	741,440.35	
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,295,980.27	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,934,097.92	
GOV OF GERMANY	870,000.00	913,473.03	
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,825,731.42	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,071,356.26	
GOV OF GERMANY	1,160,000.00	1,205,092.33	
GOV OF GERMANY	3,010,000.00	5,083,318.10	
GOV OF GERMANY	2,360,000.00	4,340,700.80	
GOV OF GERMANY	2,180,000.00	4,315,187.92	
GOV OF GERMANY	2,160,000.00	3,777,723.36	
GOV OF GERMANY	3,270,000.00	5,337,457.50	
GOV OF GERMANY	3,350,000.00	5,607,044.40	
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	4,275,257.61	
GOV OF GERMANY	4,300,000.00	4,361,770.71	
GOV OF IRELAND	510,000.00	513,777.06	
GOV OF IRELAND	730,000.00	783,161.95	
GOV OF IRELAND	820,000.00	906,551.00	
GOV OF IRELAND	1,350,000.00	1,644,325.65	
GOV OF IRELAND	1,530,000.00	1,647,213.30	
GOV OF IRELAND	710,000.00	739,461.45	
GOV OF IRELAND	810,000.00	883,688.13	
GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,402,206.12	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,027,485.22	
GOV OF IRELAND	1,320,000.00	1,369,721.76	
GOV OF IRELAND	530,000.00	609,848.21	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,061,374.65	
GOV OF IRELAND	420,000.00	485,664.90	
GOV OF IRELAND	590,000.00	614,701.53	
GOV OF IRELAND	650,000.00	803,273.90	

GOV OF IRELAND	350,000.00	362,397.98
GOV OF IRELAND	980,000.00	1,327,519.76
GOV OF IRELAND	780,000.00	967,763.16
GOV OF ITALY	1,700,000.00	1,722,909.20
GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,773,214.35
GOV OF ITALY	2,500,000.00	2,553,052.25
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,243,199.37
GOV OF ITALY	3,020,000.00	3,038,747.25
GOV OF ITALY	1,790,000.00	1,804,460.51
GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,870,801.68
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,728,363.00
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,105,451.54
GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,366,543.37
GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,535,140.50
GOV OF ITALY	2,530,000.00	2,567,378.47
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,101,080.36
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,648,429.57
GOV OF ITALY	4,870,000.00	4,914,621.85
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,225,520.00
GOV OF ITALY	1,890,000.00	1,907,170.83
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,485,187.76
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,141,255.14
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,362,029.17
GOV OF ITALY	1,960,000.00	2,203,016.08
GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,166,458.45
GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,216,800.19
GOV OF ITALY	3,110,000.00	3,177,143.65
GOV OF ITALY	2,000,000.00	2,374,274.00
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,637,493.24
GOV OF ITALY	2,710,000.00	2,888,449.69
GOV OF ITALY	1,730,000.00	1,867,656.44
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,971,801.24
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,525,754.00
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,374,855.79
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,222,943.78

GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,241,175.42	
GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,595,878.40	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,015,054.86	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,400,011.68	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,384,716.75	
GOV OF ITALY	1,990,000.00	2,239,725.10	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,945,830.34	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,336,097.29	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,598,510.98	
GOV OF ITALY	2,330,000.00	2,610,765.00	
GOV OF ITALY	2,040,000.00	2,053,035.60	
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,204,173.24	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,501,030.82	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	3,024,034.80	
GOV OF ITALY	2,640,000.00	3,199,195.29	
GOV OF ITALY	2,750,000.00	3,851,859.00	
GOV OF ITALY	3,390,000.00	4,282,587.00	
GOV OF ITALY	2,770,000.00	2,995,644.20	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	1,994,599.63	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,522,154.24	
GOV OF ITALY	2,810,000.00	2,911,314.55	
GOV OF ITALY	3,850,000.00	5,860,624.00	
GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,308,387.87	
GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,147,249.38	
GOV OF ITALY	2,790,000.00	3,084,325.47	
GOV OF ITALY	2,830,000.00	4,406,310.00	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,494,082.69	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	4,138,917.96	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,060,389.50	
GOV OF ITALY	1,500,000.00	1,600,559.24	
GOV OF ITALY	1,810,000.00	2,131,101.24	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	3,893,764.68	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	1,569,603.48	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	2,706,383.06	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	3,682,911.56	

GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,364,040.80	
GOV OF ITALY	2,430,000.00	3,992,278.59	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,864,590.66	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	3,184,504.41	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,238,919.00	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	2,092,488.24	
GOV OF ITALY	2,420,000.00	3,050,894.00	
GOV OF ITALY	1,790,000.00	2,557,093.39	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	2,433,294.66	
GOV OF ITALY	1,650,000.00	1,997,857.95	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,384,836.40	
GOV OF ITALY	1,020,000.00	1,277,152.20	
GOV OF ITALY	540,000.00	565,013.34	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,744,707.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,930,000.00	2,023,923.45	
GOV OF NETHERLANDS	1,620,000.00	1,651,068.36	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,774,389.80	
GOV OF NETHERLANDS	2,200,000.00	2,287,886.47	
GOV OF NETHERLANDS	2,010,000.00	2,132,137.65	
GOV OF NETHERLANDS	1,910,000.00	1,978,735.17	
GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	2,104,018.65	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,567,156.64	
GOV OF NETHERLANDS	1,990,000.00	2,176,654.04	
GOV OF NETHERLANDS	1,070,000.00	1,134,737.14	
GOV OF NETHERLANDS	1,610,000.00	1,673,350.28	
GOV OF NETHERLANDS	1,390,000.00	1,440,127.57	
GOV OF NETHERLANDS	1,790,000.00	2,376,760.21	
GOV OF NETHERLANDS	1,860,000.00	3,079,412.28	
GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	883,975.68	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,335,144.00	
GOV OF NETHERLANDS	2,190,000.00	3,929,610.06	
GOV OF NETHERLANDS	2,010,000.00	3,448,367.05	
GOV OF NETHERLANDS	920,000.00	905,280.00	
GOV OF SPAIN	1,940,000.00	1,965,854.38	
GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,468,793.88	

GOV OF SPAIN	2,600,000.00	2,627,562.60	
GOV OF SPAIN	2,690,000.00	2,740,674.22	
GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,877,220.64	
GOV OF SPAIN	1,540,000.00	1,745,083.34	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,797,185.00	
GOV OF SPAIN	1,880,000.00	1,908,494.02	
GOV OF SPAIN	2,120,000.00	2,170,651.04	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,446,419.17	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,381,376.84	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,385,772.35	
GOV OF SPAIN	2,390,000.00	2,883,078.51	
GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,680,696.02	
GOV OF SPAIN	1,910,000.00	1,946,906.16	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,194,241.12	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	3,277,156.23	
GOV OF SPAIN	3,060,000.00	3,334,644.48	
GOV OF SPAIN	2,670,000.00	2,954,181.45	
GOV OF SPAIN	3,140,000.00	3,343,892.76	
GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,668,843.64	
GOV OF SPAIN	1,250,000.00	1,267,448.75	
GOV OF SPAIN	2,300,000.00	2,548,359.06	
GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,321,426.55	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,465,951.29	
GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,858,468.24	
GOV OF SPAIN	2,730,000.00	3,057,539.66	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,494,734.92	
GOV OF SPAIN	1,920,000.00	2,000,419.20	
GOV OF SPAIN	2,220,000.00	2,599,532.97	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,177,798.30	
GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,428,324.60	
GOV OF SPAIN	1,210,000.00	1,244,130.58	
GOV OF SPAIN	2,650,000.00	4,238,728.00	
GOV OF SPAIN	2,010,000.00	2,486,199.95	
GOV OF SPAIN	2,470,000.00	2,922,841.89	
GOV OF SPAIN	2,340,000.00	3,614,822.64	

	GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,181,769.90	
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	3,615,229.12	
	GOV OF SPAIN	2,130,000.00	2,274,740.31	
	GOV OF SPAIN	2,330,000.00	4,019,646.10	
	GOV OF SPAIN	1,700,000.00	3,224,823.50	
	GOV OF SPAIN	1,970,000.00	2,822,035.24	
	GOV OF SPAIN	1,540,000.00	2,150,231.61	
	GOV OF SPAIN	2,320,000.00	2,259,820.34	
	GOV OF SPAIN	1,660,000.00	2,725,105.80	
	GOV OF SPAIN	590,000.00	567,397.27	
	ユーロ 小計	721,620,000.00	850,129,266.76 (109,139,595,266)	
英ポンド	UK TREASURY	2,530,000.00	2,574,513.32	
	UK TREASURY	3,920,000.00	3,920,729.51	
	UK TREASURY	2,330,000.00	2,359,008.50	
	UK TREASURY	1,840,000.00	1,920,571.37	
	UK TREASURY	3,390,000.00	3,385,137.37	
	UK TREASURY	1,750,000.00	1,789,812.50	
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,736,298.06	
	UK TREASURY	250,000.00	250,246.75	
	UK TREASURY	880,000.00	1,029,764.38	
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,540,901.00	
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,340,437.50	
	UK TREASURY	2,160,000.00	2,146,901.76	
	UK TREASURY	1,470,000.00	1,559,210.91	
	UK TREASURY	1,230,000.00	1,232,829.00	
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,696,457.00	
	UK TREASURY	1,480,000.00	1,839,201.92	
	UK TREASURY	2,130,000.00	2,094,104.38	
	UK TREASURY	1,520,000.00	1,651,966.24	
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,540,255.20	
	UK TREASURY	1,590,000.00	1,639,048.32	
	UK TREASURY	2,240,000.00	2,202,300.80	
	UK TREASURY	1,430,000.00	1,975,274.73	
	UK TREASURY	2,370,000.00	2,283,305.40	

	UK TREASURY	2,060,000.00	2,834,268.30
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,980,644.40
	UK TREASURY	2,870,000.00	2,793,097.20
	UK TREASURY	1,820,000.00	2,683,881.20
	UK TREASURY	2,510,000.00	2,840,567.00
	UK TREASURY	1,710,000.00	2,781,678.88
	UK TREASURY	600,000.00	619,086.00
	UK TREASURY	1,680,000.00	2,625,170.01
	UK TREASURY	1,470,000.00	2,340,494.01
	UK TREASURY	2,950,000.00	3,117,442.00
	UK TREASURY	1,900,000.00	3,212,569.40
	UK TREASURY	2,510,000.00	3,674,831.76
	UK TREASURY	2,030,000.00	3,116,760.90
	UK TREASURY	1,120,000.00	1,095,154.81
	UK TREASURY	1,860,000.00	3,236,572.60
	UK TREASURY	1,720,000.00	1,936,173.72
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,790,868.00
	UK TREASURY	1,260,000.00	2,298,687.55
	UK TREASURY	1,810,000.00	1,663,557.60
	UK TREASURY	1,110,000.00	1,194,962.95
	UK TREASURY	1,350,000.00	2,374,090.02
	UK TREASURY	1,590,000.00	1,908,988.33
	UK TREASURY	1,700,000.00	3,384,649.00
	UK TREASURY	2,130,000.00	2,699,613.12
	UK TREASURY	1,320,000.00	2,681,606.92
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,332,643.04
	UK TREASURY	1,660,000.00	2,682,599.84
	UK TREASURY	1,690,000.00	3,463,178.42
	UK TREASURY	1,130,000.00	1,543,844.19
	英債券 小計	92,490,000.00	114,615,957.09 (17,180,931,967)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,350,000.00	10,770,805.12
	GOV OF SWEDEN	7,810,000.00	8,619,379.97
	GOV OF SWEDEN	9,470,000.00	10,055,103.95
	GOV OF SWEDEN	5,160,000.00	5,449,191.16
	GOV OF SWEDEN	7,090,000.00	7,531,813.35

	GOV OF SWEDEN	5,340,000.00	5,362,260.32
	GOV OF SWEDEN	3,350,000.00	4,116,379.50
	GOV OF SWEDEN	4,640,000.00	7,104,898.84
	スウェーデンクローナ 小計	53,210,000.00	59,009,832.21 (736,442,705)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	9,520,000.00	9,755,124.00
	GOV OF NORWAY	7,370,000.00	7,779,772.00
	GOV OF NORWAY	5,390,000.00	5,546,622.62
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,456,388.00
	GOV OF NORWAY	7,630,000.00	7,921,694.90
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,525,888.58
	GOV OF NORWAY	5,420,000.00	5,683,113.90
	GOV OF NORWAY	5,300,000.00	5,407,590.00
	GOV OF NORWAY	3,510,000.00	3,542,116.50
	ノルウェークローネ 小計	50,850,000.00	52,618,310.50 (639,838,655)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	8,580,000.00	8,668,111.44
	GOV OF DENMARK	5,770,000.00	6,044,161.55
	GOV OF DENMARK	2,600,000.00	2,650,466.00
	GOV OF DENMARK	7,130,000.00	7,836,965.16
	GOV OF DENMARK	8,370,000.00	8,871,530.40
	GOV OF DENMARK	10,730,000.00	11,491,347.15
	GOV OF DENMARK	3,800,000.00	3,872,053.70
	GOV OF DENMARK	13,350,000.00	24,381,372.00
	GOV OF DENMARK	4,170,000.00	4,227,379.20
	デンマーククローネ 小計	64,500,000.00	78,043,386.60 (1,347,028,852)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,538,180.00
	GOV OF POLAND	5,650,000.00	5,832,046.95
	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,465,279.80
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,062,767.43
	GOV OF POLAND	3,560,000.00	3,743,163.06
	GOV OF POLAND	3,450,000.00	3,456,317.98
	GOV OF POLAND	3,860,000.00	4,219,216.61
	GOV OF POLAND	5,820,000.00	6,233,220.00

	GOV OF POLAND	5,090,000.00	5,470,134.94
	GOV OF POLAND	4,420,000.00	4,847,193.00
	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,479,968.00
	GOV OF POLAND	4,970,000.00	5,477,934.00
	GOV OF POLAND	3,810,000.00	3,714,559.50
	ポーランドズロチ 小計	51,190,000.00	54,539,981.27 (1,528,084,833)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	3,100,000.00	3,186,898.87
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	2,345,445.09
	GOV OF AUSTRALIA	1,460,000.00	1,565,882.40
	GOV OF AUSTRALIA	3,100,000.00	3,105,862.40
	GOV OF AUSTRALIA	2,380,000.00	2,636,985.02
	GOV OF AUSTRALIA	2,760,000.00	2,742,303.15
	GOV OF AUSTRALIA	2,030,000.00	2,385,177.93
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,705,523.61
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,389,521.66
	GOV OF AUSTRALIA	2,090,000.00	2,354,215.29
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,133,645.16
	GOV OF AUSTRALIA	1,360,000.00	1,548,584.80
	GOV OF AUSTRALIA	2,390,000.00	2,820,049.43
	GOV OF AUSTRALIA	2,440,000.00	2,800,317.71
	GOV OF AUSTRALIA	3,510,000.00	3,969,174.33
	GOV OF AUSTRALIA	3,750,000.00	3,746,226.37
	GOV OF AUSTRALIA	3,010,000.00	3,138,390.34
	GOV OF AUSTRALIA	3,370,000.00	3,344,168.61
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,098,466.43
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,202,397.82
	GOV OF AUSTRALIA	1,440,000.00	1,968,553.29
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,178,087.50
	GOV OF AUSTRALIA	1,290,000.00	1,696,900.44
	GOV OF AUSTRALIA	1,130,000.00	1,410,918.89
	GOV OF AUSTRALIA	1,450,000.00	1,688,950.86
	GOV OF AUSTRALIA	1,540,000.00	1,882,858.81
	GOV OF AUSTRALIA	1,710,000.00	1,634,037.01
	オーストラリアドル 小計	59,190,000.00	64,679,543.22 (5,083,812,097)

シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	720,000.00	740,664.00	
	GOV OF SINGAPORE	1,100,000.00	1,122,225.50	
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	950,495.00	
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	508,963.00	
	GOV OF SINGAPORE	1,090,000.00	1,173,276.00	
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	576,126.00	
	GOV OF SINGAPORE	300,000.00	297,840.00	
	GOV OF SINGAPORE	750,000.00	796,890.00	
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	989,799.00	
	GOV OF SINGAPORE	500,000.00	549,800.00	
	GOV OF SINGAPORE	730,000.00	821,469.00	
	GOV OF SINGAPORE	1,010,000.00	1,143,118.00	
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	337,736.38	
	GOV OF SINGAPORE	640,000.00	767,680.00	
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	937,703.40	
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	416,603.50	
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	716,720.00	
	GOV OF SINGAPORE	690,000.00	807,300.00	
	GOV OF SINGAPORE	740,000.00	750,685.60	
シンガポールドル 小計		13,280,000.00	14,405,094.38	(1,160,762,505)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	810,000.00	822,286.80	
	GOV OF MALAYSIA	1,000,000.00	1,021,056.40	
	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,662,926.49	
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,451,820.88	
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	858,451.73	
	GOV OF MALAYSIA	1,560,000.00	1,607,869.06	
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,545,272.08	
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,322,899.95	
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	763,894.63	
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,190,866.03	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,623,518.93	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,256,474.70	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,600,064.10	
	GOV OF MALAYSIA	700,000.00	736,160.18	

	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,843,939.32
	GOV OF MALAYSIA	1,350,000.00	1,423,962.18
	GOV OF MALAYSIA	2,130,000.00	2,216,892.49
	GOV OF MALAYSIA	2,000,000.00	2,100,096.80
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,227,510.18
	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,756,608.48
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,846,653.38
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,428,830.69
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,188,616.11
	GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,088,945.60
	GOV OF MALAYSIA	1,380,000.00	1,442,128.70
	GOV OF MALAYSIA	1,290,000.00	1,406,385.73
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	977,287.01
	GOV OF MALAYSIA	2,730,000.00	2,599,550.22
	GOV OF MALAYSIA	740,000.00	804,357.20
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,250,131.41
	GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,375,736.83
	GOV OF MALAYSIA	1,500,000.00	1,442,004.90
	マレーシアリングット 小計	47,190,000.00	48,883,199.19 (1,267,624,456)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	2,110,000.00	2,126,036.00
	GOV OF ISRAEL	1,120,000.00	1,147,888.00
	GOV OF ISRAEL	2,150,000.00	2,331,782.50
	GOV OF ISRAEL	2,310,000.00	2,313,696.00
	GOV OF ISRAEL	1,820,000.00	1,897,805.00
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,627,145.00
	GOV OF ISRAEL	3,390,000.00	3,431,866.50
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,981,680.00
	GOV OF ISRAEL	400,000.00	405,880.00
	GOV OF ISRAEL	1,970,000.00	2,666,395.00
	GOV OF ISRAEL	2,100,000.00	2,295,930.00
	GOV OF ISRAEL	2,190,000.00	2,467,035.00
	GOV OF ISRAEL	2,770,000.00	2,789,251.50
	GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	2,062,692.00
	GOV OF ISRAEL	2,210,000.00	3,617,549.00
	GOV OF ISRAEL	2,790,000.00	3,686,427.00

	イスラエルシェケル 小計	33,670,000.00	37,849,058.50 (1,280,316,316)
	合計		268,965,222,509 (268,965,222,509)

(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 243銘柄	100.0%	45.4%
カナダドル	国債証券 34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 343銘柄	100.0%	40.6%
英ポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	6.4%
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 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 13銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 32銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 16銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	186,735,922
コール・ローン	184,621,308
国債証券	40,521,077,654
派生商品評価勘定	106,855
未収利息	160,796,349
前払費用	14,876,931
流動資産合計	41,068,215,019
資産合計	41,068,215,019
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	193,109
未払金	107,482,471
未払解約金	224,000
未払利息	500
その他未払費用	805
流動負債合計	107,900,885
負債合計	107,900,885
純資産の部	
元本等	
元本	37,395,564,705
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	3,564,749,429
元本等合計	40,960,314,134
純資産合計	40,960,314,134
負債純資産合計	41,068,215,019

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	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 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	26,062,017,228円
期中追加設定元本額	17,256,576,930円
期中一部解約元本額	5,923,029,453円
期末元本額	37,395,564,705円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,651,942,228円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	691,401,826円
りそなラップ型ファンド(成長型)	383,097,545円
DCりそな グローバルバランス	65,354,725円
つみたてバランスファンド	729,004,024円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	566,406,865円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	131,845,571円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	37,652,476円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	33,930,430円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,185,556円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	2,160,716円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	1,441,951円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	193,878,816円
FWりそな先進国債券アクティブファンド	272,574,502円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	176,775,389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)	28,586,468,896円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジなし)	816,147,805円
Smart-i 8資産バランス 安定型	183,740,733円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	124,718,093円
Smart-i 8資産バランス 成長型	47,790,486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)	1,009,244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	37,395,564,705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	1.0953円

(10,000口当たり純資産額)

(10,953円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
国債証券		205,217,124
合計		205,217,124

(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 8月20日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	221,827,485	-	221,741,231	86,254
	米ドル	96,983,701	-	96,986,039	2,338
	カナダドル	4,335,898	-	4,312,556	23,342
	メキシコペソ	2,134,475	-	2,135,270	795
	ユーロ	90,538,292	-	90,523,102	15,190
	英ポンド	14,052,630	-	14,015,338	37,292
	デンマーククローネ	3,111,840	-	3,106,962	4,878
	オーストラリアドル	2,903,242	-	2,908,155	4,913
	シンガポールドル	5,826,728	-	5,825,688	1,040

	イスラエルシェケル	1,940,679	-	1,928,121	12,558
	合計	221,827,485	-	221,741,231	86,254

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	360,000.00	366,598.47	
		US TREASURY N/B	400,000.00	406,800.40	
		US TREASURY N/B	270,000.00	274,126.73	
		US TREASURY N/B	390,000.00	397,210.94	
		US TREASURY N/B	480,000.00	487,637.47	
		US TREASURY N/B	860,000.00	860,447.37	
		US TREASURY N/B	560,000.00	568,452.13	
		US TREASURY N/B	520,000.00	529,567.16	
		US TREASURY N/B	350,000.00	356,972.63	
		US TREASURY N/B	600,000.00	600,281.22	

US TREASURY N/B	430,000.00	436,298.81	
US TREASURY N/B	430,000.00	439,095.48	
US TREASURY N/B	410,000.00	419,273.01	
US TREASURY N/B	910,000.00	910,177.72	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,354,833.49	
US TREASURY N/B	670,000.00	686,187.26	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,380,325.34	
US TREASURY N/B	460,000.00	469,128.10	
US TREASURY N/B	720,000.00	739,518.69	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,429,832.40	
US TREASURY N/B	560,000.00	570,718.73	
US TREASURY N/B	400,000.00	409,312.48	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,135,492.16	
US TREASURY N/B	650,000.00	667,913.02	
US TREASURY N/B	300,000.00	306,193.35	
US TREASURY N/B	390,000.00	398,409.37	
US TREASURY N/B	410,000.00	425,390.99	
US TREASURY N/B	930,000.00	931,289.63	
US TREASURY N/B	490,000.00	502,049.00	
US TREASURY N/B	420,000.00	438,284.74	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,097,396.30	
US TREASURY N/B	640,000.00	657,449.98	
US TREASURY N/B	700,000.00	699,371.04	
US TREASURY N/B	320,000.00	328,174.97	
US TREASURY N/B	400,000.00	418,218.72	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,038,781.21	
US TREASURY N/B	1,020,000.00	1,020,916.36	
US TREASURY N/B	470,000.00	480,317.95	
US TREASURY N/B	200,000.00	209,000.00	
US TREASURY N/B	1,560,000.00	1,558,202.25	
US TREASURY N/B	400,000.00	408,078.12	
US TREASURY N/B	320,000.00	335,749.98	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,254,140.52	
US TREASURY N/B	530,000.00	542,297.64	
US TREASURY N/B	130,000.00	136,632.02	

US TREASURY N/B	890,000.00	911,207.00	
US TREASURY N/B	480,000.00	506,550.00	
US TREASURY N/B	940,000.00	937,356.25	
US TREASURY N/B	540,000.00	556,115.59	
US TREASURY N/B	150,000.00	158,578.12	
US TREASURY N/B	710,000.00	749,244.11	
US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,139,465.56	
US TREASURY N/B	440,000.00	458,485.14	
US TREASURY N/B	340,000.00	360,014.81	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,490,527.25	
US TREASURY N/B	140,000.00	146,464.05	
US TREASURY N/B	450,000.00	474,679.66	
US TREASURY N/B	420,000.00	439,933.57	
US TREASURY N/B	440,000.00	463,443.72	
US TREASURY N/B	690,000.00	731,750.38	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,323,869.49	
US TREASURY N/B	490,000.00	512,317.93	
US TREASURY N/B	340,000.00	357,584.35	
US TREASURY N/B	1,540,000.00	1,611,525.74	
US TREASURY N/B	320,000.00	334,124.99	
US TREASURY N/B	700,000.00	735,355.46	
US TREASURY N/B	850,000.00	899,439.40	
US TREASURY N/B	2,010,000.00	2,002,933.43	
US TREASURY N/B	650,000.00	679,097.64	
US TREASURY N/B	1,330,000.00	1,324,596.87	
US TREASURY N/B	390,000.00	407,808.96	
US TREASURY N/B	420,000.00	436,209.35	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,048,933.51	
US TREASURY N/B	220,000.00	231,064.43	
US TREASURY N/B	730,000.00	758,829.23	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,005,329.98	
US TREASURY N/B	400,000.00	417,437.48	
US TREASURY N/B	600,000.00	614,835.90	
US TREASURY N/B	220,000.00	231,429.68	
US TREASURY N/B	710,000.00	733,241.35	

US TREASURY N/B	310,000.00	327,607.00	
US TREASURY N/B	1,030,000.00	1,064,078.47	
US TREASURY N/B	750,000.00	792,949.20	
US TREASURY N/B	400,000.00	421,343.72	
US TREASURY N/B	700,000.00	723,242.16	
US TREASURY N/B	400,000.00	423,406.24	
US TREASURY N/B	860,000.00	896,079.66	
US TREASURY N/B	430,000.00	459,008.18	
US TREASURY N/B	550,000.00	566,166.97	
US TREASURY N/B	730,000.00	767,255.62	
US TREASURY N/B	340,000.00	366,416.40	
US TREASURY N/B	960,000.00	979,837.44	
US TREASURY N/B	250,000.00	268,574.20	
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,167,989.00	
US TREASURY N/B	250,000.00	271,113.27	
US TREASURY N/B	1,060,000.00	1,052,422.59	
US TREASURY N/B	570,000.00	602,797.23	
US TREASURY N/B	240,000.00	260,559.36	
US TREASURY N/B	850,000.00	839,208.91	
US TREASURY N/B	290,000.00	313,834.37	
US TREASURY N/B	470,000.00	511,510.54	
US TREASURY N/B	630,000.00	620,968.32	
US TREASURY N/B	810,000.00	854,233.53	
US TREASURY N/B	310,000.00	336,253.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,726.50	
US TREASURY N/B	230,000.00	252,020.68	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,160,963.17	
US TREASURY N/B	570,000.00	625,508.19	
US TREASURY N/B	770,000.00	756,825.76	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,386,531.25	
US TREASURY N/B	480,000.00	524,831.23	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,555,070.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	325,160.13	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,114,771.44	
US TREASURY N/B	330,000.00	357,959.74	

US TREASURY N/B	590,000.00	581,472.61	
US TREASURY N/B	670,000.00	697,349.60	
US TREASURY N/B	350,000.00	378,034.16	
US TREASURY N/B	430,000.00	460,032.79	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,001,210.90	
US TREASURY N/B	450,000.00	484,259.76	
US TREASURY N/B	870,000.00	870,747.58	
US TREASURY N/B	730,000.00	760,055.41	
US TREASURY N/B	470,000.00	500,595.87	
US TREASURY N/B	730,000.00	730,171.03	
US TREASURY N/B	450,000.00	474,082.02	
US TREASURY N/B	520,000.00	548,153.11	
US TREASURY N/B	610,000.00	631,755.04	
US TREASURY N/B	320,000.00	329,574.97	
US TREASURY N/B	400,000.00	416,859.36	
US TREASURY N/B	350,000.00	364,861.31	
US TREASURY N/B	850,000.00	902,361.27	
US TREASURY N/B	300,000.00	312,750.00	
US TREASURY N/B	440,000.00	461,639.02	
US TREASURY N/B	140,000.00	150,669.52	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,239,253.06	
US TREASURY N/B	300,000.00	296,425.77	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,107,532.32	
US TREASURY N/B	580,000.00	629,367.91	
US TREASURY N/B	1,960,000.00	1,918,350.00	
US TREASURY N/B	1,730,000.00	1,692,494.11	
US TREASURY N/B	800,000.00	863,265.60	
US TREASURY N/B	410,000.00	400,118.34	
US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,324,300.00	
US TREASURY N/B	690,000.00	745,334.75	
US TREASURY N/B	1,180,000.00	1,156,860.90	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,687.50	
US TREASURY N/B	900,000.00	887,519.52	
US TREASURY N/B	850,000.00	945,757.77	
US TREASURY N/B	920,000.00	928,840.55	

US TREASURY N/B	600,000.00	610,101.54
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,236,007.61
US TREASURY N/B	840,000.00	943,408.53
US TREASURY N/B	1,550,000.00	1,574,703.12
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,238,681.25
US TREASURY N/B	120,000.00	156,646.87
US TREASURY N/B	1,170,000.00	1,316,661.25
US TREASURY N/B	890,000.00	1,019,136.86
US TREASURY N/B	1,010,000.00	1,122,895.07
US TREASURY N/B	930,000.00	1,018,277.27
US TREASURY N/B	850,000.00	883,634.75
US TREASURY N/B	980,000.00	1,029,019.11
US TREASURY N/B	560,000.00	576,056.20
US TREASURY N/B	120,000.00	171,309.37
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,365,091.28
US TREASURY N/B	1,610,000.00	1,532,958.92
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,554,937.44
US TREASURY N/B	1,010,000.00	1,393,523.76
US TREASURY N/B	1,470,000.00	1,458,515.62
US TREASURY N/B	1,760,000.00	1,825,449.98
US TREASURY N/B	80,000.00	112,759.36
US TREASURY N/B	90,000.00	134,806.63
US TREASURY N/B	280,000.00	397,162.50
US TREASURY N/B	100,000.00	143,972.65
US TREASURY N/B	70,000.00	90,477.73
US TREASURY N/B	140,000.00	197,706.25
US TREASURY N/B	190,000.00	276,279.28
US TREASURY N/B	40,000.00	57,407.81
US TREASURY N/B	190,000.00	281,185.14
US TREASURY N/B	210,000.00	302,531.25
US TREASURY N/B	950,000.00	854,183.56
US TREASURY N/B	150,000.00	203,636.71
US TREASURY N/B	1,110,000.00	994,360.52
US TREASURY N/B	210,000.00	298,864.44
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,121,250.00

US TREASURY N/B	230,000.00	347,964.83
US TREASURY N/B	1,310,000.00	1,331,696.87
US TREASURY N/B	250,000.00	362,373.02
US TREASURY N/B	990,000.00	1,068,426.50
US TREASURY N/B	230,000.00	308,739.05
US TREASURY N/B	130,000.00	160,346.87
US TREASURY N/B	180,000.00	222,405.46
US TREASURY N/B	200,000.00	242,445.30
US TREASURY N/B	200,000.00	233,515.62
US TREASURY N/B	290,000.00	338,575.00
US TREASURY N/B	320,000.00	396,012.48
US TREASURY N/B	590,000.00	703,114.03
US TREASURY N/B	360,000.00	479,475.00
US TREASURY N/B	320,000.00	434,700.00
US TREASURY N/B	410,000.00	548,471.06
US TREASURY N/B	390,000.00	503,663.66
US TREASURY N/B	430,000.00	534,997.22
US TREASURY N/B	380,000.00	463,792.96
US TREASURY N/B	530,000.00	595,877.30
US TREASURY N/B	450,000.00	550,740.18
US TREASURY N/B	410,000.00	492,015.99
US TREASURY N/B	290,000.00	356,065.62
US TREASURY N/B	530,000.00	597,388.65
US TREASURY N/B	460,000.00	518,937.50
US TREASURY N/B	370,000.00	398,718.32
US TREASURY N/B	350,000.00	422,542.96
US TREASURY N/B	440,000.00	543,503.09
US TREASURY N/B	350,000.00	432,933.58
US TREASURY N/B	480,000.00	568,631.23
US TREASURY N/B	520,000.00	616,362.50
US TREASURY N/B	520,000.00	644,820.28
US TREASURY N/B	760,000.00	964,190.56
US TREASURY N/B	630,000.00	782,627.32
US TREASURY N/B	1,090,000.00	1,447,273.00
US TREASURY N/B	640,000.00	797,824.96

	US TREASURY N/B	780,000.00	951,356.25
	US TREASURY N/B	800,000.00	865,406.24
	US TREASURY N/B	530,000.00	588,776.15
	US TREASURY N/B	1,360,000.00	1,395,965.60
	US TREASURY N/B	930,000.00	796,930.02
	US TREASURY N/B	1,120,000.00	989,974.93
	US TREASURY N/B	1,140,000.00	1,071,956.25
	US TREASURY N/B	1,240,000.00	1,237,190.53
	US TREASURY N/B	1,870,000.00	2,085,780.39
	米ドル 小計	160,340,000.00	167,773,396.91 (18,436,618,586)
カナダドル	GOV OF CANADA	250,000.00	249,985.75
	GOV OF CANADA	380,000.00	382,887.62
	GOV OF CANADA	270,000.00	269,908.20
	GOV OF CANADA	290,000.00	289,716.67
	GOV OF CANADA	300,000.00	306,511.80
	GOV OF CANADA	380,000.00	379,171.98
	GOV OF CANADA	270,000.00	275,334.93
	GOV OF CANADA	330,000.00	328,768.77
	GOV OF CANADA	340,000.00	350,605.62
	GOV OF CANADA	210,000.00	219,069.69
	GOV OF CANADA	450,000.00	446,467.05
	GOV OF CANADA	70,000.00	73,717.14
	GOV OF CANADA	280,000.00	287,469.00
	GOV OF CANADA	200,000.00	204,048.00
	GOV OF CANADA	150,000.00	158,765.70
	GOV OF CANADA	460,000.00	455,670.94
	GOV OF CANADA	350,000.00	341,360.95
	GOV OF CANADA	130,000.00	134,208.88
	GOV OF CANADA	140,000.00	140,941.78
	GOV OF CANADA	220,000.00	221,577.62
	GOV OF CANADA	150,000.00	160,536.90
	GOV OF CANADA	120,000.00	162,618.84
	GOV OF CANADA	300,000.00	328,520.40
	GOV OF CANADA	500,000.00	507,715.50

	GOV OF CANADA	460,000.00	434,728.98
	GOV OF CANADA	370,000.00	380,971.61
	GOV OF CANADA	100,000.00	148,392.40
	GOV OF CANADA	120,000.00	180,625.56
	GOV OF CANADA	160,000.00	226,729.44
	GOV OF CANADA	180,000.00	246,580.74
	GOV OF CANADA	220,000.00	271,327.76
	GOV OF CANADA	660,000.00	705,143.34
	GOV OF CANADA	90,000.00	115,810.20
	カナダドル 小計	8,900,000.00	9,385,889.76 (804,746,188)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	4,820,000.00	4,901,313.40
	UNITED MEXICAN STATE	4,050,000.00	4,229,456.71
	UNITED MEXICAN STATE	4,600,000.00	4,830,414.00
	UNITED MEXICAN STATE	3,830,000.00	4,257,214.66
	UNITED MEXICAN STATE	6,010,000.00	5,817,191.98
	UNITED MEXICAN STATE	4,780,000.00	4,942,537.20
	UNITED MEXICAN STATE	4,720,000.00	5,153,415.88
	UNITED MEXICAN STATE	3,440,000.00	3,612,344.00
	UNITED MEXICAN STATE	2,540,000.00	2,653,233.20
	UNITED MEXICAN STATE	980,000.00	1,215,521.93
	UNITED MEXICAN STATE	3,040,000.00	3,316,300.73
	UNITED MEXICAN STATE	2,700,000.00	2,743,245.36
	UNITED MEXICAN STATE	3,920,000.00	4,065,308.91
	メキシコペソ 小計	49,430,000.00	51,737,497.96 (282,140,097)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	181,412.54
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	126,241.44
	GOV OF AUSTRIA	180,000.00	182,183.40
	GOV OF AUSTRIA	130,000.00	131,872.00
	GOV OF AUSTRIA	220,000.00	232,103.52
	GOV OF AUSTRIA	190,000.00	194,138.32
	GOV OF AUSTRIA	150,000.00	161,598.75
	GOV OF AUSTRIA	90,000.00	92,299.34
	GOV OF AUSTRIA	210,000.00	227,022.60
	GOV OF AUSTRIA	120,000.00	150,972.84

GOV OF AUSTRIA	270,000.00	289,701.09	
GOV OF AUSTRIA	190,000.00	202,218.90	
GOV OF AUSTRIA	130,000.00	183,814.28	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	173,533.92	
GOV OF AUSTRIA	180,000.00	192,670.20	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	164,776.00	
GOV OF AUSTRIA	300,000.00	307,395.50	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	79,190.32	
GOV OF AUSTRIA	210,000.00	346,127.04	
GOV OF AUSTRIA	100,000.00	96,466.50	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	267,492.72	
GOV OF AUSTRIA	160,000.00	209,014.24	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	78,166.90	
GOV OF AUSTRIA	60,000.00	134,832.19	
GOV OF AUSTRIA	70,000.00	74,465.79	
GOV OF AUSTRIA	94,000.00	174,965.67	
GOV OF AUSTRIA	40,000.00	58,798.41	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	274,310.71	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	168,833.69	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	204,146.80	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	284,957.71	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	280,694.83	
GOV OF BELGIUM	350,000.00	370,477.10	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	198,924.32	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	334,991.89	
GOV OF BELGIUM	240,000.00	259,555.12	
GOV OF BELGIUM	160,000.00	165,390.40	
GOV OF BELGIUM	290,000.00	408,920.88	
GOV OF BELGIUM	270,000.00	294,219.54	
GOV OF BELGIUM	350,000.00	385,951.30	
GOV OF BELGIUM	250,000.00	259,306.62	
GOV OF BELGIUM	200,000.00	224,508.00	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	172,793.61	
GOV OF BELGIUM	70,000.00	101,499.48	
GOV OF BELGIUM	400,000.00	463,900.00	

GOV OF BELGIUM	120,000.00	166,522.57	
GOV OF BELGIUM	260,000.00	437,229.00	
GOV OF BELGIUM	220,000.00	264,068.20	
GOV OF BELGIUM	100,000.00	127,858.80	
GOV OF BELGIUM	80,000.00	80,874.24	
GOV OF BELGIUM	310,000.00	540,990.67	
GOV OF BELGIUM	150,000.00	261,887.25	
GOV OF BELGIUM	190,000.00	238,678.00	
GOV OF BELGIUM	170,000.00	219,844.00	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	165,022.44	
GOV OF BELGIUM	110,000.00	168,170.64	
GOV OF BELGIUM	90,000.00	83,985.70	
GOV OF FINLAND	80,000.00	82,018.00	
GOV OF FINLAND	90,000.00	93,406.32	
GOV OF FINLAND	130,000.00	132,049.37	
GOV OF FINLAND	30,000.00	32,228.91	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,138.30	
GOV OF FINLAND	80,000.00	94,925.15	
GOV OF FINLAND	80,000.00	85,189.68	
GOV OF FINLAND	90,000.00	95,015.07	
GOV OF FINLAND	80,000.00	85,372.16	
GOV OF FINLAND	100,000.00	123,187.48	
GOV OF FINLAND	140,000.00	149,959.46	
GOV OF FINLAND	120,000.00	129,043.20	
GOV OF FINLAND	160,000.00	164,855.36	
GOV OF FINLAND	60,000.00	66,260.76	
GOV OF FINLAND	60,000.00	62,261.58	
GOV OF FINLAND	50,000.00	57,988.10	
GOV OF FINLAND	80,000.00	81,634.16	
GOV OF FINLAND	50,000.00	51,440.40	
GOV OF FINLAND	60,000.00	92,053.55	
GOV OF FINLAND	50,000.00	65,453.30	
GOV OF FINLAND	70,000.00	67,456.34	
GOV OF FRANCE	480,000.00	496,788.00	
GOV OF FRANCE	300,000.00	303,330.00	

GOV OF FRANCE	780,000.00	789,064.38	
GOV OF FRANCE	1,050,000.00	1,095,898.65	
GOV OF FRANCE	560,000.00	621,236.00	
GOV OF FRANCE	260,000.00	264,590.82	
GOV OF FRANCE	1,130,000.00	1,151,011.22	
GOV OF FRANCE	600,000.00	649,743.00	
GOV OF FRANCE	570,000.00	616,181.97	
GOV OF FRANCE	830,000.00	850,308.44	
GOV OF FRANCE	880,000.00	919,346.56	
GOV OF FRANCE	340,000.00	436,237.34	
GOV OF FRANCE	610,000.00	653,529.60	
GOV OF FRANCE	1,030,000.00	1,059,031.58	
GOV OF FRANCE	550,000.00	657,935.85	
GOV OF FRANCE	760,000.00	800,942.72	
GOV OF FRANCE	640,000.00	668,362.24	
GOV OF FRANCE	230,000.00	236,782.70	
GOV OF FRANCE	630,000.00	686,826.00	
GOV OF FRANCE	830,000.00	1,001,434.01	
GOV OF FRANCE	880,000.00	953,219.52	
GOV OF FRANCE	860,000.00	933,960.00	
GOV OF FRANCE	620,000.00	906,364.98	
GOV OF FRANCE	820,000.00	875,957.62	
GOV OF FRANCE	880,000.00	903,540.00	
GOV OF FRANCE	710,000.00	887,213.87	
GOV OF FRANCE	880,000.00	899,056.40	
GOV OF FRANCE	810,000.00	946,537.65	
GOV OF FRANCE	490,000.00	497,161.84	
GOV OF FRANCE	540,000.00	899,086.50	
GOV OF FRANCE	620,000.00	716,591.04	
GOV OF FRANCE	410,000.00	675,781.68	
GOV OF FRANCE	870,000.00	1,012,321.56	
GOV OF FRANCE	480,000.00	790,110.72	
GOV OF FRANCE	430,000.00	545,913.81	
GOV OF FRANCE	390,000.00	402,362.61	
GOV OF FRANCE	650,000.00	1,173,416.30	

GOV OF FRANCE	180,000.00	182,950.56	
GOV OF FRANCE	400,000.00	656,333.60	
GOV OF FRANCE	510,000.00	699,305.37	
GOV OF FRANCE	540,000.00	673,396.20	
GOV OF FRANCE	570,000.00	590,086.23	
GOV OF FRANCE	110,000.00	112,894.10	
GOV OF FRANCE	300,000.00	607,082.87	
GOV OF FRANCE	270,000.00	573,994.08	
GOV OF FRANCE	220,000.00	303,470.64	
GOV OF FRANCE	140,000.00	122,338.44	
GOV OF GERMANY	260,000.00	266,127.16	
GOV OF GERMANY	240,000.00	241,898.64	
GOV OF GERMANY	290,000.00	292,465.00	
GOV OF GERMANY	220,000.00	222,186.58	
GOV OF GERMANY	270,000.00	279,238.05	
GOV OF GERMANY	560,000.00	566,624.24	
GOV OF GERMANY	290,000.00	293,725.98	
GOV OF GERMANY	370,000.00	384,687.15	
GOV OF GERMANY	310,000.00	314,287.61	
GOV OF GERMANY	480,000.00	506,860.32	
GOV OF GERMANY	410,000.00	417,086.85	
GOV OF GERMANY	400,000.00	425,757.67	
GOV OF GERMANY	570,000.00	582,099.96	
GOV OF GERMANY	290,000.00	308,496.78	
GOV OF GERMANY	670,000.00	706,685.85	
GOV OF GERMANY	360,000.00	369,295.56	
GOV OF GERMANY	380,000.00	397,646.82	
GOV OF GERMANY	300,000.00	308,850.90	
GOV OF GERMANY	440,000.00	472,168.40	
GOV OF GERMANY	480,000.00	496,132.32	
GOV OF GERMANY	520,000.00	550,723.68	
GOV OF GERMANY	390,000.00	404,378.13	
GOV OF GERMANY	530,000.00	550,737.03	
GOV OF GERMANY	170,000.00	176,642.41	
GOV OF GERMANY	610,000.00	644,187.45	

GOV OF GERMANY	140,000.00	201,420.40	
GOV OF GERMANY	520,000.00	559,206.96	
GOV OF GERMANY	550,000.00	575,021.15	
GOV OF GERMANY	170,000.00	240,985.88	
GOV OF GERMANY	460,000.00	497,014.36	
GOV OF GERMANY	190,000.00	263,482.50	
GOV OF GERMANY	430,000.00	458,957.06	
GOV OF GERMANY	60,000.00	62,925.89	
GOV OF GERMANY	530,000.00	567,250.52	
GOV OF GERMANY	630,000.00	662,574.78	
GOV OF GERMANY	210,000.00	335,618.22	
GOV OF GERMANY	310,000.00	326,305.69	
GOV OF GERMANY	660,000.00	694,673.10	
GOV OF GERMANY	170,000.00	180,064.08	
GOV OF GERMANY	370,000.00	589,136.57	
GOV OF GERMANY	200,000.00	210,329.60	
GOV OF GERMANY	70,000.00	73,497.83	
GOV OF GERMANY	330,000.00	558,768.90	
GOV OF GERMANY	650,000.00	679,041.35	
GOV OF GERMANY	210,000.00	218,163.25	
GOV OF GERMANY	460,000.00	776,852.60	
GOV OF GERMANY	310,000.00	570,176.80	
GOV OF GERMANY	340,000.00	673,010.96	
GOV OF GERMANY	340,000.00	594,641.64	
GOV OF GERMANY	490,000.00	799,802.50	
GOV OF GERMANY	520,000.00	870,347.19	
GOV OF GERMANY	510,000.00	696,607.47	
GOV OF GERMANY	380,000.00	385,458.77	
GOV OF GERMANY	210,000.00	215,459.37	
GOV OF IRELAND	120,000.00	120,888.72	
GOV OF IRELAND	90,000.00	96,554.21	
GOV OF IRELAND	140,000.00	154,777.00	
GOV OF IRELAND	180,000.00	219,243.42	
GOV OF IRELAND	210,000.00	226,088.10	
GOV OF IRELAND	110,000.00	114,564.45	

GOV OF IRELAND	150,000.00	163,645.95	
GOV OF IRELAND	120,000.00	133,543.44	
GOV OF IRELAND	160,000.00	198,069.44	
GOV OF IRELAND	150,000.00	155,650.20	
GOV OF IRELAND	150,000.00	172,598.55	
GOV OF IRELAND	90,000.00	90,974.97	
GOV OF IRELAND	110,000.00	127,197.95	
GOV OF IRELAND	90,000.00	93,768.03	
GOV OF IRELAND	120,000.00	148,296.72	
GOV OF IRELAND	50,000.00	51,771.14	
GOV OF IRELAND	150,000.00	203,191.80	
GOV OF IRELAND	110,000.00	136,479.42	
GOV OF ITALY	270,000.00	273,638.52	
GOV OF ITALY	230,000.00	244,215.15	
GOV OF ITALY	610,000.00	622,944.74	
GOV OF ITALY	340,000.00	364,386.02	
GOV OF ITALY	260,000.00	262,100.41	
GOV OF ITALY	240,000.00	245,351.04	
GOV OF ITALY	200,000.00	204,540.00	
GOV OF ITALY	370,000.00	401,555.18	
GOV OF ITALY	280,000.00	285,617.30	
GOV OF ITALY	340,000.00	374,759.90	
GOV OF ITALY	180,000.00	182,659.33	
GOV OF ITALY	340,000.00	360,791.57	
GOV OF ITALY	500,000.00	511,934.64	
GOV OF ITALY	460,000.00	464,214.79	
GOV OF ITALY	200,000.00	224,800.00	
GOV OF ITALY	490,000.00	494,451.68	
GOV OF ITALY	230,000.00	243,995.13	
GOV OF ITALY	550,000.00	583,015.01	
GOV OF ITALY	180,000.00	181,603.89	
GOV OF ITALY	270,000.00	303,476.70	
GOV OF ITALY	280,000.00	295,906.52	
GOV OF ITALY	340,000.00	371,286.73	
GOV OF ITALY	400,000.00	408,635.84	

GOV OF ITALY	370,000.00	439,240.69	
GOV OF ITALY	350,000.00	372,157.55	
GOV OF ITALY	270,000.00	287,779.12	
GOV OF ITALY	340,000.00	367,053.86	
GOV OF ITALY	220,000.00	245,082.64	
GOV OF ITALY	400,000.00	437,360.00	
GOV OF ITALY	380,000.00	390,668.90	
GOV OF ITALY	270,000.00	327,140.91	
GOV OF ITALY	540,000.00	542,706.14	
GOV OF ITALY	300,000.00	324,484.80	
GOV OF ITALY	300,000.00	332,151.90	
GOV OF ITALY	590,000.00	630,098.76	
GOV OF ITALY	390,000.00	407,912.07	
GOV OF ITALY	270,000.00	303,882.30	
GOV OF ITALY	240,000.00	268,390.39	
GOV OF ITALY	290,000.00	305,210.73	
GOV OF ITALY	450,000.00	627,647.26	
GOV OF ITALY	420,000.00	470,610.00	
GOV OF ITALY	460,000.00	462,939.40	
GOV OF ITALY	210,000.00	214,302.01	
GOV OF ITALY	350,000.00	460,661.95	
GOV OF ITALY	440,000.00	521,794.24	
GOV OF ITALY	610,000.00	739,207.99	
GOV OF ITALY	360,000.00	504,243.36	
GOV OF ITALY	320,000.00	404,256.00	
GOV OF ITALY	510,000.00	551,544.60	
GOV OF ITALY	330,000.00	344,616.69	
GOV OF ITALY	430,000.00	475,669.44	
GOV OF ITALY	490,000.00	507,666.95	
GOV OF ITALY	400,000.00	608,896.00	
GOV OF ITALY	390,000.00	391,422.29	
GOV OF ITALY	180,000.00	186,040.44	
GOV OF ITALY	400,000.00	442,197.20	
GOV OF ITALY	340,000.00	529,380.00	
GOV OF ITALY	330,000.00	393,802.53	

GOV OF ITALY	430,000.00	649,538.22	
GOV OF ITALY	260,000.00	341,211.00	
GOV OF ITALY	250,000.00	266,759.87	
GOV OF ITALY	270,000.00	317,899.08	
GOV OF ITALY	460,000.00	653,697.72	
GOV OF ITALY	270,000.00	266,536.44	
GOV OF ITALY	320,000.00	410,446.72	
GOV OF ITALY	400,000.00	648,971.20	
GOV OF ITALY	200,000.00	262,671.20	
GOV OF ITALY	280,000.00	460,015.64	
GOV OF ITALY	310,000.00	338,025.19	
GOV OF ITALY	240,000.00	400,147.14	
GOV OF ITALY	210,000.00	215,019.00	
GOV OF ITALY	300,000.00	412,991.10	
GOV OF ITALY	310,000.00	390,817.00	
GOV OF ITALY	250,000.00	357,135.94	
GOV OF ITALY	220,000.00	336,682.28	
GOV OF ITALY	270,000.00	326,922.21	
GOV OF ITALY	200,000.00	206,692.00	
GOV OF ITALY	130,000.00	162,774.30	
GOV OF ITALY	110,000.00	115,095.31	
GOV OF NETHERLANDS	160,000.00	170,215.36	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	335,572.80	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	315,945.18	
GOV OF NETHERLANDS	270,000.00	292,125.15	
GOV OF NETHERLANDS	290,000.00	301,585.03	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	339,444.80	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	310,796.10	
GOV OF NETHERLANDS	300,000.00	325,363.71	
GOV OF NETHERLANDS	150,000.00	209,887.05	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	273,449.00	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	265,125.50	
GOV OF NETHERLANDS	330,000.00	342,984.84	
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	124,327.56	
GOV OF NETHERLANDS	250,000.00	331,949.75	

GOV OF NETHERLANDS	280,000.00	463,567.44	
GOV OF NETHERLANDS	120,000.00	121,927.68	
GOV OF NETHERLANDS	190,000.00	211,397.80	
GOV OF NETHERLANDS	320,000.00	574,189.59	
GOV OF NETHERLANDS	310,000.00	531,837.69	
GOV OF NETHERLANDS	140,000.00	137,760.00	
GOV OF SPAIN	270,000.00	273,598.29	
GOV OF SPAIN	280,000.00	304,520.83	
GOV OF SPAIN	470,000.00	474,982.47	
GOV OF SPAIN	470,000.00	478,853.86	
GOV OF SPAIN	260,000.00	288,832.96	
GOV OF SPAIN	250,000.00	283,292.75	
GOV OF SPAIN	400,000.00	447,549.60	
GOV OF SPAIN	290,000.00	294,395.34	
GOV OF SPAIN	320,000.00	327,645.44	
GOV OF SPAIN	330,000.00	365,302.41	
GOV OF SPAIN	640,000.00	651,831.68	
GOV OF SPAIN	370,000.00	399,427.95	
GOV OF SPAIN	340,000.00	410,145.06	
GOV OF SPAIN	390,000.00	433,805.58	
GOV OF SPAIN	390,000.00	397,535.79	
GOV OF SPAIN	260,000.00	289,373.76	
GOV OF SPAIN	360,000.00	473,805.72	
GOV OF SPAIN	450,000.00	490,388.89	
GOV OF SPAIN	330,000.00	365,123.55	
GOV OF SPAIN	240,000.00	255,584.16	
GOV OF SPAIN	640,000.00	708,738.56	
GOV OF SPAIN	600,000.00	664,789.32	
GOV OF SPAIN	430,000.00	477,663.35	
GOV OF SPAIN	200,000.00	277,073.18	
GOV OF SPAIN	340,000.00	496,923.94	
GOV OF SPAIN	480,000.00	537,589.38	
GOV OF SPAIN	420,000.00	442,105.02	
GOV OF SPAIN	320,000.00	333,403.20	
GOV OF SPAIN	370,000.00	433,255.49	

	GOV OF SPAIN	470,000.00	520,405.99
	GOV OF SPAIN	370,000.00	368,229.55
	GOV OF SPAIN	100,000.00	102,820.71
	GOV OF SPAIN	390,000.00	623,812.80
	GOV OF SPAIN	390,000.00	482,397.00
	GOV OF SPAIN	360,000.00	426,001.24
	GOV OF SPAIN	360,000.00	556,126.56
	GOV OF SPAIN	120,000.00	123,315.12
	GOV OF SPAIN	350,000.00	611,270.62
	GOV OF SPAIN	300,000.00	320,385.94
	GOV OF SPAIN	350,000.00	603,809.50
	GOV OF SPAIN	250,000.00	474,238.75
	GOV OF SPAIN	310,000.00	444,076.59
	GOV OF SPAIN	240,000.00	335,101.01
	GOV OF SPAIN	340,000.00	331,180.57
	GOV OF SPAIN	250,000.00	410,407.50
	GOV OF SPAIN	80,000.00	76,935.21
	ユーロ 小計	109,274,000.00	128,138,695.27 (16,450,445,698)
英bond	UK TREASURY	320,000.00	325,630.14
	UK TREASURY	610,000.00	610,113.51
	UK TREASURY	380,000.00	384,731.00
	UK TREASURY	230,000.00	240,071.42
	UK TREASURY	550,000.00	549,211.07
	UK TREASURY	330,000.00	337,507.50
	UK TREASURY	250,000.00	269,611.50
	UK TREASURY	50,000.00	50,049.35
	UK TREASURY	250,000.00	292,546.70
	UK TREASURY	250,000.00	254,090.09
	UK TREASURY	190,000.00	203,746.50
	UK TREASURY	310,000.00	308,120.16
	UK TREASURY	220,000.00	233,351.29
	UK TREASURY	180,000.00	180,414.00
	UK TREASURY	280,000.00	295,036.00
	UK TREASURY	180,000.00	223,686.72

UK TREASURY	330,000.00	324,438.70
UK TREASURY	310,000.00	336,914.16
UK TREASURY	140,000.00	196,032.48
UK TREASURY	220,000.00	226,786.56
UK TREASURY	160,000.00	157,307.20
UK TREASURY	340,000.00	469,645.74
UK TREASURY	420,000.00	404,636.40
UK TREASURY	250,000.00	343,964.59
UK TREASURY	180,000.00	264,085.92
UK TREASURY	490,000.00	476,870.25
UK TREASURY	270,000.00	398,158.20
UK TREASURY	480,000.00	543,216.00
UK TREASURY	190,000.00	309,075.43
UK TREASURY	100,000.00	103,181.00
UK TREASURY	210,000.00	328,146.25
UK TREASURY	240,000.00	382,121.46
UK TREASURY	640,000.00	676,326.40
UK TREASURY	340,000.00	574,880.84
UK TREASURY	190,000.00	278,174.51
UK TREASURY	280,000.00	429,898.05
UK TREASURY	160,000.00	156,450.68
UK TREASURY	260,000.00	452,424.11
UK TREASURY	320,000.00	360,218.36
UK TREASURY	180,000.00	214,904.16
UK TREASURY	160,000.00	291,896.83
UK TREASURY	360,000.00	330,873.33
UK TREASURY	160,000.00	172,246.91
UK TREASURY	190,000.00	334,131.18
UK TREASURY	300,000.00	360,186.48
UK TREASURY	230,000.00	457,923.10
UK TREASURY	330,000.00	418,249.92
UK TREASURY	190,000.00	385,988.87
UK TREASURY	220,000.00	195,454.29
UK TREASURY	260,000.00	420,166.24
UK TREASURY	250,000.00	512,304.50

	UK TREASURY	170,000.00	232,259.71
	英ボンド 小計	14,100,000.00	17,277,455.76 (2,589,890,618)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	1,680,000.00	1,748,304.59
	GOV OF SWEDEN	1,360,000.00	1,500,941.96
	GOV OF SWEDEN	1,100,000.00	1,167,963.50
	GOV OF SWEDEN	1,060,000.00	1,119,407.48
	GOV OF SWEDEN	1,050,000.00	1,115,430.75
	GOV OF SWEDEN	930,000.00	933,876.79
	GOV OF SWEDEN	500,000.00	614,385.00
	GOV OF SWEDEN	730,000.00	1,117,796.57
	スウェーデンクローナ 小計	8,410,000.00	9,318,106.64 (116,289,970)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	1,420,000.00	1,455,071.01
	GOV OF NORWAY	1,060,000.00	1,118,936.00
	GOV OF NORWAY	860,000.00	884,989.88
	GOV OF NORWAY	790,000.00	807,854.00
	GOV OF NORWAY	690,000.00	716,378.70
	GOV OF NORWAY	640,000.00	677,648.25
	GOV OF NORWAY	690,000.00	723,496.05
	GOV OF NORWAY	920,000.00	938,676.00
	GOV OF NORWAY	520,000.00	524,758.00
	ノルウェークローネ 小計	7,590,000.00	7,847,807.89 (95,429,343)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	1,110,000.00	1,121,399.02
	GOV OF DENMARK	970,000.00	1,016,089.55
	GOV OF DENMARK	480,000.00	489,316.80
	GOV OF DENMARK	1,070,000.00	1,176,094.33
	GOV OF DENMARK	1,150,000.00	1,218,908.00
	GOV OF DENMARK	1,740,000.00	1,863,461.70
	GOV OF DENMARK	480,000.00	489,101.52
	GOV OF DENMARK	2,000,000.00	3,652,640.00
	GOV OF DENMARK	620,000.00	628,531.20
	デンマーククローネ 小計	9,620,000.00	11,655,542.12 (201,174,656)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	500,000.00	531,000.00

	GOV OF POLAND	560,000.00	578,043.59
	GOV OF POLAND	180,000.00	178,911.00
	GOV OF POLAND	470,000.00	506,927.90
	GOV OF POLAND	420,000.00	442,048.90
	GOV OF POLAND	570,000.00	599,326.65
	GOV OF POLAND	570,000.00	571,043.84
	GOV OF POLAND	510,000.00	557,461.26
	GOV OF POLAND	1,110,000.00	1,188,810.00
	GOV OF POLAND	300,000.00	286,020.00
	GOV OF POLAND	450,000.00	483,607.21
	GOV OF POLAND	580,000.00	636,057.00
	GOV OF POLAND	80,000.00	105,712.00
	GOV OF POLAND	850,000.00	936,870.00
	GOV OF POLAND	550,000.00	536,222.50
	ポーランドズロチ 小計	7,700,000.00	8,138,061.85 (228,009,775)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	410,000.00	421,493.06
	GOV OF AUSTRALIA	340,000.00	370,907.59
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	235,954.88
	GOV OF AUSTRALIA	610,000.00	611,153.55
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	288,073.97
	GOV OF AUSTRALIA	360,000.00	357,691.71
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	446,486.51
	GOV OF AUSTRALIA	540,000.00	539,108.00
	GOV OF AUSTRALIA	130,000.00	160,122.58
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	349,189.82
	GOV OF AUSTRALIA	350,000.00	384,935.98
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	352,986.24
	GOV OF AUSTRALIA	400,000.00	471,974.80
	GOV OF AUSTRALIA	330,000.00	378,731.49
	GOV OF AUSTRALIA	470,000.00	531,484.88
	GOV OF AUSTRALIA	570,000.00	569,426.40
	GOV OF AUSTRALIA	380,000.00	396,208.73
	GOV OF AUSTRALIA	520,000.00	516,014.14
	GOV OF AUSTRALIA	310,000.00	314,263.08

	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	276,629.65
	GOV OF AUSTRALIA	180,000.00	246,069.16
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	259,179.25
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	289,393.86
	GOV OF AUSTRALIA	170,000.00	212,262.13
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	256,254.60
	GOV OF AUSTRALIA	220,000.00	268,979.82
	GOV OF AUSTRALIA	260,000.00	248,450.07
	オーストラリアドル 小計	8,950,000.00	9,753,425.95 (766,619,279)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	144,018.00
	GOV OF SINGAPORE	150,000.00	153,030.75
	GOV OF SINGAPORE	110,000.00	114,895.00
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	51,935.00
	GOV OF SINGAPORE	140,000.00	150,696.00
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	96,021.00
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	79,424.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	106,252.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	136,524.00
	GOV OF SINGAPORE	190,000.00	208,924.00
	GOV OF SINGAPORE	30,000.00	33,759.00
	GOV OF SINGAPORE	160,000.00	181,088.00
	GOV OF SINGAPORE	60,000.00	61,406.61
	GOV OF SINGAPORE	90,000.00	107,955.00
	GOV OF SINGAPORE	130,000.00	140,116.60
	GOV OF SINGAPORE	50,000.00	54,816.25
	GOV OF SINGAPORE	80,000.00	92,480.00
	GOV OF SINGAPORE	100,000.00	117,000.00
	GOV OF SINGAPORE	120,000.00	121,732.80
	シンガポールドル 小計	1,990,000.00	2,152,074.01 (173,414,123)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	142,123.64
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	153,158.46
	GOV OF MALAYSIA	320,000.00	327,744.80
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	144,152.42
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	124,113.50

	GOV OF MALAYSIA	260,000.00	267,978.17
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	283,825.48
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	104,992.06
	GOV OF MALAYSIA	100,000.00	104,643.10
	GOV OF MALAYSIA	520,000.00	547,607.36
	GOV OF MALAYSIA	190,000.00	204,283.83
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	137,261.94
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	127,157.41
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	278,136.09
	GOV OF MALAYSIA	780,000.00	822,733.70
	GOV OF MALAYSIA	80,000.00	83,263.56
	GOV OF MALAYSIA	350,000.00	367,516.94
	GOV OF MALAYSIA	250,000.00	271,573.05
	GOV OF MALAYSIA	170,000.00	161,418.07
	GOV OF MALAYSIA	210,000.00	224,160.23
	GOV OF MALAYSIA	130,000.00	131,736.16
	GOV OF MALAYSIA	280,000.00	302,556.82
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	218,841.92
	GOV OF MALAYSIA	220,000.00	229,904.57
	GOV OF MALAYSIA	330,000.00	359,773.09
	GOV OF MALAYSIA	120,000.00	131,769.03
	GOV OF MALAYSIA	270,000.00	257,098.36
	GOV OF MALAYSIA	140,000.00	152,175.68
	GOV OF MALAYSIA	180,000.00	190,698.01
	GOV OF MALAYSIA	150,000.00	161,219.16
	GOV OF MALAYSIA	240,000.00	230,720.78
	マレーシアリングット 小計	6,950,000.00	7,244,337.39 (187,857,983)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	380,000.00	382,888.00
	GOV OF ISRAEL	190,000.00	194,731.00
	GOV OF ISRAEL	330,000.00	330,528.00
	GOV OF ISRAEL	520,000.00	542,230.00
	GOV OF ISRAEL	390,000.00	432,315.00
	GOV OF ISRAEL	430,000.00	435,310.50
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	301,560.00

	GOV OF ISRAEL	100,000.00	101,470.00	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	351,910.00	
	GOV OF ISRAEL	310,000.00	338,923.00	
	GOV OF ISRAEL	280,000.00	315,420.00	
	GOV OF ISRAEL	490,000.00	493,405.50	
	GOV OF ISRAEL	260,000.00	251,784.00	
	GOV OF ISRAEL	340,000.00	556,546.00	
	GOV OF ISRAEL	410,000.00	541,733.00	
	イスラエルシェケル 小計	4,970,000.00	5,570,754.00 (188,441,338)	
	合計		40,521,077,654 (40,521,077,654)	

(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 229銘柄	100.0%	45.4%
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 342銘柄	100.0%	40.6%
英ポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	6.4%
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 9銘柄	100.0%	0.5%
ポーランドズロチ	国債証券 15銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.9%
シンガポールドル	国債証券 19銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 31銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

(注)時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
2021年 8月20日現在	
資産の部	
流動資産	
預金	6,286,952
コール・ローン	31,762,825
投資信託受益証券	6,327,182,701
派生商品評価勘定	25,552
流動資産合計	6,365,258,030
資産合計	6,365,258,030
負債の部	
流動負債	
未払利息	86
その他未払費用	155
流動負債合計	241
負債合計	241
純資産の部	
元本等	
元本	5,877,873,742
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	487,384,047
元本等合計	6,365,257,789
純資産合計	6,365,257,789
負債純資産合計	6,365,258,030

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	4,968,582,326円
期中追加設定元本額	3,978,104,833円
期中一部解約元本額	3,068,813,417円
期末元本額	5,877,873,742円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	909,721,197円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	693,663,725円
りそなラップ型ファンド(成長型)	383,033,713円
DCりそな グローバルバランス	16,020,379円
つみたてバランスファンド	729,337,587円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	219,397,130円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	119,754,751円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	75,809,893円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	20,814,725円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	13,610,096円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	7,236,253円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	10,118,262円
リスクコントロール・オープン	3,374,379円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	110,183,036円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	44,814,809円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,168,232,931円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,696,505円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	102,357,256円
Smart-i 8資産バランス 成長型	118,009,824円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	186,588,976円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	348,555,870円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	206,149,447円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	150,077,410円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	170,873,103円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	29,391,678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)	996,891円

りそなV I 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V I 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V I 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	5,877,873,742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	1.0829円
(10,000口当たり純資産額)	(10,829円)

（注） は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20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る場合、当該価額が異なることもあります。

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		399,685,585
合計		399,685,585

(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 8月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	23,709,888	-	23,735,440	25,552
	米ドル	23,709,888	-	23,735,440	25,552
	合計	23,709,888	-	23,735,440	25,552

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	748,647	40,426,938.00	
		VANECK VECTORS J.P. MORGAN E	564,532	17,150,482.16	
		米ドル 小計	1,313,179	57,577,420.16 (6,327,182,701)	
	合計			6,327,182,701 (6,327,182,701)	

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内株式E S Gマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	90,931,676
株式	1,931,700,230
投資証券	38,383,600
未収配当金	2,070,487
前払金	1,534,250
差入委託証拠金	3,978,000
流動資産合計	2,068,598,243
資産合計	2,068,598,243
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,115,060
未払金	128,100
未払解約金	8,100,000
未払利息	246
その他未払費用	522
流動負債合計	10,343,928
負債合計	10,343,928
純資産の部	
元本等	
元本	1,729,267,860
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	328,986,455
元本等合計	2,058,254,315
純資産合計	2,058,254,315
負債純資産合計	2,068,598,243

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	610,917,583円
期中追加設定元本額	1,416,230,887円
期中一部解約元本額	297,880,610円
期末元本額	1,729,267,860円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	302,435,396円
Smart-i 国内株式ESGインデックス	399,861,090円
国内株式ESGインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,026,971,374円
2. 計算日における受益権の総数	1,729,267,860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	1.1902円
(10,000口当たり純資産額)	(11,902円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20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などの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式、投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式	39,875,903	
投資証券	2,450,169	
合計	42,326,072	

(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 8月20日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	88,664,060	-	86,549,000	2,115,060
合計		88,664,060	-	86,549,000	2,115,060

（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	
マルハニチロ	300	2,364.00	709,200	
I N P E X	7,500	728.00	5,460,000	
コムシスホールディングス	800	2,963.00	2,370,400	
大成建設	1,400	3,565.00	4,991,000	
大林組	4,800	914.00	4,387,200	
清水建設	4,100	824.00	3,378,400	
鹿島建設	3,300	1,409.00	4,649,700	
戸田建設	1,700	780.00	1,326,000	
住友林業	900	1,947.00	1,752,300	
大和ハウス工業	4,200	3,314.00	13,918,800	
積水ハウス	4,500	2,132.50	9,596,250	
協和エクシオ	700	2,665.00	1,865,500	
高砂熱学工業	300	2,017.00	605,100	
サッポロホールディングス	500	2,325.00	1,162,500	
アサヒグループホールディングス	3,300	4,925.00	16,252,500	
キリンホールディングス	6,000	1,982.00	11,892,000	
サントリー食品インターナショナル	1,000	4,300.00	4,300,000	
不二製油グループ本社	400	2,449.00	979,600	
キッコーマン	1,100	7,270.00	7,997,000	
味の素	3,400	3,102.00	10,546,800	
キューピー	800	2,597.00	2,077,600	
ハウス食品グループ本社	400	3,430.00	1,372,000	
ニチレイ	800	2,614.00	2,091,200	
日清食品ホールディングス	500	8,470.00	4,235,000	
帝人	1,300	1,588.00	2,064,400	
東レ	10,200	714.50	7,287,900	
日本製紙	700	1,265.00	885,500	
レンゴー	1,300	904.00	1,175,200	
クラレ	2,200	1,014.00	2,230,800	
旭化成	9,200	1,121.50	10,317,800	
昭和電工	900	2,737.00	2,463,300	
住友化学	10,900	529.00	5,766,100	
信越化学工業	2,600	17,590.00	45,734,000	
カネカ	300	4,175.00	1,252,500	

三井化学	1,400	3,495.00	4,893,000
東京応化工業	200	6,560.00	1,312,000
三菱ケミカルホールディングス	9,400	898.80	8,448,720
ダイセル	1,900	852.00	1,618,800
積水化学工業	2,800	1,819.00	5,093,200
宇部興産	700	2,170.00	1,519,000
日本化薬	1,000	1,189.00	1,189,000
花王	3,500	6,719.00	23,516,500
関西ペイント	1,300	2,785.00	3,620,500
D I C	600	3,025.00	1,815,000
東洋インキ S C ホールディングス	300	1,991.00	597,300
富士フイルムホールディングス	2,600	8,717.00	22,664,200
資生堂	2,900	6,756.00	19,592,400
日東電工	1,100	8,230.00	9,053,000
ニフコ	600	3,270.00	1,962,000
ユニ・チャーム	3,000	4,820.00	14,460,000
協和キリン	2,000	3,590.00	7,180,000
アステラス製薬	13,700	1,845.00	25,276,500
大日本住友製薬	1,300	1,898.00	2,467,400
塩野義製薬	1,900	6,803.00	12,925,700
中外製薬	4,900	4,284.00	20,991,600
エーザイ	1,700	9,101.00	15,471,700
小野薬品工業	2,700	2,594.50	7,005,150
持田製薬	200	3,545.00	709,000
参天製薬	2,600	1,589.00	4,131,400
キッセイ薬品工業	200	2,375.00	475,000
第一三共	12,500	2,516.00	31,450,000
大塚ホールディングス	2,900	4,726.00	13,705,400
E N E O S ホールディングス	22,500	416.30	9,366,750
T O T O	1,000	5,930.00	5,930,000
日本碍子	1,900	1,721.00	3,269,900
日本特殊陶業	1,100	1,597.00	1,756,700
ニチアス	400	2,722.00	1,088,800
大同特殊鋼	200	4,740.00	948,000
日立金属	1,600	2,122.00	3,395,200
日本軽金属ホールディングス	400	1,823.00	729,200

三菱マテリアル	800	2,101.00	1,680,800
住友金属鉱山	1,800	3,960.00	7,128,000
三浦工業	600	4,805.00	2,883,000
タクマ	500	1,655.00	827,500
ナブテスコ	800	4,270.00	3,416,000
サトーホールディングス	200	2,622.00	524,400
小松製作所	6,400	2,599.50	16,636,800
日立建機	800	2,980.00	2,384,000
クボタ	7,500	2,131.50	15,986,250
荏原製作所	700	5,310.00	3,717,000
ダイキン工業	1,800	25,540.00	45,972,000
栗田工業	700	4,810.00	3,367,000
ダイフク	700	9,250.00	6,475,000
グローリー	400	2,225.00	890,000
セガサミーホールディングス	1,300	1,326.00	1,723,800
ホシザキ	400	9,820.00	3,928,000
NTN	2,900	240.00	696,000
日立造船	1,200	780.00	936,000
三菱重工業	2,400	2,812.00	6,748,800
日清紡ホールディングス	1,100	883.00	971,300
イビデン	800	5,370.00	4,296,000
コニカミノルタ	3,300	527.00	1,739,100
三菱電機	13,400	1,442.50	19,329,500
安川電機	1,800	5,150.00	9,270,000
東芝テック	200	4,400.00	880,000
オムロン	1,400	9,680.00	13,552,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	500	2,446.00	1,223,000
日本電気	1,800	5,510.00	9,918,000
富士通	1,400	18,745.00	26,243,000
アルバック	300	5,640.00	1,692,000
パナソニック	16,200	1,224.00	19,828,800
アンリツ	1,000	1,796.00	1,796,000
ソニーグループ	9,300	10,620.00	98,766,000
T D K	1,000	11,430.00	11,430,000
ヒロセ電機	200	16,930.00	3,386,000
日本航空電子工業	300	1,583.00	474,900

横河電機	1,700	1,641.00	2,789,700	
アズビル	900	4,370.00	3,933,000	
日本光電工業	600	3,585.00	2,151,000	
キーエンス	1,400	61,880.00	86,632,000	
シスメックス	1,200	11,750.00	14,100,000	
スタンレー電気	1,000	2,630.00	2,630,000	
ウシオ電機	700	1,878.00	1,314,600	
村田製作所	4,200	8,784.00	36,892,800	
東京エレクトロン	1,100	42,940.00	47,234,000	
デンソー	3,200	6,721.00	21,507,200	
川崎重工業	1,000	2,276.00	2,276,000	
トヨタ自動車	15,600	8,915.00	139,074,000	
日野自動車	2,100	856.00	1,797,600	
ヤマハ発動機	2,100	2,649.00	5,562,900	
島津製作所	1,700	4,760.00	8,092,000	
ニコン	2,200	1,070.00	2,354,000	
シチズン時計	2,000	456.00	912,000	
大日本印刷	1,700	2,528.00	4,297,600	
アシックス	1,100	2,479.00	2,726,900	
ヤマハ	1,000	5,930.00	5,930,000	
リンテック	300	2,378.00	713,400	
任天堂	800	52,410.00	41,928,000	
コクヨ	600	1,893.00	1,135,800	
中部電力	4,700	1,343.50	6,314,450	
中国電力	2,100	1,028.00	2,158,800	
九州電力	3,000	844.00	2,532,000	
レノバ	300	4,380.00	1,314,000	
東京瓦斯	2,800	2,138.00	5,986,400	
大阪瓦斯	2,800	2,097.00	5,871,600	
東邦瓦斯	500	5,380.00	2,690,000	
東武鉄道	1,400	2,825.00	3,955,000	
相鉄ホールディングス	500	2,176.00	1,088,000	
東急	3,700	1,450.00	5,365,000	
小田急電鉄	2,200	2,548.00	5,605,600	
京王電鉄	800	5,930.00	4,744,000	
東日本旅客鉄道	2,200	7,147.00	15,723,400	

西日本旅客鉄道	1,200	5,723.00	6,867,600	
西武ホールディングス	1,700	1,191.00	2,024,700	
西日本鉄道	400	2,753.00	1,101,200	
近鉄グループホールディングス	1,300	3,665.00	4,764,500	
阪急阪神ホールディングス	1,700	3,265.00	5,550,500	
南海電気鉄道	700	2,323.00	1,626,100	
名古屋鉄道	1,400	1,867.00	2,613,800	
日本通運	600	6,980.00	4,188,000	
山九	400	4,825.00	1,930,000	
センコーグループホールディングス	800	1,005.00	804,000	
福山通運	200	4,355.00	871,000	
日立物流	200	4,430.00	886,000	
九州旅客鉄道	1,000	2,412.00	2,412,000	
S Gホールディングス	2,400	3,035.00	7,284,000	
日本郵船	1,200	7,290.00	8,748,000	
野村総合研究所	2,600	3,830.00	9,958,000	
メルカリ	800	5,160.00	4,128,000	
Zホールディングス	19,500	650.20	12,678,900	
ネットワンシステムズ	600	3,485.00	2,091,000	
日本ユニシス	500	2,891.00	1,445,500	
日本電信電話	9,400	2,844.00	26,733,600	
K D D I	11,800	3,365.00	39,707,000	
ソフトバンク	21,100	1,461.00	30,827,100	
カブコン	1,300	2,836.00	3,686,800	
S C S K	400	6,670.00	2,668,000	
アルフレッサ ホールディングス	1,400	1,722.00	2,410,800	
T O K A Iホールディングス	700	897.00	627,900	
シップヘルスケアホールディングス	600	2,645.00	1,587,000	
メディバルホールディングス	1,300	2,132.00	2,771,600	
アズワン	100	15,410.00	1,541,000	
日本ライフライン	400	1,334.00	533,600	
伊藤忠商事	8,700	3,235.00	28,144,500	
キャノンマーケティングジャパン	300	2,468.00	740,400	
サンゲツ	300	1,556.00	466,800	
スズケン	500	3,290.00	1,645,000	
ローソン	400	5,800.00	2,320,000	

D C Mホールディングス	900	1,081.00	972,900	
ココカラファイン	100	8,350.00	835,000	
丸井グループ	1,400	1,855.00	2,597,000	
イオン	4,800	3,022.00	14,505,600	
ケースホールディングス	1,300	1,111.00	1,444,300	
アインホールディングス	200	7,210.00	1,442,000	
ヤマダホールディングス	5,000	469.00	2,345,000	
ファーストリテイリング	400	72,050.00	28,820,000	
りそなホールディングス	15,800	419.20	6,623,360	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,500	3,554.00	8,885,000	
三井住友フィナンシャルグループ	9,600	3,730.00	35,808,000	
千葉銀行	3,900	674.00	2,628,600	
静岡銀行	3,300	857.00	2,828,100	
山口フィナンシャルグループ	1,500	635.00	952,500	
野村ホールディングス	22,500	519.80	11,695,500	
S O M P Oホールディングス	2,300	4,732.00	10,883,600	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	3,300	3,503.00	11,559,900	
第一生命ホールディングス	7,500	2,133.50	16,001,250	
東京海上ホールディングス	4,600	5,302.00	24,389,200	
T & Dホールディングス	3,900	1,315.00	5,128,500	
芙蓉総合リース	100	7,120.00	712,000	
東京センチュリー	300	5,630.00	1,689,000	
イオンフィナンシャルサービス	800	1,244.00	995,200	
オリエントコーポレーション	3,800	142.00	539,600	
オリックス	9,000	1,967.50	17,707,500	
日本取引所グループ	3,700	2,589.00	9,579,300	
ヒューリック	2,000	1,248.00	2,496,000	
野村不動産ホールディングス	900	2,772.00	2,494,800	
東急不動産ホールディングス	4,500	583.00	2,623,500	
三井不動産	6,700	2,407.00	16,126,900	
三菱地所	8,700	1,678.50	14,602,950	
総合警備保障	500	5,210.00	2,605,000	
H . U . グループホールディングス	400	3,175.00	1,270,000	
オリエンタルランド	1,500	15,645.00	23,467,500	
ダスキン	300	2,604.00	781,200	

テクノプロ・ホールディングス	800	2,804.00	2,243,200	
リクルートホールディングス	10,000	6,076.00	60,760,000	
乃村工藝社	600	851.00	510,600	
セコム	1,500	8,390.00	12,585,000	
メイテック	200	6,220.00	1,244,000	
ベネッセホールディングス	500	2,335.00	1,167,500	
合 計	611,900		1,931,700,230	

(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	産業ファンド投資法人	14	3,022,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	5	1,740,000	
	日本プロロジスリート投資法人	15	5,760,000	
	ヒューリックリート投資法人	9	1,706,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	31	5,350,600	
	日本ビルファンド投資法人	11	7,788,000	
	日本都市ファンド投資法人	51	5,431,500	
	オリックス不動産投資法人	19	3,822,800	
	日本プライムリアルティ投資法人	6	2,463,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	9	1,298,700	
合 計		170	38,383,600	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国株式E S Gマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	275,331,650
コール・ローン	14,915,550
株式	1,649,346,744
投資証券	40,364,900
派生商品評価勘定	8,494,311
未収配当金	2,034,209
差入委託証拠金	94,213,967
流動資産合計	2,084,701,331
資産合計	
2,084,701,331	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	468,251
未払利息	40
その他未払費用	82
流動負債合計	468,373
負債合計	
468,373	
純資産の部	
元本等	
元本	1,471,121,149
剰余金	
剰余金又は欠損金()	613,111,809
元本等合計	2,084,232,958
純資産合計	
2,084,232,958	
負債純資産合計	
2,084,701,331	

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 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	211,282,109円
期中追加設定元本額	1,570,389,076円
期中一部解約元本額	310,550,036円
期末元本額	1,471,121,149円
期末元本の内訳	
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	935,297,195円
Smart-i 先進国株式ESGインデックス	535,823,954円
2. 計算日における受益権の総数	1,471,121,149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	1.4168円
(10,000口当たり純資産額)	(14,168円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20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 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		251,531,750
投資証券		6,321,115
合計		257,852,865

(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 8月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	372,061,341	-	380,099,635	8,038,294
合計		372,061,341	-	380,099,635	8,038,294

(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 8月20日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	12,612,922	-	12,601,291	11,631
	米ドル	8,688,364	-	8,681,017	7,347
	カナダドル	173,483	-	171,472	2,011
	ユーロ	3,209,553	-	3,209,578	25

	英ポンド	302,092	-	299,792	2,300
	スイスフラン	239,430	-	239,432	2
	売建	10,267,726	-	10,268,329	603
	米ドル	9,120,040	-	9,120,562	522
	カナダドル	257,190	-	257,208	18
	ユーロ	385,119	-	385,151	32
	英ポンド	149,888	-	149,896	8
	スイスフラン	119,695	-	119,716	21
	オーストラリアドル	235,794	-	235,796	2
	合計	22,880,648	-	22,869,620	12,234

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	371	20.19	7,490.49	
	CHENIERE ENERGY INC	123	83.04	10,213.92	
	MARATHON PETROLEUM CORP	339	54.23	18,383.97	
	ONEOK INC	238	49.27	11,726.26	
	PHILLIPS 66	228	66.27	15,109.56	
	SCHLUMBERGER LTD	802	26.44	21,204.88	

VALERO ENERGY CORP	237	60.24	14,276.88
WILLIAMS COS INC	705	23.89	16,842.45
AMCOR PLC	909	12.40	11,271.60
BALL CORP	175	92.50	16,187.50
DUPONT DE NEMOURS INC	283	72.92	20,636.36
ECOLAB INC	145	220.50	31,972.50
INTERNATIONAL PAPER CO	215	58.16	12,504.40
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	142	149.40	21,214.80
LINDE PLC	292	311.17	90,861.64
LYONDELLBASELL INDU-CL A	153	97.27	14,882.31
MOSAIC CO/THE	214	29.57	6,327.98
NEWMONT CORP	451	56.52	25,490.52
PPG INDUSTRIES INC	126	161.14	20,303.64
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	143	302.64	43,277.52
STEEL DYNAMICS INC	125	67.16	8,395.00
3M CO	323	195.36	63,101.28
ALLEGION PLC	53	140.22	7,431.66
CATERPILLAR INC	304	204.45	62,152.80
CUMMINS INC	78	231.50	18,057.00
DEERE & CO	166	358.98	59,590.68
DOVER CORP	82	172.42	14,138.44
EATON CORP PLC	224	166.94	37,394.56
FASTENAL CO	326	55.06	17,949.56
FORTIVE CORP	184	73.46	13,516.64
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	81	97.39	7,888.59
GENERAC HOLDINGS INC	36	391.85	14,106.60
HOWMET AEROSPACE INC	228	31.75	7,239.00
IDEX CORP	40	220.67	8,826.80
ILLINOIS TOOL WORKS	178	230.20	40,975.60
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	381	73.03	27,824.43
LENNOX INTERNATIONAL INC	20	330.20	6,604.00
MASCO CORP	149	59.99	8,938.51
OWENS CORNING	62	91.59	5,678.58
PACCAR INC	184	80.37	14,788.08
PENTAIR PLC	98	78.29	7,672.42

ROCKWELL AUTOMATION INC	62	314.40	19,492.80
ROPER TECHNOLOGIES INC	55	477.09	26,239.95
SNAP-ON INC	32	216.38	6,924.16
STANLEY BLACK & DECKER INC	86	189.68	16,312.48
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	23	446.03	10,258.69
TRANE TECHNOLOGIES PLC	127	193.95	24,631.65
UNITED RENTALS INC	37	331.44	12,263.28
WW GRAINGER INC	26	429.66	11,171.16
XYLEM INC	104	130.25	13,546.00
COPART INC	119	137.59	16,373.21
IHS MARKIT LTD	206	117.19	24,141.14
ROBERT HALF INTL INC	71	101.63	7,215.73
WASTE MANAGEMENT INC	225	151.62	34,114.50
AMERCO	3	640.00	1,920.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	75	87.77	6,582.75
CSX CORP	1,287	33.59	43,230.33
DELTA AIR LINES INC	54	37.93	2,048.22
EXPEDITORS INTL WASH INC	99	122.13	12,090.87
KANSAS CITY SOUTHERN	52	291.07	15,135.64
NORFOLK SOUTHERN CORP	142	262.20	37,232.40
UNION PACIFIC CORP	375	223.77	83,913.75
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	402	194.06	78,012.12
APTIV PLC	140	152.92	21,408.80
BORGWARNER INC	137	42.52	5,825.24
TESLA INC	428	673.47	288,245.16
GARMIN LTD	89	166.80	14,845.20
HASBRO INC	78	94.78	7,392.84
LULULEMON ATHLETICA INC	66	396.49	26,168.34
MOHAWK INDUSTRIES INC	36	196.95	7,090.20
NEWELL RUBBERMAID INC	232	24.09	5,588.88
NIKE INC -CL B	710	165.59	117,568.90
NVR INC	2	5,072.27	10,144.54
VF CORP	192	75.93	14,578.56
BOOKING HOLDINGS INC	23	2,075.86	47,744.78
DARDEN RESTAURANTS INC	68	136.76	9,299.68

DOMINO'S PIZZA INC	18	518.32	9,329.76
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	146	119.23	17,407.58
MCDONALD'S CORP	417	237.23	98,924.91
STARBUCKS CORP	660	114.32	75,451.20
VAIL RESORTS INC	23	285.28	6,561.44
ACTIVISION BLIZZARD INC	434	83.17	36,095.78
ALPHABET INC-CL A	167	2,713.60	453,171.20
ALPHABET INC-CL C	164	2,738.27	449,076.28
CABLE ONE INC	3	2,019.90	6,059.70
DISCOVERY INC - A	55	27.74	1,525.70
DISCOVERY INC-C	111	26.45	2,935.95
ELECTRONIC ARTS INC	154	140.60	21,652.40
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	228	36.10	8,230.80
OMNICOM GROUP	123	71.12	8,747.76
SIRIUS XM HOLDINGS INC	609	6.17	3,757.53
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	66	162.27	10,709.82
WALT DISNEY CO/THE	1,010	173.25	174,982.50
ADVANCE AUTO PARTS INC	39	208.37	8,126.43
BEST BUY CO INC	134	109.76	14,707.84
BURLINGTON STORES INC	35	348.89	12,211.15
CARMAX INC	95	124.24	11,802.80
EBAY INC	363	72.83	26,437.29
GENUINE PARTS CO	81	122.50	9,922.50
HOME DEPOT INC	600	322.90	193,740.00
LKQ CORP	172	50.83	8,742.76
LOWE'S COS INC	409	202.59	82,859.31
MERCADOLIBRE INC	25	1,759.96	43,999.00
POOL CORP	24	484.37	11,624.88
TARGET CORP	281	245.41	68,960.21
TJX COMPANIES INC	675	73.59	49,673.25
TRACTOR SUPPLY COMPANY	60	194.94	11,696.40
KROGER CO	424	45.93	19,474.32
BUNGE LTD	84	74.47	6,255.48
CAMPBELL SOUP CO	114	43.20	4,924.80
COCA-COLA CO/THE	2,278	56.86	129,527.08

COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	114	57.34	6,536.76
CONAGRA BRANDS INC	278	33.54	9,324.12
GENERAL MILLS INC	327	60.13	19,662.51
HORMEL FOODS CORP	132	46.44	6,130.08
JM SMUCKER CO/THE	63	132.38	8,339.94
KELLOGG CO	147	66.23	9,735.81
KEURIG DR PEPPER INC	398	34.89	13,886.22
LAMB WESTON HOLDINGS INC	85	65.73	5,587.05
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	141	87.48	12,334.68
PEPSICO INC	768	158.91	122,042.88
CLOROX COMPANY	72	171.10	12,319.20
COLGATE-PALMOLIVE CO	451	78.97	35,615.47
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	129	327.40	42,234.60
KIMBERLY-CLARK CORP	177	138.91	24,587.07
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,370	144.99	198,636.30
ABIOMED INC	25	333.35	8,333.75
ALIGN TECHNOLOGY INC	39	679.86	26,514.54
AMERISOURCEBERGEN CORP	79	119.26	9,421.54
BAXTER INTERNATIONAL INC	286	75.02	21,455.72
CARDINAL HEALTH INC	151	51.32	7,749.32
CENTENE CORP	307	63.91	19,620.37
CERNER CORP	176	79.62	14,013.12
CIGNA CORP	197	206.18	40,617.46
DAVITA INC	27	132.15	3,568.05
DENTSPLY SIRONA INC	128	59.88	7,664.64
DEXCOM INC	51	505.55	25,783.05
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	352	117.95	41,518.40
HCA HEALTHCARE INC	153	246.50	37,714.50
HOLOGIC INC	151	76.56	11,560.56
HUMANA INC	69	413.69	28,544.61
IDEXX LABORATORIES INC	45	681.71	30,676.95
INSULET CORP	38	294.81	11,202.78
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	56	302.77	16,955.12
NOVOCURE LTD	54	128.86	6,958.44
QUEST DIAGNOSTICS INC	78	151.60	11,824.80

RESMED INC	77	283.03	21,793.31
STERIS PLC	50	214.89	10,744.50
TELADOC HEALTH INC	78	135.60	10,576.80
TELEFLEX INC	27	375.84	10,147.68
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	42	446.96	18,772.32
AGILENT TECHNOLOGIES INC	161	167.67	26,994.87
AMGEN INC	322	224.39	72,253.58
BIO-TECHNE CORP	22	475.88	10,469.36
BIOGEN INC	80	338.62	27,089.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	97	74.77	7,252.69
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	1,248	68.51	85,500.48
CATALENT INC	97	120.90	11,727.30
ELI LILLY & CO	454	270.40	122,761.60
GILEAD SCIENCES INC	702	71.67	50,312.34
HORIZON THERAPEUTICS PLC	121	103.23	12,490.83
ILLUMINA INC	82	470.36	38,569.52
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	35	131.51	4,602.85
JOHNSON & JOHNSON	1,461	178.57	260,890.77
MERCK & CO. INC.	1,409	78.46	110,550.14
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	13	1,541.60	20,040.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	219	551.88	120,861.72
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	146	195.04	28,475.84
WATERS CORP	34	404.86	13,765.24
ZOETIS INC	265	206.44	54,706.60
CITIZENS FINANCIAL GROUP	221	41.88	9,255.48
FIRST REPUBLIC BANK/CA	100	194.46	19,446.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	819	14.62	11,973.78
KEYCORP	498	19.74	9,830.52
M & T BANK CORP	66	134.66	8,887.56
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	238	184.34	43,872.92
REGIONS FINANCIAL CORP	496	19.67	9,756.32
SVB FINANCIAL GROUP	26	542.65	14,108.90
TRUIST FINANCIAL CORP	757	55.04	41,665.28
US BANCORP	802	55.34	44,382.68
ALLY FINANCIAL INC	212	51.21	10,856.52

AMERICAN EXPRESS CO	384	159.03	61,067.52
AMERIPRISE FINANCIAL INC	67	260.36	17,444.12
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	475	52.77	25,065.75
BLACKROCK INC	85	903.78	76,821.30
CARLYLE GROUP INC/THE	47	46.27	2,174.69
CBOE GLOBAL MARKETS INC	65	127.62	8,295.30
CME GROUP INC	202	198.08	40,012.16
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	165	125.81	20,758.65
EQUITABLE HOLDINGS INC	236	29.67	7,002.12
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	23	365.16	8,398.68
FRANKLIN RESOURCES INC	185	30.65	5,670.25
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	317	116.38	36,892.46
INVESCO LTD	239	23.42	5,597.38
MARKETAXESS HOLDINGS INC	22	472.27	10,389.94
MOODY'S CORP	89	374.54	33,334.06
MORGAN STANLEY	790	99.73	78,786.70
NASDAQ INC	62	188.02	11,657.24
NORTHERN TRUST CORP	101	113.63	11,476.63
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	71	133.16	9,454.36
S&P GLOBAL INC	135	433.94	58,581.90
SCHWAB (CHARLES) CORP	787	71.06	55,924.22
STATE STREET CORP	202	85.50	17,271.00
T ROWE PRICE GROUP INC	120	212.47	25,496.40
VOYA FINANCIAL INC	42	64.13	2,693.46
AFLAC INC	373	55.92	20,858.16
ALLSTATE CORP	172	134.03	23,053.16
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	45	134.36	6,046.20
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	455	52.96	24,096.80
AON PLC	128	276.07	35,336.96
ARCH CAPITAL GROUP LTD	230	41.66	9,581.80
ARTHUR J GALLAGHER & CO	111	142.00	15,762.00
ASSURANT INC	35	163.54	5,723.90
CHUBB LTD	253	185.44	46,916.32
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	9	173.06	1,557.54
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	183	65.93	12,065.19

LINCOLN NATIONAL CORP	110	65.40	7,194.00
LOEWS CORP	136	54.65	7,432.40
MARSH & MCLENNAN COS	286	153.92	44,021.12
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	154	64.59	9,946.86
PROGRESSIVE CORP	331	96.20	31,842.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	210	103.79	21,795.90
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	41	118.07	4,840.87
TRAVELERS COS INC/THE	134	159.48	21,370.32
WILLIS TOWERS WATSON PLC	69	214.32	14,788.08
CBRE GROUP INC - A	190	91.76	17,434.40
ACCENTURE PLC-CL A	353	328.25	115,872.25
ADOBE INC	266	637.66	169,617.56
ANSYS INC	49	357.72	17,528.28
AUTODESK INC	123	330.35	40,633.05
AUTOMATIC DATA PROCESSING	239	211.12	50,457.68
CADENCE DESIGN SYS INC	146	153.27	22,377.42
CITRIX SYSTEMS INC	62	102.48	6,353.76
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	19	155.39	2,952.41
INTL BUSINESS MACHINES CORP	498	138.02	68,733.96
INTUIT INC	153	543.44	83,146.32
MASTERCARD INC-CLASS A	493	357.31	176,153.83
MICROSOFT CORP	3,980	296.77	1,181,144.60
OKTA INC	68	230.91	15,701.88
SALESFORCE.COM INC	540	253.07	136,657.80
VISA INC-CLASS A SHARES	943	231.57	218,370.51
VMWARE INC-CLASS A	48	153.07	7,347.36
WESTERN UNION CO	239	21.67	5,179.13
WORKDAY INC-CLASS A	101	231.90	23,421.90
CISCO SYSTEMS INC	2,351	57.27	134,641.77
COGNEX CORP	99	83.56	8,272.44
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	710	14.38	10,209.80
HP INC	703	27.78	19,529.34
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	106	166.69	17,669.14
MOTOROLA SOLUTIONS INC	96	237.41	22,791.36
TRIMBLE INC	131	88.93	11,649.83

	ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	30	562.72	16,881.60
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	2,309	55.37	127,849.33
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	98	181.77	17,813.46
	ATMOS ENERGY CORP	61	98.64	6,017.04
	CENTERPOINT ENERGY INC	265	25.92	6,868.80
	CONSOLIDATED EDISON INC	200	76.69	15,338.00
	EDISON INTERNATIONAL	224	58.20	13,036.80
	ESSENTIAL UTILITIES INC	117	48.80	5,709.60
	EVERSOURCE ENERGY	186	91.18	16,959.48
	SEMPRA ENERGY	181	131.97	23,886.57
	UGI CORP	108	46.23	4,992.84
	APPLIED MATERIALS INC	510	129.20	65,892.00
	INTEL CORP	2,256	52.44	118,304.64
	LAM RESEARCH CORP	79	577.14	45,594.06
	NVIDIA CORP	1,376	197.98	272,420.48
	TEXAS INSTRUMENTS INC	511	185.04	94,555.44
	米ドル 小計	73,941		10,775,028.27 (1,184,067,856)
カナダドル	CAMECO CORP	228	20.04	4,569.12
	ENBRIDGE INC	1,143	47.87	54,715.41
	INTER PIPELINE LTD	247	19.97	4,932.59
	KEYERA CORP	73	29.48	2,152.04
	PARKLAND CORP	85	36.25	3,081.25
	PEMBINA PIPELINE CORP	327	38.53	12,599.31
	AGNICO EAGLE MINES LTD	140	71.77	10,047.80
	B2GOLD CORP	349	4.74	1,654.26
	FRANCO-NEVADA CORP	108	183.18	19,783.44
	KINROSS GOLD CORP	745	7.26	5,408.70
	LUNDIN MINING CORP	222	9.70	2,153.40
	NUTRIEN LTD	312	74.48	23,237.76
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	257	54.48	14,001.36
	BALLARD POWER SYSTEMS INC	144	19.28	2,776.32
	CAE INC	166	34.38	5,707.08
	TOROMONT INDUSTRIES LTD	49	108.61	5,321.89
	WSP GLOBAL INC	72	161.81	11,650.32

	RITCHIE BROS AUCTIONEERS	36	78.43	2,823.48	
	THOMSON REUTERS CORP	103	144.69	14,903.07	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	399	136.55	54,483.45	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	156	99.49	15,520.44	
	GILDAN ACTIVEWEAR INC	67	47.52	3,183.84	
	CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	35	192.38	6,733.30	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	486	51.80	25,174.80	
	LOBLAW COMPANIES LTD	108	89.03	9,615.24	
	METRO INC	120	63.77	7,652.40	
	CANOPY GROWTH CORP	77	21.16	1,629.32	
	BANK OF MONTREAL	363	126.79	46,024.77	
	BANK OF NOVA SCOTIA	680	79.61	54,134.80	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	233	146.85	34,216.05	
	NATIONAL BANK OF CANADA	193	97.43	18,803.99	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	722	70.04	50,568.88	
	TMX GROUP LTD	36	138.75	4,995.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	83	176.05	14,612.15	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	1,047	24.81	25,976.07	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	323	66.13	21,359.99	
	FIRSTSERVICE CORP	27	237.23	6,405.21	
	SHOPIFY INC - CLASS A	63	1,881.10	118,509.30	
	ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	207	63.42	13,127.94	
	TELUS CORP	141	28.76	4,055.16	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	395	19.75	7,801.25	
	FORTIS INC	273	58.34	15,926.82	
	HYDRO ONE LTD	169	31.68	5,353.92	
	カナダドル 小計	11,209		767,382.69	(65,795,391)
ユーロ	GALP ENERGIA SGPS SA	366	8.31	3,043.65	
	NESTE OYJ	246	48.49	11,928.54	
	OMV AG	111	45.27	5,024.97	
	REPSOL SA	844	9.28	7,837.38	
	TENARIS SA	169	8.22	1,389.18	
	TOTALENERGIES SE	1,403	36.30	50,935.91	
	VOPAK	24	36.06	865.44	

AIR LIQUIDE SA	265	151.64	40,184.60
AKZO NOBEL	108	102.75	11,097.00
BASF SE	515	65.90	33,938.50
CRH PLC	415	43.54	18,069.10
HEIDELBERGCEMENT AG	91	72.48	6,595.68
KONINKLIJKE DSM NV	92	180.30	16,587.60
LANXESS AG	50	59.26	2,963.00
SOLVAY SA	47	112.45	5,285.15
STORA ENSO OYJ-R SHS	363	16.22	5,887.86
SYMRISE AG	74	123.85	9,164.90
UMICORE	125	57.00	7,125.00
UPM-KYMMENE OYJ	250	34.26	8,565.00
VOESTALPINE AG	41	38.22	1,567.02
ALSTOM	161	36.78	5,921.58
BOUYGUES SA	135	35.12	4,741.20
BRENTAG SE	89	85.30	7,591.70
CNH INDUSTRIAL NV	565	13.69	7,734.85
EIFFAGE	49	84.76	4,153.24
KINGSPAN GROUP PLC	84	93.84	7,882.56
MTU AERO ENGINES AG	29	198.85	5,766.65
SCHNEIDER ELECTRIC SE	301	153.68	46,257.68
WARTSILA OYJ ABP	148	11.74	1,738.26
BUREAU VERITAS SA	186	27.70	5,152.20
RANDSTAD NV	73	60.98	4,451.54
TELEPERFORMANCE	35	365.60	12,796.00
WOLTERS KLUWER	154	96.38	14,842.52
DEUTSCHE POST AG-REG	558	59.66	33,290.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	179	77.40	13,854.60
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	20	67.25	1,345.00
MICHELIN (CGDE)	99	141.65	14,023.35
VALEO SA	150	24.17	3,625.50
ADIDAS AG	107	303.50	32,474.50
ESSILORLUXOTTICA	153	160.04	24,486.12
KERING	41	650.00	26,650.00
PUMA SE	58	106.15	6,156.70

SEB SA	8	134.90	1,079.20
ACCOR SA	67	28.13	1,884.71
PUBLICIS GROUPE	138	52.80	7,286.40
VIVENDI	403	30.92	12,460.76
DELIVERY HERO SE	91	115.25	10,487.75
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	592	29.13	17,244.96
PROSUS NV	518	68.62	35,545.16
CARREFOUR SA	381	17.14	6,530.34
COLRUYT SA	20	48.33	966.60
JERONIMO MARTINS	85	18.05	1,534.25
KESKO OYJ-B SHS	196	36.63	7,179.48
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	591	28.75	16,994.20
DANONE	365	63.82	23,294.30
JDE PEET'S BV	48	29.83	1,431.84
KERRY GROUP PLC-A	94	124.50	11,703.00
BEIERSDORF AG	58	104.70	6,072.60
HENKEL AG & CO KGAA	60	76.85	4,611.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	91	82.64	7,520.24
L'OREAL	140	388.80	54,432.00
AMPLIFON SPA	73	43.26	3,157.98
MERCK KGAA	73	203.50	14,855.50
ORION OYJ-CLASS B	35	34.50	1,207.50
UCB SA	59	99.30	5,858.70
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	3,759	5.58	21,009.05
BNP PARIBAS	632	51.91	32,807.12
CAIXABANK S.A	2,570	2.57	6,612.61
COMMERZBANK AG	613	5.19	3,186.37
ERSTE GROUP BANK AG	149	33.64	5,012.36
ING GROEP NV-CVA	2,189	11.29	24,731.32
INTESA SANPAOLO	9,257	2.35	21,814.12
KBC GROEP NV	138	69.66	9,613.08
SOCIETE GENERALE SA	465	25.75	11,973.75
AMUNDI SA	22	78.45	1,725.90
DEUTSCHE BOERSE AG	104	150.80	15,683.20
EURAZEO	2	86.55	173.10

	WENDEL	10	121.00	1,210.00	
	AEGON NV	609	4.16	2,535.87	
	ALLIANZ SE-REG	231	198.88	45,941.28	
	ASSICURAZIONI GENERALI	626	17.07	10,685.82	
	AXA SA	1,032	23.92	24,690.60	
	CNP ASSURANCES	7	14.06	98.42	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	75	254.40	19,080.00	
	NN GROUP NV	167	43.83	7,319.61	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	194	52.92	10,266.48	
	ATOS SE	34	42.53	1,446.02	
	SAP SE	581	126.14	73,287.34	
	ELISA OYJ	97	55.46	5,379.62	
	KONINKLIJKE KPN NV	2,116	2.71	5,744.94	
	ORANGE	1,154	9.68	11,181.10	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	358	2.42	867.07	
	ENEL SPA	4,561	7.92	36,132.24	
	IBERDROLA SA	3,205	10.65	34,149.27	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	182	21.85	3,976.70	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	268	17.80	4,770.40	
	ASML HOLDING NV	233	664.40	154,805.20	
	ユーロ 小計	48,799		1,394,239.94 (178,992,523)	
英債券	ANTOFAGASTA PLC	238	14.05	3,343.90	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	82	91.70	7,519.40	
	JOHNSON MATTHEY PLC	117	29.77	3,483.09	
	MONDI PLC	288	20.34	5,857.92	
	ASHTED GROUP PLC	254	55.40	14,071.60	
	DCC PLC	58	60.10	3,485.80	
	FERGUSON PLC	125	100.70	12,587.50	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	46	156.65	7,205.90	
	INTERTEK GROUP PLC	98	52.42	5,137.16	
	RELX PLC	1,051	21.72	22,827.72	
	RENTOKIL INITIAL PLC	864	5.77	4,992.19	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	672	7.11	4,779.26	
	BERKELEY GROUP HOLDINGS	42	48.35	2,030.70	

	BURBERRY GROUP PLC	264	18.12	4,785.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	2,220	1.75	3,887.22	
	COMPASS GROUP PLC	959	14.66	14,063.73	
	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	105	44.75	4,698.75	
	WHITBREAD PLC	126	29.95	3,773.70	
	INFORMA PLC	959	5.31	5,092.29	
	WPP PLC	711	9.65	6,865.41	
	JD SPORTS FASHION PLC	319	9.69	3,091.11	
	KINGFISHER PLC	1,270	3.54	4,504.69	
	NEXT PLC	65	78.18	5,081.70	
	SAINSBURY (J) PLC	600	2.89	1,735.20	
	TESCO PLC	4,397	2.44	10,728.68	
	WM MORRISON SUPERMARKETS	813	2.79	2,269.89	
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	213	19.95	4,249.35	
	COCA-COLA HBC AG-DI	61	26.66	1,626.26	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	398	56.43	22,459.14	
	UNILEVER PLC	1,464	41.08	60,141.12	
	NMC HEALTH PLC	5	0.00	0.00	
	ASTRAZENECA PLC	859	87.36	75,042.24	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	2,805	15.13	42,456.48	
	LLOYDS BANKING GROUP PLC	40,029	0.43	17,544.71	
	STANDARD CHARTERED PLC	1,250	4.44	5,561.25	
	ABRDN PLC	1,438	2.63	3,783.37	
	SCHRODERS PLC	42	36.19	1,519.98	
	ST JAMES'S PLACE PLC	325	15.91	5,170.75	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	3,438	2.62	9,007.56	
	BT GROUP PLC	5,189	1.71	8,878.37	
	VODAFONE GROUP PLC	15,217	1.21	18,446.04	
	NATIONAL GRID PLC	1,908	9.78	18,665.96	
	英ポンド 小計	91,384		462,452.09	(69,321,568)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	62	19.26	1,194.12	
	GIVAUDAN-REG	5	4,602.00	23,010.00	
	SIKA AG-REG	81	325.20	26,341.20	
	ABB LTD-REG	948	34.30	32,516.40	

	GEBERIT AG-REG	21	752.40	15,800.40	
	ADECCO SA-REG	100	50.58	5,058.00	
	SGS SA-REG	3	2,856.00	8,568.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	31	325.90	10,102.90	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	296	99.34	29,404.64	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	1	10,430.00	10,430.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	30	354.90	10,647.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	6	1,697.00	10,182.00	
	LONZA GROUP AG-REG	42	749.00	31,458.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	391	372.00	145,452.00	
	VIFOR PHARMA AG	30	128.20	3,846.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	19	479.10	9,102.90	
	SWISS RE AG	175	85.14	14,899.50	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	85	404.40	34,374.00	
	SWISSCOM AG-REG	12	545.00	6,540.00	
	スイスフラン 小計	2,338		428,927.06 (51,346,858)	
スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	174	299.00	52,026.00	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	389	161.10	62,667.90	
	ALFA LAVAL AB	185	350.30	64,805.50	
	ASSA ABLOY AB-B	562	276.50	155,393.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	364	583.20	212,284.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	223	491.90	109,693.70	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	824	116.35	95,872.40	
	SANDVIK AB	623	211.30	131,639.90	
	SKF AB-B SHARES	245	212.30	52,013.50	
	ELECTROLUX AB-SER B	76	219.00	16,644.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	141	113.70	16,031.70	
	EVOLUTION AB	98	1,375.80	134,828.40	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	378	171.30	64,751.40	
	ICA GRUPPEN AB	34	438.50	14,909.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	346	280.30	96,983.80	
	NORDEA BANK ABP	1,848	100.76	186,204.48	
	ERICSSON LM-B SHS	1,644	98.90	162,591.60	
	TELE2 AB-B SHS	168	130.30	21,890.40	

	TELIA CO AB	1,655	38.07	63,005.85
	スウェーデンクローナ 小計	9,977		1,714,237.33 (21,393,681)
ノルウェークローネ	NORSK HYDRO ASA	466	57.60	26,841.60
	MOWI ASA	289	221.00	63,869.00
	ORKLA ASA	555	80.20	44,511.00
	DNB BANK ASA	506	186.75	94,495.50
	TELENOR ASA	353	158.05	55,791.65
	ノルウェークローネ 小計	2,169		285,508.75 (3,471,786)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	65	577.80	37,557.00
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	97	491.90	47,714.30
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	535	248.60	133,001.00
	PANDORA A/S	62	785.80	48,719.60
	AMBU A/S-B	104	192.50	20,020.00
	COLOPLAST-B	69	1,124.00	77,556.00
	DEMANT A/S	37	350.00	12,950.00
	GN STORE NORD A/S	81	473.50	38,353.50
	GENMAB A/S	37	2,969.00	109,853.00
	NOVO NORDISK A/S-B	961	670.30	644,158.30
	TRYG A/S	171	160.20	27,394.20
	ORSTED A/S	105	1,016.50	106,732.50
		デンマーククローネ 小計	2,324	
オーストラリアドル	WOODSIDE PETROLEUM LTD	466	19.60	9,133.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	318	24.35	7,743.30
	EVOLUTION MINING LTD	1,102	4.02	4,430.04
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	931	20.13	18,741.03
	NEWCREST MINING LTD	482	25.54	12,310.28
	NORTHERN STAR RESOURCES LTD	467	9.41	4,394.47
	ORICA LTD	135	12.89	1,740.15
	BRAMBLES LTD	741	12.29	9,106.89
	AURIZON HOLDINGS LTD	647	4.00	2,588.00
	SYDNEY AIRPORT	447	7.72	3,450.84
	TRANSURBAN GROUP	1,523	13.96	21,261.08

	ARISTOCRAT LEISURE LTD	345	42.63	14,707.35	
	REA GROUP LTD	33	155.70	5,138.10	
	SEEK LTD	116	31.05	3,601.80	
	COLES GROUP LTD	813	18.57	15,097.41	
	COCHLEAR LTD	39	256.09	9,987.51	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	121	66.54	8,051.34	
	SONIC HEALTHCARE LTD	274	42.40	11,617.60	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	1,611	28.36	45,687.96	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	994	99.22	98,624.68	
	ASX LTD	95	83.53	7,935.35	
	MACQUARIE GROUP LTD	187	164.98	30,851.26	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	1,520	5.38	8,177.60	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	903	12.38	11,179.14	
	LENDLEASE GROUP	224	11.75	2,632.00	
	AFTERPAY LTD	126	130.60	16,455.60	
	COMPUTERSHARE LTD	162	16.17	2,619.54	
	XERO LTD	78	147.89	11,535.42	
	TELSTRA CORP LTD	2,798	3.97	11,108.06	
	APA GROUP	812	9.85	7,998.20	
	AUSNET SERVICES	621	1.94	1,207.84	
	オーストラリアドル 小計	19,131		419,113.44	(32,942,316)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	864	7.07	6,108.48	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	359	33.65	12,080.35	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	145	14.52	2,105.40	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	1,242	4.77	5,930.55	
	MERCURY NZ LTD	599	6.80	4,073.20	
	MERIDIAN ENERGY LTD	460	5.09	2,343.70	
	ニュージーランドドル 小計	3,669		32,641.68	(2,450,737)
香港ドル	MTR CORP	1,023	45.15	46,188.45	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	2,242	24.95	55,937.90	
	HANG SENG BANK LTD	361	143.30	51,731.30	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	711	472.60	336,018.60	
	ESR CAYMAN LTD	1,200	23.05	27,660.00	

	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	172	54.30	9,339.60	
	SWIRE PROPERTIES LTD	404	22.50	9,090.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	1,289	10.42	13,431.38	
	HONG KONG & CHINA GAS	6,079	12.84	78,054.36	
	香港ドル 小計	13,481		627,451.59 (8,853,341)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	509	5.21	2,651.89	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	487	4.96	2,415.52	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	988	29.92	29,560.96	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	2,000	11.66	23,320.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	280	10.77	3,015.60	
	CAPITALAND LTD	1,705	3.97	6,768.85	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	168	6.92	1,162.56	
	UOL GROUP LTD	393	7.10	2,790.30	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	5,114	2.37	12,120.18	
	シンガポールドル 小計	11,644		83,805.86 (6,753,076)	
イスラエルシュケル	BANK HAPOLIM BM	622	27.62	17,179.64	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	942	27.28	25,697.76	
	イスラエルシュケル 小計	1,564		42,877.40 (1,450,409)	
	合 計	291,630		1,649,346,744 (1,649,346,744)	

(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	AMERICAN TOWER CORP	248	71,706.72	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	841	7,081.22	
		BOSTON PROPERTIES INC	77	8,690.99	
		CROWN CASTLE INTL CORP	241	47,696.31	
		EQUINIX INC	50	41,698.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	201	16,558.38	

	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	244	8,576.60	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	421	6,256.06	
	PROLOGIS INC	414	55,124.10	
	WELLTOWER INC	226	19,002.08	
	WEYERHAEUSER CO	424	14,377.84	
	米ドル 小計	3,387	296,768.30 (32,611,868)	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	29	1,725.50	
	カナダドル 小計	29	1,725.50 (147,944)	
ユーロ	COVIVIO	19	1,499.48	
	GECINA SA	16	2,120.00	
	KLEPIERRE	167	3,393.44	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	92	6,747.28	
	ユーロ 小計	294	13,760.20 (1,766,534)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	298	1,533.50	
	SEGRO PLC	568	7,253.36	
	英ポンド 小計	866	8,786.86 (1,317,150)	
オーストラリアドル	DEXUS/AU	782	8,273.56	
	GOODMAN GROUP	955	21,516.15	
	GPT GROUP	659	3,110.48	
	MIRVAC GROUP	2,406	7,386.42	
	STOCKLAND	1,676	7,625.80	
	VICINITY CENTRES	1,306	2,050.42	
	オーストラリアドル 小計	7,784	49,962.83 (3,927,078)	
シンガポールドル	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	3,529	7,375.61	
	シンガポールドル 小計	3,529	7,375.61 (594,326)	
	合計		40,364,900 (40,364,900)	

(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 267銘柄	97.3%		70.2%
	投資証券 11銘柄		2.7%	1.9%
カナダドル	株式 43銘柄	99.8%		3.9%
	投資証券 1銘柄		0.2%	0.0%
ユーロ	株式 97銘柄	99.0%		10.7%
	投資証券 4銘柄		1.0%	0.1%
英ポンド	株式 42銘柄	98.1%		4.1%
	投資証券 2銘柄		1.9%	0.1%
スイスフラン	株式 19銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式 19銘柄	100.0%		1.3%
ノルウェークローネ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式 12銘柄	100.0%		1.3%
オーストラリアドル	株式 31銘柄	89.3%		1.9%
	投資証券 6銘柄		10.7%	0.2%
ニュージーランドドル	株式 6銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式 9銘柄	100.0%		0.5%
シンガポールドル	株式 9銘柄	91.9%		0.4%
	投資証券 1銘柄		8.1%	0.0%
イスラエルシェケル	株式 2銘柄	100.0%		0.1%

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	1,852,313,124
コール・ローン	126,046,817
株式	13,128,879,004
投資証券	10,688,509
派生商品評価勘定	54,549
未収入金	58,612,625
未収配当金	36,150,878
差入委託証拠金	1,071,748,049
流動資産合計	16,284,493,555
資産合計	
16,284,493,555	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	230,368,708
未払利息	341
その他未払費用	369
流動負債合計	230,369,418
負債合計	
230,369,418	
純資産の部	
元本等	
元本	10,196,423,560
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,857,700,577
元本等合計	16,054,124,137
純資産合計	
16,054,124,137	
負債純資産合計	
16,284,493,555	

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。 為替予約取引 個別法に基づき、原則としてわが国における計算日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。

3. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
4. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p> <p>為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建資産等については、投資信託財産の計算に関する規則第60条の規定に基づき、通貨の種類ごとに勘定を設けて、邦貨建資産等と区分して整理する方法を採用しております。従って、外貨の売買については、同規則第61条の規定により処理し、為替差損益を算定しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2021年 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	7,627,636,469円
期中追加設定元本額	6,640,665,620円
期中一部解約元本額	4,071,878,529円
期末元本額	10,196,423,560円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	611,630,947円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,199,412,703円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,359,056,591円
DCりそな グローバルバランス	10,545,124円
つみたてバランスファンド	489,826,092円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	296,048,291円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	160,230,310円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	101,314,201円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	28,676,799円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	18,257,572円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	9,696,229円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	13,764,690円
リスクコントロール・オープン	9,069,149円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	145,390,595円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	102,694,219円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,415,979,042円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,426,411,174円
Smart-i 8資産バランス 安定型	54,739,351円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	136,948,348円
Smart-i 8資産バランス 成長型	160,461,838円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	246,547,782円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	460,808,651円

りそな・リスクコントロールファンド2019-10	274,226,886円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	198,295,274円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	225,856,987円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	39,117,982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)	1,299,320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	10,196,423,560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	1.5745円
(10,000口当たり純資産額)	(15,745円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20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 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		1,367,533,955
投資証券		1,043,473
合計		1,366,490,482

(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 8月20日現在）

（単位：円）

--	--	--	--	--

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,203,852,840	-	2,973,597,026	230,255,814
合計		3,203,852,840	-	2,973,597,026	230,255,814

(注) 時価の算定方法

先物取引

外国先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

(通貨関連)

(2021年 8月20日現在)

(単位: 円)

区分	種類	契約額等	時価		評価損益
			うち1年超		
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	183,132,580	-	183,074,153	58,427
	米ドル	183,132,580	-	183,074,153	58,427
	売建	114,529	-	114,447	82
	韓国ウォン	81,529	-	81,529	-
	オフショア人民元	33,000	-	32,918	82
合計		183,247,109	-	183,188,600	58,345

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	92,693	7.81	724,488.48	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	6,475	84.90	549,727.50	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,433	236.00	338,188.00	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	18,641	7.10	132,425.66	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	11,989	4.54	54,525.97	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	3,726	39.37	146,692.62	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	4.40	8,360.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	6.44	20,562.92	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	9,876	31.69	312,970.44	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,400	32.26	77,424.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	18.61	43,659.06	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,078	91.45	98,583.10	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	22.52	72,064.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,285	60.87	78,217.95	
	51JOB INC-ADR	500	71.96	35,980.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,700	7.20	33,840.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	6,900	25.58	176,502.00	
	LI AUTO INC - ADR	8,400	27.54	231,336.00	
	NIO INC - ADR	20,100	36.29	729,429.00	
	XPENG INC - ADR	6,000	37.57	225,420.00	
	GAOTU TECHEDU INC	1,900	2.38	4,522.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	2,800	43.51	121,828.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	24,300	1.81	43,983.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	6,500	5.07	32,955.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	6,550	58.96	386,188.00	
	AUTOHOME INC-ADR	1,020	37.26	38,005.20	
BAIDU INC - SPON ADR	4,150	137.33	569,919.50		
BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,500	64.33	160,825.00		

DOUYU INTERNATIONAL HOLD-ADR	1,600	3.23	5,168.00
HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,650	11.19	29,653.50
HUYA INC-ADR	1,300	9.55	12,415.00
IQIYI INC-ADR	4,500	8.20	36,900.00
JOYY INC	920	45.28	41,657.60
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	19.91	33,667.81
NETEASE INC-ADR	6,310	78.92	497,985.20
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	10,500	7.23	75,915.00
WEIBO CORP-SPON ADR	930	47.60	44,268.00
YANDEX NV-A	4,700	68.25	320,775.00
BAOZUN INC-SPN ADR	900	19.15	17,235.00
DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	17.89	17,890.00
JD.COM INC-ADR	13,420	62.19	834,589.80
OZON HOLDINGS PLC - ADR	600	50.03	30,018.00
PINDUODUO INC-ADR	6,800	74.69	507,892.00
TRIP.COM GROUP LTD	7,950	26.53	210,913.50
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	7,000	13.15	92,050.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	4,497	15.09	67,882.21
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	1,879	33.80	63,510.20
ADECOAGRO SA	1,800	8.76	15,768.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	1,600	4.23	6,768.00
BEIGENE LTD-ADR	700	275.44	192,808.00
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	800	18.87	15,096.00
HUTCHMED CHINA-ADR	1,300	38.36	49,868.00
I-MAB-SPONSORED ADR	500	57.18	28,590.00
ZAI LAB LTD-ADR	1,200	130.00	156,000.00
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	20,476	3.75	76,785.00
CREDICORP LTD	1,044	92.30	96,361.20
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	41,932	17.69	741,777.08
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	1,893	93.14	176,314.02
VTB BANK JSC -GDR-REG S	22,102	1.30	28,909.41
360 DIGITECH INC	1,400	16.90	23,660.00
LUFAX HOLDING LTD	2,900	8.63	25,027.00
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	36.35	18,175.00
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,400	12.92	18,088.00

	KE HOLDINGS INC	5,600	17.01	95,256.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.97	9,787.68	
	21VIANET GROUP INC-ADR	1,400	15.99	22,386.00	
	AGORA INC-ADR	800	25.94	20,752.00	
	CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	9.92	14,880.00	
	GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,400	50.30	70,420.00	
	GLOBANT SA	621	288.67	179,264.07	
	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	24.10	21,690.00	
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,900	4.09	7,771.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,200	8.69	62,568.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	800	45.92	36,736.00	
	米ドル 小計	469,450		10,600,513.68 (1,164,890,448)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	240,900	15.54	3,743,586.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	49,400	86.41	4,268,654.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	270.84	501,054.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	14,200	54.37	772,054.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	64.33	476,042.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,700	218.18	1,461,806.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,030	341.35	1,034,290.50	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	149.38	410,795.00	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	39,400	49.74	1,959,756.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	2,200	70.83	155,826.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	83,200	71.57	5,954,624.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	124.27	956,879.00	
	BEACLE SAB DE CV	5,300	45.56	241,468.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	115.06	891,139.70	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	30,800	173.45	5,342,260.00	
	GRUMA S.A.B. -B	2,855	224.92	642,146.60	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	49.81	1,329,927.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	24,500	33.85	829,325.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	41,000	126.59	5,190,190.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-0	30,800	19.43	598,444.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	537,500	18.16	9,761,000.00	
	TELESITES SAB DE CV	19,700	15.82	311,654.00	

	メキシコペソ 小計	1,185,630		46,832,920.80 (255,393,966)	
ブラジルリアル	COSAN SA	16,900	22.44	379,236.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	58,500	27.16	1,588,860.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	74,700	26.64	1,990,008.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	15.37	159,848.00	
	BRADSPAR SA -PREF	3,300	63.41	209,253.00	
	BRASKEM SA-PREF A	2,900	57.46	166,634.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	9,900	37.00	366,300.00	
	GERDAU SA-PREF	18,400	27.69	509,496.00	
	KLABIN SA - UNIT	10,200	23.90	243,780.00	
	SUZANO SA	11,907	55.68	662,981.76	
	VALE SA	61,700	97.51	6,016,367.00	
	WEG SA	26,600	35.19	936,054.00	
	CCR SA	18,800	12.27	230,676.00	
	LOCALIZA RENT A CAR	9,710	58.14	564,539.40	
	RUMO SA	21,000	18.26	383,460.00	
	ALPARGATAS SA - PREF	2,700	57.90	156,330.00	
	AMERICANAS SA	5,500	40.82	224,510.00	
	LOJAS RENNER S.A.	13,000	39.45	512,850.00	
	MAGAZINE LUIZA SA	46,300	18.95	877,385.00	
	PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	18,700	26.07	487,509.00	
	VIA S/A	21,100	11.20	236,320.00	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	18.88	151,040.00	
	RAIA DROGASIL SA	17,600	26.22	461,472.00	
	AMBEV SA	74,400	17.19	1,278,936.00	
	BRF SA	9,900	23.59	233,541.00	
	JBS SA	16,900	31.41	530,829.00	
NATURA &CO HOLDING SA	14,300	53.52	765,336.00		
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	14.93	256,796.00		
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	8,300	82.52	684,916.00		
REDE D'OR SAO LUIZ SA	3,700	73.46	271,802.00		
HYPERA SA	6,400	35.08	224,512.00		
BANCO BRADESCO S.A.	23,432	19.62	459,735.84		
BANCO BRADESCO SA-PREF	76,379	22.75	1,737,622.25		

	BANCO DO BRASIL S.A.	13,800	29.67	409,446.00	
	BANCO INTER SA-UNITS	5,500	64.58	355,190.00	
	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,200	40.21	249,302.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	75,800	29.90	2,266,420.00	
	ITAUSA SA	70,000	11.16	781,200.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	97,500	14.18	1,382,550.00	
	BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	16,800	28.28	475,104.00	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	9,800	19.75	193,550.00	
	TOTVS SA	7,200	36.60	263,520.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	7,600	43.17	328,092.00	
	TIM SA	9,000	11.96	107,640.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	38.16	129,744.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	37.91	185,759.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	15,742	12.18	191,737.56	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	6.64	73,040.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	32.97	164,850.00	
	CPFL ENERGIA SA	2,300	27.55	63,365.00	
	ENERGISA SA-UNITS	2,000	43.63	87,260.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	2,275	38.00	86,450.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	15,100	24.33	367,383.00	
	ブラジルリアル 小計	1,119,645		32,120,537.81 (651,664,683)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	5,695	6,440.00	36,675,800.00	
	EMPRESAS CMPC SA	14,823	1,580.00	23,420,340.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,233	37,700.00	84,184,100.00	
	FALABELLA SA	10,992	3,100.00	34,075,200.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,420.00	36,779,420.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	1,735	8,039.70	13,948,879.50	
	BANCO DE CHILE	766,095	71.90	55,082,230.50	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	945	32,200.00	30,429,000.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	39.70	38,180,442.80	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	1,059.90	5,516,779.50	
	COLBUN SA	161,671	127.90	20,677,720.90	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	103.00	39,508,431.00	
	ENEL CHILE SA	369,172	38.26	14,124,520.72	

	チリペソ 小計	2,709,768		432,602,864.92 (60,377,949)	
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,520.00	178,980,480.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	31,600.00	146,529,200.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,902	31,650.00	250,098,300.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	2,588	19,660.00	50,880,080.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	23,650.00	157,106,950.00	
	コロンビアペソ 小計	92,794		783,595,010.00 (22,243,911)	
ユーロ	OPAP SA	3,467	12.10	41,950.70	
	JUMBO SA	1,515	12.94	19,604.10	
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	36,613	1.09	40,255.99	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	42,000	0.78	32,768.40	
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	3,292	15.94	52,490.94	
	ユーロ 小計	86,887		187,070.13 (24,016,063)	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	5,150	15.15	78,048.25	
	英ポンド 小計	5,150		78,048.25 (11,699,432)	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	100.40	176,202.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	18.55	421,845.55	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	7,910	15.28	120,864.80	
	KOC HOLDING AS	14,295	22.78	325,640.10	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	17,000	8.69	147,730.00	
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	170.90	186,622.80	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	71.10	588,423.60	
	AKBANK T.A.S.	43,035	5.57	239,704.95	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	31,721	9.29	294,688.09	
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	5.54	138,716.06	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	15.69	299,537.79	
	トルコリラ 小計	191,955		2,939,975.74 (37,887,173)	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,233	828.50	1,021,540.50	
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	86.55	609,744.75	
	CEZ AS	2,634	654.00	1,722,636.00	
		10,912		3,353,921.25	

	チェココルナ 小計			(16,874,583)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	5,429	2,362.00	12,823,298.00
	RICHTER GEDEON NYRT	2,026	9,070.00	18,375,820.00
	OTP BANK PLC	3,561	17,740.00	63,172,140.00
	ハンガリーフォリント 小計	11,016		94,371,258.00 (34,534,218)
ポーランドズロ チ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,822	70.74	341,108.28
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	26,615	6.26	166,663.13
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,231	172.75	385,405.25
	LPP SA	19	13,380.00	254,220.00
	CD PROJEKT SA	1,166	168.30	196,237.80
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	35.32	172,220.32
	ALLEGRO.EU SA	5,718	65.01	371,727.18
	DINO POLSKA SA	707	338.50	239,319.50
	BANK PEKAO SA	2,676	102.45	274,156.20
	PKO BANK POLSKI SA	12,623	38.96	491,792.08
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	269.40	144,937.20
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,703	39.98	387,925.94
	ORANGE POLSKA SA	11,699	8.11	94,937.38
	PGE SA	9,929	8.86	88,010.65
	ポーランドズロチ 小計	93,322		3,608,660.91 (101,106,378)
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	114,400	38.03	4,350,632.00
	ALROSA PJSC	32,550	134.20	4,368,210.00
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	24,440	180.71	4,416,552.40
	INTER RAO UES PJSC	423,000	4.20	1,776,600.00
	ロシアルーブル 小計	594,390		14,911,994.40 (22,069,751)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	5.54	155,120.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	380,000	3.53	1,341,400.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	53,500	15.12	808,920.00
	PETROCHINA CO LTD-H	304,000	3.07	933,280.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	26,000	9.80	254,800.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	4.40	290,400.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	19,500	42.40	826,800.00

CHINA HONGQIAO GROUP LTD	34,500	10.74	370,530.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	5.52	264,960.00
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	62,000	9.90	613,800.00
CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	7.71	277,560.00
GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,000	149.00	596,000.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	13.84	249,120.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	6.46	142,120.00
MMG LTD	40,000	3.03	121,200.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	26,000	10.30	267,800.00
PERENNIAL ENERGY HOLDINGS LT	15,000	1.79	26,850.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	12.96	123,120.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	6.36	82,680.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	90,000	10.40	936,000.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	5.53	243,320.00
BOC AVIATION LTD	3,500	60.60	212,100.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	28,000	3.54	99,120.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	25,500	30.45	776,475.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	17,000	14.26	242,420.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	3.63	235,950.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	5.92	177,600.00
CITIC LTD	92,000	8.21	755,320.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	40,000	9.68	387,200.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	29.00	290,000.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	9.61	182,590.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	15.38	176,870.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	31,000	19.28	597,680.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	12.72	162,816.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	8,700	46.40	403,680.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	7.28	142,688.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	30.50	274,500.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	59,000	5.25	309,750.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	14.96	179,520.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	23,000	56.40	1,297,200.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	20,000	8.33	166,600.00
AIR CHINA LTD-H	30,000	4.99	149,700.00

BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.35	130,500.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	10.88	261,120.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.30	111,800.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	50,700	13.94	706,758.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.06	193,920.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.43	168,600.00	
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	10.54	205,530.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.56	118,080.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	12,000	258.40	3,100,800.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	7.19	316,360.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,600	46.90	450,240.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	92,000	26.80	2,465,600.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	48,500	32.30	1,566,550.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	46,000	7.19	330,740.00	
MINTH GROUP LTD	12,000	34.05	408,600.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	14.50	290,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	17,000	167.40	2,845,800.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	5.75	310,500.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	31,000	28.00	868,000.00	
LI NING CO LTD	35,000	94.75	3,316,250.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	12,900	185.40	2,391,660.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	7.58	45,480.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	13.46	174,980.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	4.40	105,600.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	17,000	28.50	484,500.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	12,000	24.85	298,200.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.89	178,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	6,200	65.50	406,100.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	4,300	65.75	282,725.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	89,500	421.20	37,697,400.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	235,440	162.10	38,164,824.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	8,000	42.15	337,200.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	139,000	0.78	108,420.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	44,000	3.98	175,120.00	

JD HEALTH INTERNATIONAL INC	4,550	67.85	308,717.50
MEITUAN	56,100	202.60	11,365,860.00
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	14,400	15.02	216,288.00
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	10.16	243,840.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	9,000	66.65	599,850.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	4.23	133,245.00
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	1,100	98.26	108,086.00
CHINA FEIHE LTD	56,000	14.36	804,160.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	49,000	43.50	2,131,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	22,000	62.65	1,378,300.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	3.95	120,475.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	6,400	39.05	249,920.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	19,000	43.40	824,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	32,000	13.16	421,120.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	65.65	525,200.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	7.25	152,250.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	72,000	5.17	372,240.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	7,000	44.00	308,000.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	10,500	41.00	430,500.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	21.60	129,600.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	64,000	11.50	736,000.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	12.12	242,400.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	10,000	46.85	468,500.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	68.10	490,320.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40,000	13.28	531,200.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	15.28	172,664.00
SINOPHARM GROUP CO-H	21,600	21.10	455,760.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	40.85	142,975.00
3SBIO INC	20,500	7.34	150,470.00
AKESO INC	5,000	39.75	198,750.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,200	283.80	340,560.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	22,000	17.24	379,280.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	25,500	3.99	101,745.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	46,000	3.86	177,560.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	140,000	10.90	1,526,000.00

GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	34.70	624,600.00	
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	132.70	252,130.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	25.80	464,400.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	18,000	67.20	1,209,600.00	
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	156.80	329,280.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	8,000	53.45	427,600.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	162,250	6.62	1,074,095.00	
SSY GROUP LTD	22,000	5.31	116,820.00	
WUXI APPTec CO LTD-H	5,368	145.10	778,896.80	
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	52,500	113.80	5,974,500.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	384,000	2.60	998,400.00	
BANK OF CHINA LTD-H	1,236,000	2.71	3,349,560.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	137,000	4.54	621,980.00	
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	3.09	122,055.00	
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	140,000	3.54	495,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,495,000	5.67	8,476,650.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.73	128,310.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	60,500	66.10	3,999,050.00	
CHINA MINSHENG BANKING-H	75,100	3.27	245,577.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	18,000	2.97	53,460.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	878,000	4.36	3,828,080.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.56	695,000.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	149,000	1.39	207,110.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	9.04	126,560.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.22	236,320.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.02	105,060.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	23,200	18.72	434,304.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	36,500	19.02	694,230.00	
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.75	253,750.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	15,600	14.00	218,400.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	6.96	303,456.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	10.96	282,768.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	116,000	12.92	1,498,720.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	41,400	22.60	935,640.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	11.48	280,112.00	

NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	14,100	22.25	313,725.00	
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.41	303,660.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	104,000	6.94	721,760.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	98,500	65.25	6,427,125.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,900	35.10	277,290.00	
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	9.07	163,260.00	
CHINA AOYUAN GROUP LTD	20,000	5.19	103,800.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	5.00	120,000.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	2.31	221,760.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	60,500	18.22	1,102,310.00	
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	6.67	133,400.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	50,000	27.90	1,395,000.00	
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	5,800	41.05	238,090.00	
CHINA VANKE CO LTD-H	27,100	22.85	619,235.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	54,000	5.25	283,500.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	122,000	8.20	1,000,400.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	10.16	152,400.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	7.07	186,648.00	
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	10,700	27.45	293,715.00	
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	2.29	84,730.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	8.81	189,415.00	
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	9.20	211,600.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	28,500	36.40	1,037,400.00	
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	2,400	45.80	109,920.00	
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	6.45	161,250.00	
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	7.20	259,200.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.25	117,000.00	
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	15.50	310,000.00	
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	17.30	173,000.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	40,000	19.38	775,200.00	
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	11,000	19.28	212,080.00	
WHARF HOLDINGS LTD	22,000	24.75	544,500.00	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	20,800	7.37	153,296.00	
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	22,000	4.66	102,520.00	
CHINA YOUZAN LTD	220,000	0.79	173,800.00	

	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	41,000	24.00	984,000.00	
	KINGSOFT CORP LTD	15,200	35.85	544,920.00	
	MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	6,000	28.50	171,000.00	
	TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	13.64	177,320.00	
	WEIMOB INC	27,000	9.73	262,710.00	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	11,500	44.10	507,150.00	
	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10,500	35.35	371,175.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	10,500	36.15	379,575.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	14.38	237,270.00	
	LENOVO GROUP LTD	114,000	7.84	893,760.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	11,100	215.40	2,390,940.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	223,400	24.00	5,361,600.00	
	ZTE CORP-H	12,200	26.80	326,960.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	656,000	1.03	675,680.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	25.15	213,775.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	3.04	231,040.00	
	CGN POWER CO LTD-H	171,000	1.67	285,570.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	48,600	23.55	1,144,530.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	53,000	13.00	689,000.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	2.25	132,750.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	14,000	48.95	685,300.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	32,000	14.90	476,800.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	12,400	165.10	2,047,240.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	48,000	10.80	518,400.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	3.23	167,960.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	64,000	7.28	465,920.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	32.10	224,700.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	8,000	42.65	341,200.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	76,000	15.36	1,167,360.00	
	香港ドル 小計	13,319,408		222,937,319.30 (3,145,645,575)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.60	181,480.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	18.90	111,510.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	40,000	7.97	318,800.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	49,400	4.91	242,554.00	

	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.06	61,256.00	
	SIME DARBY BERHAD	33,100	2.20	72,820.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	12,900	5.78	74,562.00	
	MISC BHD	17,600	6.83	120,208.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	4.26	83,496.00	
	GENTING BHD	32,900	4.70	154,630.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	2.76	153,732.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	26.08	54,768.00	
	IOI CORP BHD	32,500	3.78	122,850.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	20.00	128,000.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	134.00	134,000.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	18.20	202,384.00	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.61	96,211.50	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	3.79	115,216.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	23,700	7.06	167,322.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	5.79	184,122.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	3.09	51,294.00	
	SUPERMAX CORP BHD	19,217	3.08	59,188.36	
	TOP GLOVE CORP BHD	79,500	3.77	299,715.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	2.88	67,392.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	95,200	4.60	437,920.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.30	184,830.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	1,800	17.38	31,284.00	
	MALAYAN BANKING BHD	64,500	8.09	521,805.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	231,100	3.91	903,601.00	
	RHB BANK BHD	28,700	5.28	151,536.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	3.92	187,376.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	4.25	224,825.00	
	MAXIS BHD	30,200	4.40	132,880.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.84	107,456.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	15.98	223,720.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	38,200	9.90	378,180.00	
	マレーシアリングット 小計	1,272,287		6,742,923.86	(174,855,478)
タイパーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	102.50	2,429,250.00	

PTT PCL-NVDR	161,800	35.25	5,703,450.00	
THAI OIL PCL-NVDR	13,200	45.50	600,600.00	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	26,800	40.50	1,085,400.00	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	32,800	58.25	1,910,600.00	
SCG PACKAGING PCL-NVDR	20,500	70.50	1,445,250.00	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	12,700	414.00	5,257,800.00	
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	70,100	58.50	4,100,850.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	89,500	8.25	738,375.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	105,500	8.80	928,400.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	62,200	4.20	261,240.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	32.25	1,567,350.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	31.75	1,054,893.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	13.10	1,154,110.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	28.50	1,553,250.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	34.00	561,000.00	
CP ALL PCL-NVDR	94,900	57.50	5,456,750.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	132.50	649,250.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	56,700	26.00	1,474,200.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	37.00	721,500.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	20.80	1,010,880.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	159,100	22.50	3,579,750.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	6,000	129.00	774,000.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	38.25	512,550.00	
BANGKOK BANK PCL-FOREIGN REG	7,800	103.00	803,400.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	25,000	10.40	260,000.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	97.25	1,497,650.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	17.10	312,930.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	59.00	867,300.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	7,600	60.25	457,900.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	9,000	67.50	607,500.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	29,400	49.50	1,455,300.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	8.00	1,249,600.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,200	550.00	2,860,000.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	19,700	182.50	3,595,250.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	17,100	76.00	1,299,600.00	

	TRUE CORP PCL-NVDR	85,100	3.06	260,406.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	43.25	410,875.00	
	ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	175.00	700,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	23,900	58.50	1,398,150.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	78.50	1,044,050.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	46,700	37.75	1,762,925.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	44.25	495,600.00	
	タイパーツ 小計	1,781,925		65,869,134.75	(216,709,453)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	23,360	41.30	964,768.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	732.50	3,479,375.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	527.00	822,120.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	62.80	3,233,634.80	
	SM INVESTMENTS CORP	4,030	999.00	4,025,970.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	17,520	183.00	3,206,160.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	198.00	1,376,100.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,570	141.00	1,913,370.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	26,410	84.40	2,229,004.00	
	BDO UNIBANK INC	28,100	112.00	3,147,200.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	46.20	1,275,674.40	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.84	556,800.00	
	AYALA LAND INC	134,900	34.75	4,687,775.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	148,800	34.70	5,163,360.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	2,102.00	945,900.00	
	PLDT INC	980	1,258.00	1,232,840.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	290.00	910,600.00	
	フィリピンペソ 小計	638,623		39,170,651.20	(85,125,659)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	150,900	1,295.00	195,415,500.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	22,100	19,300.00	426,530,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	111,500	2,270.00	253,105,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	377,500	1,080.00	407,700,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	6,250.00	336,875,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	11,025.00	255,780,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,670.00	428,535,000.00	

	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	9,100.00	503,230,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	293,800	5,150.00	1,513,070,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	108,300	6,500.00	703,950,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	30,200.00	199,320,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	8,150.00	266,505,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,250.00	507,500,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	4,110.00	413,877,000.00	
	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,250.00	433,125,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	174,900	33,000.00	5,771,700,000.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	303,200	5,850.00	1,773,720,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	5,300.00	559,150,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	882,300	3,880.00	3,423,324,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,270.00	441,071,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	792,800	3,390.00	2,687,592,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	2,960.00	417,064,000.00	
	インドネシアルピア 小計	4,671,600		21,918,138,500.00 (168,769,666)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	40,100.00	34,004,800.00	
	S-OIL CORP	662	87,900.00	58,189,800.00	
	SK INNOVATION CO LTD	811	230,000.00	186,530,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,981	37,650.00	74,584,650.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,255	46,500.00	58,357,500.00	
	KOREA ZINC CO LTD	121	499,500.00	60,439,500.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	182,000.00	55,874,000.00	
	LG CHEM LTD	719	894,000.00	642,786,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	401,000.00	53,333,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	239	236,000.00	56,404,000.00	
	POSCO	1,166	313,500.00	365,541,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	448	148,000.00	66,304,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	286,000.00	31,460,000.00	
	SKC CO LTD	311	163,500.00	50,848,500.00	
	CJ CORP	193	96,000.00	18,528,000.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	26,300.00	13,518,200.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	883	40,700.00	35,938,100.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	4,146	19,500.00	80,847,000.00	

GS ENGINEERING & CONSTRUCT	839	39,200.00	32,888,800.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,161	49,050.00	56,947,050.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	63,900.00	51,950,700.00	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	31,000.00	31,000,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	557	110,500.00	61,548,500.00	
LG CORP	1,396	95,100.00	132,759,600.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,346	129,500.00	174,307,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	21,450.00	51,587,250.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	5,770.00	39,853,390.00	
SK	511	259,000.00	132,349,000.00	
S-1 CORPORATION	228	80,300.00	18,308,400.00	
CJ LOGISTICS	135	167,000.00	22,545,000.00	
HMM CO LTD	4,121	38,000.00	156,598,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	314	179,000.00	56,206,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,155	28,400.00	61,202,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	3,277	7,730.00	25,331,210.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	966	45,300.00	43,759,800.00	
HANON SYSTEMS	2,393	15,450.00	36,971,850.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,051	257,500.00	270,632,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,179	206,500.00	449,963,500.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	99,000.00	60,390,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	99,500.00	33,432,000.00	
KIA CORP	4,149	80,400.00	333,579,600.00	
COWAY CO LTD	831	73,000.00	60,663,000.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	44,000.00	28,776,000.00	
HLB INC	1,142	41,300.00	47,164,600.00	
LG ELECTRONICS INC	1,690	148,000.00	250,120,000.00	
KANGWON LAND INC	1,387	25,350.00	35,160,450.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	22,550.00	23,677,500.00	
HYBE CO LTD	230	285,000.00	65,550,000.00	
KAKAO CORP	4,858	146,500.00	711,697,000.00	
NAVER CORP	1,928	424,500.00	818,436,000.00	
NCSOFT CORP	263	853,000.00	224,339,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	271	126,500.00	34,281,500.00	
PEARL ABYSS CORP	350	67,500.00	23,625,000.00	

CJ ENM CO LTD	195	146,800.00	28,626,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	407	84,600.00	34,432,200.00
LOTTE SHOPPING CO	222	100,500.00	22,311,000.00
SHINSEGAE INC	109	250,500.00	27,304,500.00
BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	162,000.00	22,356,000.00
E-MART INC	257	170,500.00	43,818,500.00
CJ CHEILJEDANG CORP	123	434,000.00	53,382,000.00
KT&G CORP	1,875	81,100.00	152,062,500.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	115,500.00	47,586,000.00
AMOREPACIFIC CORP	526	214,000.00	112,564,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	429	54,800.00	23,509,200.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	149	1,437,000.00	214,113,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	666,000.00	20,646,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,232	114,100.00	140,571,200.00
ALTEOGEN INC	360	75,200.00	27,072,000.00
CELLTRION INC	1,516	271,000.00	410,836,000.00
CELLTRION PHARM INC	238	161,600.00	38,460,800.00
GREEN CROSS CORP	90	306,000.00	27,540,000.00
HANMI PHARM CO LTD	87	300,000.00	26,100,000.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	263	975,000.00	256,425,000.00
SEEGENE INC	480	65,500.00	31,440,000.00
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	400	67,300.00	26,920,000.00
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	387	115,000.00	44,505,000.00
YUHAN CORP	839	59,200.00	49,668,800.00
HANA FINANCIAL GROUP	4,768	42,900.00	204,547,200.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	10,000.00	44,550,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	6,224	51,300.00	319,291,200.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	6,937	37,550.00	260,484,350.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	7,413	10,750.00	79,689,750.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	715	90,200.00	64,493,000.00
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	4,930.00	29,974,400.00
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,302	8,380.00	36,050,760.00
NH INVESTMENT & SECURITIES C	1,540	12,350.00	19,019,000.00
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	824	45,000.00	37,080,000.00
DB INSURANCE CO LTD	726	58,400.00	42,398,400.00

	SAMSUNG FIRE & MARINE INS	503	225,000.00	113,175,000.00	
	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	966	72,100.00	69,648,600.00	
	DOUZONE BIZON CO LTD	357	80,400.00	28,702,800.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	567	169,500.00	96,106,500.00	
	KMW CO LTD	357	48,300.00	17,243,100.00	
	LG DISPLAY CO LTD	3,338	20,250.00	67,594,500.00	
	LG INNOTEK CO LTD	243	201,000.00	48,843,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	899	171,000.00	153,729,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	74,262	73,100.00	5,428,552,200.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	12,856	68,500.00	880,636,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	862	777,000.00	669,774,000.00	
	LG UPLUS CORP	3,613	13,900.00	50,220,700.00	
	SK TELECOM	628	290,000.00	182,120,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,249	23,650.00	100,488,850.00	
	SK HYNIX INC	8,517	102,500.00	872,992,500.00	
	韓国ウォン 小計	235,316		18,400,743,760.00 (1,729,669,913)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	91.10	1,730,900.00	
	ASIA CEMENT CORP	31,000	43.35	1,343,850.00	
	CHINA STEEL CORP	186,000	35.30	6,565,800.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	56,000	80.20	4,491,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	60,000	96.70	5,802,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	81,000	84.00	6,804,000.00	
	TAIWAN CEMENT	78,477	46.20	3,625,637.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,100	867.00	1,820,700.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	39,000	28.30	1,103,700.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	4,174	313.50	1,308,549.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	37,550	128.00	4,806,400.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	22,000	29.05	639,100.00	
	WAN HAI LINES LTD	8,000	213.00	1,704,000.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	28,000	126.50	3,542,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	37.60	1,128,000.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,020	510.00	1,540,200.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	6,080	200.50	1,219,040.00	
	GIANT MANUFACTURING	4,000	307.50	1,230,000.00	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	2,000	411.50	823,000.00	
POU CHEN	34,000	32.50	1,105,000.00	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	539.00	2,695,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	9,000	286.50	2,578,500.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	77,000	69.10	5,320,700.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	185.00	555,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	71,616	16.60	1,188,825.60	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	292,000	21.35	6,234,200.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	179,906	26.95	4,848,466.70	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	163,627	23.00	3,763,421.00	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	135,416	19.50	2,640,612.00	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	172,000	31.30	5,383,600.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	144,995	13.65	1,979,181.75	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	140,769	16.90	2,378,996.10	
TAIWAN BUSINESS BANK	79,672	9.62	766,444.64	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	149,374	20.95	3,129,385.30	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	58,000	40.55	2,351,900.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	20,996	225.50	4,734,598.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	156,920	23.35	3,664,082.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	125,000	53.80	6,725,000.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	218,000	13.20	2,877,600.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	28.35	790,936.65	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	105,000	77.00	8,085,000.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	154,835	9.02	1,396,611.70	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	9,480	63.60	602,928.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	8,000	289.00	2,312,000.00	
ACER INC	38,000	24.45	929,100.00	
ADVANTECH CO LTD	5,299	362.00	1,918,238.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	11,000	311.00	3,421,000.00	
AU OPTRONICS CORP	122,000	19.75	2,409,500.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	11,000	175.50	1,930,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	63,000	22.30	1,404,900.00	
DELTA ELECTRONICS INC	31,000	269.00	8,339,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	64.50	903,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	194,800	103.00	20,064,400.00	

INNOLUX CORP	126,000	19.10	2,406,600.00	
INVENTEC CORP	41,000	23.80	975,800.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,600	2,740.00	4,384,000.00	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	35,000	56.90	1,991,500.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	123.50	1,235,000.00	
NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	3,000	360.00	1,080,000.00	
PEGATRON CORP	33,000	64.50	2,128,500.00	
QUANTA COMPUTER INC	43,000	74.90	3,220,700.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	17,000	51.00	867,000.00	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	17,000	131.00	2,227,000.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	177.00	885,000.00	
WISTRON CORP	40,951	26.70	1,093,391.70	
WIWYNN CORP	1,000	889.00	889,000.00	
WPG HOLDINGS LTD	26,960	47.10	1,269,816.00	
YAGEO CORPORATION	6,198	450.00	2,789,100.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	10,000	95.00	950,000.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	60,000	116.50	6,990,000.00	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	60.70	1,456,800.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	27,000	103.00	2,781,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	52,000	115.50	6,006,000.00	
ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	1,785.00	892,500.00	
GLOBALWAFERS CO LTD	3,000	777.00	2,331,000.00	
MEDIATEK INC	23,500	888.00	20,868,000.00	
NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	65.70	1,116,900.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS COR	9,000	470.50	4,234,500.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	2,000	418.50	837,000.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	106.00	1,060,000.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	7,000	517.00	3,619,000.00	
SILERGY CORP	1,250	3,385.00	4,231,250.00	
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	382,700	559.00	213,929,300.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	185,000	55.50	10,267,500.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	12,000	136.00	1,632,000.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	324.50	1,947,000.00	
WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	28.90	1,213,800.00	
	5,009,664		484,461,661.54	

	新台湾ドル 小計			(1,902,044,929)
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	13,868	463.50	6,427,818.00
	COAL INDIA LTD	25,983	138.35	3,594,748.05
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	8,112	253.80	2,058,825.60
	INDIAN OIL CORP LTD	24,474	106.20	2,599,138.80
	OIL & NATURAL GAS CORP LTD	37,490	113.20	4,243,868.00
	PETRONET LNG LTD	12,992	223.65	2,905,660.80
	RELIANCE INDUSTRIES LTD	44,465	2,172.65	96,606,882.25
	ACC LTD	1,105	2,356.30	2,603,711.50
	AMBUJA CEMENTS LTD	11,501	409.40	4,708,509.40
	ASIAN PAINTS LTD	6,046	3,001.55	18,147,371.30
	BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	813.70	3,316,641.20
	GRASIM INDUSTRIES LTD	4,259	1,501.20	6,393,610.80
	HINDALCO INDUSTRIES LTD	25,088	426.95	10,711,321.60
	JSW STEEL LTD	12,106	737.45	8,927,569.70
	PI INDUSTRIES LTD	1,184	3,183.05	3,768,731.20
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,129	2,225.30	4,737,663.70
	SHREE CEMENT LTD	150	26,327.30	3,949,095.00
	TATA STEEL LTD	9,239	1,500.45	13,862,657.55
	ULTRATECH CEMENT LTD	1,607	7,601.45	12,215,530.15
	UPL LTD	7,039	762.20	5,365,125.80
	VEDANTA LTD	18,209	295.90	5,388,043.10
	ADANI ENTERPRISES LTD	4,200	1,460.00	6,132,000.00
	BHARAT ELECTRONICS LTD	19,000	174.10	3,307,900.00
	HAVELLS INDIA LTD	2,780	1,234.15	3,430,937.00
	LARSEN & TOUBRO LTD	10,871	1,632.85	17,750,712.35
	SIEMENS LTD	766	2,226.70	1,705,652.20
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	8,215	705.40	5,794,861.00
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	673.45	2,766,532.60
	INTERGLOBE AVIATION LTD	1,299	1,697.45	2,204,987.55
	BAJAJ AUTO LTD	1,141	3,833.05	4,373,510.05
	BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	2,276.70	2,766,190.50
BHARAT FORGE LTD	3,030	802.90	2,432,787.00	
EICHER MOTORS LTD	2,214	2,589.65	5,733,485.10	
HERO MOTOCORP LTD	1,947	2,763.60	5,380,729.20	

MAHINDRA & MAHINDRA LTD	13,839	791.35	10,951,492.65
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,145	6,840.10	14,672,014.50
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	18,232	214.30	3,907,117.60
MRF LTD	27	79,347.15	2,142,373.05
TATA MOTORS LTD	26,597	293.35	7,802,229.95
PAGE INDUSTRIES LTD	97	30,823.90	2,989,918.30
TITAN CO LTD	5,705	1,880.30	10,727,111.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,121	4,040.40	4,529,288.40
INFO EDGE INDIA LTD	1,257	5,482.10	6,890,999.70
TRENT LTD	2,541	900.75	2,288,805.75
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,611	3,650.60	9,531,716.60
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,600	3,720.75	5,953,200.00
ITC LTD	47,218	208.95	9,866,201.10
NESTLE INDIA LTD	540	18,911.00	10,211,940.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	9,657	841.40	8,125,399.80
UNITED SPIRITS LTD	4,926	724.45	3,568,640.70
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	1,685	1,668.75	2,811,843.75
DABUR INDIA LTD	9,014	597.40	5,384,963.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	5,380	1,005.20	5,407,976.00
HINDUSTAN UNILEVER LTD	12,917	2,486.05	32,112,307.85
MARICO LTD	7,098	523.70	3,717,222.60
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,657	4,787.90	7,933,550.30
AUROBINDO PHARMA LTD	4,816	721.65	3,475,466.40
BIOCON LTD	5,970	370.00	2,208,900.00
CIPLA LTD	7,779	908.85	7,069,944.15
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,117	4,910.45	10,395,422.65
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,854	4,687.05	8,689,790.70
IPCA LABORATORIES LTD	1,001	2,444.35	2,446,794.35
LUPIN LTD	3,463	972.80	3,368,806.40
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	13,422	782.90	10,508,083.80
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	3,052.25	2,661,562.00
AXIS BANK LTD	35,514	754.40	26,791,761.60
BANDHAN BANK LTD	9,895	290.35	2,873,013.25
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	26,702	2,710.75	72,382,446.50
ICICI BANK LTD	79,821	688.30	54,940,794.30

KOTAK MAHINDRA BANK LTD	8,749	1,749.70	15,308,125.30	
STATE BANK OF INDIA	28,263	419.70	11,861,981.10	
YES BANK LTD	141,484	11.30	1,598,769.20	
BAJAJ FINANCE LTD	4,258	6,544.10	27,864,777.80	
BAJAJ FINSERV LTD	619	15,006.35	9,288,930.65	
CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,200	506.75	3,141,850.00	
HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	710	2,995.90	2,127,089.00	
MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,479.40	2,683,631.60	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,715	2,701.50	4,633,072.50	
REC LTD	14,000	148.05	2,072,700.00	
SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	3,000	1,010.75	3,032,250.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	2,737	1,293.85	3,541,267.45	
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	12,966	671.05	8,700,834.30	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	3,638	1,484.40	5,400,247.20	
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	680.70	4,105,301.70	
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	6,379	1,114.05	7,106,524.95	
DLF LTD	9,206	327.10	3,011,282.60	
HCL TECHNOLOGIES LTD	17,122	1,134.25	19,420,628.50	
INFOSYS LTD	53,107	1,733.45	92,058,329.15	
LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	4,981.80	3,726,386.40	
TATA CONSULTANCY SVCS LTD	14,446	3,560.55	51,435,705.30	
TECH MAHINDRA LTD	10,014	1,412.50	14,144,775.00	
WIPRO LTD	21,755	629.40	13,692,597.00	
BHARTI AIRTEL LTD	38,516	622.95	23,993,542.20	
INDUS TOWERS LTD	8,128	218.60	1,776,780.80	
ADANI GREEN ENERGY LTD	5,571	942.50	5,250,667.50	
ADANI TOTAL GAS LTD	4,100	1,021.80	4,189,380.00	
ADANI TRANSMISSION LTD	4,100	1,075.20	4,408,320.00	
GAIL INDIA LTD	24,471	145.60	3,562,977.60	
INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	528.10	2,490,519.60	
NTPC LTD	78,280	116.55	9,123,534.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	50,784	180.60	9,171,590.40	
インドルピー 小計	1,288,625		1,039,576,276.65 (1,548,968,652)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	6,400	18.09	115,776.00

	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.03	112,449.78
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	1.93	146,810.75
	INDUSTRIES QATAR	23,913	13.09	313,021.17
	COMMERCIAL BANK PQSC	33,159	5.90	195,638.10
	MASRAF AL RAYAN	59,948	4.48	268,866.78
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	9,378	9.52	89,278.56
	QATAR ISLAMIC BANK	18,726	18.03	337,629.78
	QATAR NATIONAL BANK	71,025	19.18	1,362,259.50
	BARWA REAL ESTATE CO	24,730	3.08	76,168.40
	OOREDOO QPSC	12,412	7.00	86,884.00
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	16.92	137,018.16
	カタールリアル 小計	380,672		3,241,800.98 (97,156,775)
南アフリカラン ド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	172.65	726,338.55
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	276.43	452,515.91
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	852	1,577.15	1,343,731.80
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	6,642	241.22	1,602,183.24
	GOLD FIELDS LTD	14,144	134.27	1,899,114.88
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	6,895	54.02	372,467.90
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	12,499	221.80	2,772,278.20
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	615.63	656,877.21
	NORTHAM PLATINUM LTD	4,980	201.85	1,005,213.00
	SASOL LTD	8,982	197.08	1,770,172.56
	SIBANYE STILLWATER LTD	44,383	58.25	2,585,309.75
	BIDVEST GROUP LTD	4,193	202.14	847,573.02
	MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	117.97	720,560.76
	MR PRICE GROUP LTD	3,738	234.60	876,934.80
	NASPERS LTD-N SHS	3,384	2,379.71	8,052,938.64
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	16,364	60.08	983,149.12
	BID CORP LTD	5,393	320.00	1,725,760.00
	CLICKS GROUP LTD	3,433	295.61	1,014,829.13
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	8,180	166.99	1,365,978.20
	SPAR GROUP LIMITED/THE	2,541	200.47	509,394.27
TIGER BRANDS LTD	2,099	187.41	393,373.59	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	6,295	187.86	1,182,578.70	

	ABSA GROUP LTD	11,483	150.36	1,726,583.88	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,171	1,826.72	2,139,089.12	
	NEDBANK GROUP LTD	5,252	172.28	904,814.56	
	STANDARD BANK GROUP LTD	20,435	136.24	2,784,064.40	
	FIRSTRAND LTD	79,568	59.19	4,709,629.92	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,213	284.47	629,532.11	
	REMGRO LTD	8,773	114.10	1,000,999.30	
	DISCOVERY LTD	7,125	127.88	911,145.00	
	OLD MUTUAL LTD	76,960	14.04	1,080,518.40	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	32.19	322,350.66	
	SANLAM LTD	30,241	63.59	1,923,025.19	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	5,969	102.55	612,120.95	
	MTN GROUP LTD	26,706	132.90	3,549,227.40	
	VODACOM GROUP LTD	9,434	138.91	1,310,476.94	
	南アフリカランド 小計	463,360		56,462,851.06	(407,097,156)
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	36,436	4.48	163,233.28	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,749	7.47	334,275.03	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	5.50	112,051.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	20,440	5.06	103,426.40	
	EMIRATES NBD PJSC	40,014	13.50	540,189.00	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	68,484	16.82	1,151,900.88	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	63,815	4.12	262,917.80	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	49,173	4.08	200,625.84	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	27,455	24.18	663,861.90	
	アラブディルハム 小計	370,939		3,532,481.63	(105,868,474)
クウェートディナール	AGILITY	18,700	0.99	18,625.20	
	BOUBYAN BANK K.S.C	14,451	0.78	11,300.68	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	73,529	0.80	59,190.84	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	107,400	0.89	96,230.40	
	MABANEE CO KPSC	7,811	0.73	5,748.89	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,345	0.59	21,136.31	
	クウェートディナール 小計	257,236		212,232.32	(77,611,237)

オフショア人民 元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,400	3.98	9,552.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	3.95	128,375.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	17.39	95,645.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	5.11	17,374.00	
	GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	4.74	5,214.00	
	OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.22	2,110.00	
	PETROCHINA CO LTD-A	21,700	4.44	96,348.00	
	SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	10.72	101,840.00	
	SHANXI COKING COAL ENERGY-A	520	8.71	4,529.20	
	SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	13.05	3,915.00	
	SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	12.62	46,694.00	
	YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	35.54	31,986.00	
	YANZHOU COAL MINING CO-A	991	16.66	16,510.06	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	5.88	74,676.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	41.25	160,875.00	
	ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	56.12	28,060.00	
	BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	18,900	8.41	158,949.00	
	BBMG CORPORATION-A	900	2.66	2,394.00	
	CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	14.92	35,808.00	
	CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	17.69	58,624.66	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	6.74	115,928.00	
	CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	41.28	144,480.00	
	GEM CO LTD-A	3,500	11.70	40,950.00	
	GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	31.55	15,775.00	
	GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	124.80	148,512.00	
	HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	28.69	164,106.80	
	HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	11.49	22,405.50	
	HESTEEL CO LTD-A	1,500	2.81	4,215.00	
	HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	12.20	56,120.00	
	HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	19.11	21,021.00	
	HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	7.37	25,795.00	
	INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	2.56	113,408.00	
	INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	5.00	17,500.00	
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	25.50	81,600.00		
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	6.93	13,167.00		

JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	126.30	37,890.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	91.66	45,830.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	22.86	45,720.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	177.66	195,426.00
KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	20.23	64,736.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	32.00	54,400.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	18.40	34,960.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	16.34	99,674.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	3.09	22,248.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	19.04	191,352.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	17.55	60,863.40
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	33.89	61,679.80
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	5.53	55,300.00
SHANDONG SINOCERA FUNCTION-A	800	45.93	36,744.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	11.61	25,542.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	155.98	112,305.60
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	8.52	40,896.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	22.82	38,794.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	114.20	68,520.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	28.18	61,996.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	3.21	1,926.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	155.13	86,872.80
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	12.81	14,091.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	25.52	38,280.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	1,500	3.60	5,400.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	7.52	9,776.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,000	106.98	320,940.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	82.43	32,972.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	26.38	31,656.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	8.93	21,253.40
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	15.08	46,748.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	900	258.30	232,470.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	130.88	151,820.80
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	11.66	26,818.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	12.86	41,152.00

ZHEJIANG SATELLITE PETROCH-A	1,680	41.86	70,324.80
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4,700	8.08	37,976.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	17,700	10.34	183,018.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	24.67	24,670.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	64.95	162,375.00
AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	11.45	34,350.00
AVICOPTER PLC-A	500	67.18	33,590.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	36.70	51,380.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	96.46	38,584.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	17.86	78,584.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	500	10.10	5,050.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	5.33	114,062.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	29,800	4.70	140,060.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,200	503.00	1,106,600.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	15.44	9,264.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,820	103.48	188,333.60
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	9.81	4,090.77
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	53.16	53,160.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	191.80	76,720.00
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	36.86	73,720.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	42.69	25,614.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	65.30	19,590.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	1,036	102.19	105,868.84
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	8.12	21,112.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	3.86	84,148.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,000	18.45	73,800.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	4,246	30.82	130,861.72
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	23,000	6.05	139,150.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	34.00	68,000.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	8,200	28.26	231,732.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	2.68	15,008.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.37	45,448.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	71.19	192,213.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	9,000	6.62	59,580.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	137.17	205,755.00

SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	41.29	53,677.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	7.06	2,824.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	686.00	109,760.00
TBEA CO LTD-A	2,100	16.45	34,545.00
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	17.38	15,642.00
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	19.67	116,053.00
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	247.45	123,725.00
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	6.39	49,203.00
XIAMEN C & D INC-A	300	7.30	2,190.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	12.98	44,132.00
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	42.78	41,924.40
YUTONG BUS CO LTD-A	200	11.79	2,358.00
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	5.94	31,482.00
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	50.60	101,200.00
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	67.46	28,333.20
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	121.22	96,976.00
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	24.13	72,148.70
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	21.04	27,352.00
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	22.44	89,760.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	8.09	51,776.00
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	7.22	18,772.00
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	73.30	58,640.00
AIR CHINA LTD-A	6,400	7.10	45,440.00
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	40,800	4.47	182,376.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.74	51,192.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.65	51,415.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	20.79	267,567.30
S F HOLDING CO LTD-A	4,300	57.74	248,282.00
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	39.86	39,860.00
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	5.11	45,479.00
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	4.54	9,080.00
SPRING AIRLINES CO LTD-A	900	51.64	46,476.00
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	9.22	36,880.00
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	14.30	16,731.00
BYD CO LTD -A	1,600	293.72	469,952.00

CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	187.69	37,538.00
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	22.42	134,968.40
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	11.11	35,552.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	48.39	91,941.00
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	1,600	57.21	91,536.00
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	21.11	63,330.00
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	23.33	51,326.00
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	24.12	28,944.00
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	37.97	30,376.00
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	18.75	129,562.50
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	9.10	28,210.00
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	36.18	47,034.00
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	21.93	2,193.00
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	177.88	106,728.00
GUANGDONG XINBAO ELECTRICA-A	800	23.06	18,448.00
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	26.84	152,988.00
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	31.56	34,716.00
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	41.84	41,840.00
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	92.38	46,190.00
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	74.20	59,360.00
JOYOUNG CO LTD -A	600	24.78	14,868.00
MIDEA GROUP CO LTD-A	3,200	71.94	230,208.00
NAVINFO CO LTD-A	900	12.46	11,214.00
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	148.91	80,411.40
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	5.72	25,740.00
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	19.94	7,976.00
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	7.41	104,481.00
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	36.80	18,768.00
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	9.24	3,696.00
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	52.04	15,612.00
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	11.25	11,250.00
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	45.52	27,312.00
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	7.05	58,515.00
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	13.56	14,644.80
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	9.17	11,921.00

CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	8.19	1,638.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	7.41	89,661.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	417.80	41,780.00	
GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	10.58	2,116.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	16.29	13,032.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	2.34	9,594.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	1,310	55.30	72,443.00	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	9.05	9,955.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	15.02	20,277.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	17.80	16,020.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	5.49	16,470.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,900	236.09	448,571.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	22.13	4,426.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	11.04	55,200.00	
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	5.43	49,413.00	
WANGFUJING GROUP CO LTD-A	800	26.64	21,312.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	6.30	37,800.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	49.38	35,553.60	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	52.57	14,719.60	
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	1,700	14.34	24,378.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	55.33	30,210.18	
YIXINTANG PHARMACEUTICAL G-A	600	33.39	20,034.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	4.07	12,617.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	46.78	32,746.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	198.00	59,400.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	54.57	27,285.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	7.69	3,845.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	32.54	19,524.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.34	15,216.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	41.46	16,584.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	155.87	62,348.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	30.20	21,140.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	3,390	110.42	374,323.80	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	169.99	67,996.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	19.57	17,613.00	

GUANGDONG HAID GROUP CO-A	1,300	66.52	86,476.00
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	14.60	36,500.00
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	24.98	59,952.00
INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	5,900	33.38	196,942.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	42.49	42,490.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	169.97	237,958.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	9.17	18,340.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	209.15	83,660.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	33.64	10,092.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	68.80	20,640.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,200	1,619.97	1,943,964.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,400	176.82	247,548.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,016	44.88	225,118.08
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	11.72	30,472.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	800	20.53	16,424.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	78.85	77,273.00
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,120	299.11	335,003.20
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	120.80	48,320.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	31.78	22,246.00
TONGWEI CO LTD-A	4,400	49.02	215,688.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	90.30	81,270.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	13.11	74,202.60
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	3,600	222.65	801,540.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	900	70.49	63,441.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	19.56	21,516.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	27.91	36,283.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	21.62	21,620.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	182.85	18,285.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	51.08	30,648.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	50.07	278,639.55
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	61.20	38,556.00
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	31.03	12,412.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	127.25	89,075.00
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	390	51.30	20,007.00
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	38.99	67,842.60

INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	104.99	31,497.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	54.93	64,817.40
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	37.70	18,850.00
JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	14.54	2,908.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	26.17	18,319.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.51	3,604.80
OVCTEK CHINA INC-A	920	82.79	76,166.80
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	32.90	19,740.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	19.05	38,100.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,100	335.27	368,797.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	301.66	90,498.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	13.67	14,216.80
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	33.48	30,132.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	352.75	70,550.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	35.07	37,875.60
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	84.30	25,290.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	103.15	30,945.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	285.00	114,000.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	24.31	2,431.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	1,500	151.10	226,650.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	19.79	18,998.40
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	30.73	3,073.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	30.79	43,106.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	147.18	44,154.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	36.40	64,792.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	24.58	34,412.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	6,116	53.84	329,285.44
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	16.75	16,750.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.95	19,120.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	137.93	77,240.80
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	39.74	19,870.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	32.85	32,850.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	30.40	25,688.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	193.19	135,233.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	18.69	4,859.40

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	67.50	128,250.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.25	21,025.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	16.30	14,670.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	136.32	81,792.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	26.14	2,614.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	17.81	24,934.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	17.82	3,564.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	10.74	2,148.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	81.06	121,590.00
WUXI APPTec CO LTD-A	2,328	130.75	304,386.00
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	15.56	15,560.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	92.08	101,288.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	600	378.34	227,004.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	17.99	21,767.90
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	48.80	63,440.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	28.79	61,495.44
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	58.94	23,576.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	2.94	208,446.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.36	81,532.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	11.00	16,500.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.02	101,472.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.38	164,250.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	13.50	78,300.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.74	100,426.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	9.01	80,189.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	5,000	35.25	176,250.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.26	98,808.60
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	5.93	54,556.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	3.39	118,311.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	19,300	51.58	995,494.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	4.01	119,498.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.61	61,009.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.83	32,555.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.57	68,511.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	58,300	4.64	270,512.00

INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	18,000	18.55	333,900.00	
PING AN BANK CO LTD-A	17,400	20.34	353,916.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	21,100	5.15	108,665.00	
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.93	20,829.00	
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	27,500	9.23	253,825.00	
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	3.92	3,528.00	
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	15.27	45,810.00	
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	10.52	15,780.00	
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.44	50,592.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.33	28,924.00	
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	11.74	35,220.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	53.90	64,680.00	
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	18.16	121,672.00	
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	24.64	273,504.00	
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	29.35	146,750.00	
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	11.11	2,222.00	
EAST MONEY INFORMATION CO-A	10,104	32.08	324,136.32	
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	15.76	50,432.00	
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	6.75	3,375.00	
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.60	61,920.00	
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	20.29	119,711.00	
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	2,400	11.74	28,176.00	
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	14.04	30,888.00	
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	11.56	53,176.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	17.54	121,026.00	
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	7.56	3,780.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	11.97	106,533.00	
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	116.15	58,075.00	
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.31	2,124.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	5,500	16.13	88,715.00	
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.86	2,958.00	
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	10.99	73,633.00	
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	11.27	18,032.00	
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	8.42	25,260.00	
ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	16.22	84,344.00	

PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.22	10,304.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	8.82	48,263.04
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.11	10,275.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.63	2,652.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	4.64	126,208.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	11.35	48,805.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	10.20	3,060.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.10	19,380.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	4.41	18,963.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.20	4,100.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	12.04	15,652.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	29.15	72,875.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	27.19	182,173.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	3.45	2,070.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	40.57	77,083.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	5.15	18,025.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	10,200	53.71	547,842.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	12.67	8,869.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	9.99	79,920.00
CHINA VANKE CO LTD -A	8,900	23.15	206,035.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	5.83	2,332.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	35.77	85,848.00
GEMDALE CORP-A	3,300	11.00	36,300.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.43	66,051.30
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	5.08	15,748.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.95	3,465.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	11.80	151,040.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	5.04	3,024.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	15.48	26,006.40
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	16.80	15,120.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	4.54	15,436.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.44	19,964.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.56	59,280.00
ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.31	11,781.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	4,000	12.02	48,080.00

BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	28.30	13,584.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	18.22	2,550.80
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	15.35	10,745.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	52.33	10,466.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	16.28	11,396.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	7.05	2,820.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	964	55.76	53,752.64
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	52.40	131,000.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	26.57	21,256.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	263.90	105,560.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	520	67.39	35,042.80
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	126.77	38,031.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	2,308	36.15	83,434.20
ADDSINO CO LTD -A	1,700	22.20	37,740.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	34.30	78,890.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	45.19	22,595.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	168.58	33,716.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	34,300	5.78	198,254.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	41.50	74,700.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	15.45	40,170.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.08	55,880.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	19.44	21,384.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.85	84,135.00
GOERTEK INC -A	3,300	39.28	129,624.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	10.28	22,616.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	7.09	48,921.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	9.88	2,964.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	117.02	58,510.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	27.75	27,750.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	30.26	18,156.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	24.32	111,872.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	8.72	20,056.00
LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6,733	37.70	253,834.10
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	429.84	154,742.40
NINESTAR CORP-A	100	34.85	3,485.00

OFILM GROUP CO LTD-A	400	7.59	3,036.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	115.00	80,500.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	1,000	25.36	25,360.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	95.40	26,712.00
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	16.96	16,960.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	36.49	29,192.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	25.54	22,986.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	19.25	13,475.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	44.92	31,444.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	14.48	34,752.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	25.02	46,937.52
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	13.82	17,966.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	103.12	123,744.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	29.07	55,349.28
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	8.14	20,350.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	12.35	21,736.00
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	75.33	48,211.20
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	87.01	78,309.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	20.49	49,176.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	38.55	19,275.00
ZTE CORP-A	3,800	36.29	137,902.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	4,300	5.10	21,930.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,900	19.92	456,168.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	18.08	34,352.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	3.45	4,485.00
HUANENG POWER INTL INC-A	800	4.65	3,720.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	8.89	58,674.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	6.23	4,361.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	7.95	4,770.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	11.26	58,552.00
FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	45.50	50,050.00
GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.82	20,726.00
GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	167.02	126,267.12
HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	125.24	150,288.00
HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	58.10	116,200.00

	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	153.84	61,536.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	54.09	64,908.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	34.35	65,265.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	4,940	80.39	397,126.60	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	57.29	40,905.06	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	362.48	181,240.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	36.96	162,624.00	
	SG MICRO CORP-A	150	337.95	50,692.50	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	108.13	27,032.50	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	186.90	56,070.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	2,300	46.61	107,203.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	12.50	23,750.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	20.05	16,040.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	196.32	98,160.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	264.99	211,992.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	60.49	54,441.00	
	オフショア人民元 小計	1,894,735		37,344,814.82 (631,680,073)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	23.40	91,985.40	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	34,823	34.95	1,217,063.85	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	72.50	136,227.50	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	3,782	20.86	78,892.52	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	45.10	90,200.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,497	124.00	433,628.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	5,474	33.60	183,926.40	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	6,999	69.80	488,530.20	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	14,155	121.60	1,721,248.00	
	SAUDI CEMENT	1,265	63.40	80,201.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	35.45	105,747.35	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	10,947	18.56	203,176.32	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	3,639	68.10	247,815.90	
	JARIR MARKETING CO	911	204.40	186,208.40	
	ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	406	114.00	46,284.00	
	ALMARAI CO	4,232	55.90	236,568.80	
	SAVOLA	4,558	39.20	178,673.60	

DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	183.00	143,838.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	749	197.40	147,852.60	
AL RAJHI BANK	19,204	122.20	2,346,728.80	
ALINMA BANK	16,108	22.44	361,463.52	
ARAB NATIONAL BANK	8,707	22.30	194,166.10	
BANK AL-JAZIRA	5,356	18.58	99,514.48	
BANK ALBILAD	5,393	42.10	227,045.30	
BANQUE SAUDI FRANSI	9,664	40.50	391,392.00	
RIYAD BANK	21,695	27.45	595,527.75	
SAUDI BRITISH BANK	11,978	34.20	409,647.60	
THE SAUDI NATIONAL BANK	34,421	59.00	2,030,839.00	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	156.80	125,440.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	661	95.20	62,927.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	8,367	10.22	85,510.74	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	12.46	53,515.70	
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	31.60	176,454.40	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	5,200	13.80	71,760.00	
SAUDI TELECOM CO	9,462	131.20	1,241,414.40	
SAUDI ELECTRICITY CO	12,359	26.45	326,895.55	
サウジアラビアリアル 小計	286,270		14,818,310.38 (434,917,409)	
合 計	38,441,579		13,128,879,004 (13,128,879,004)	

(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	971,876.00	
	メキシコペソ 小計		45,800	971,876.00 (5,299,931)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	48,594	747,375.72	
	南アフリカランド 小計		48,594	747,375.72 (5,388,578)	

合計		10,688,509	
		(10,688,509)	

(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%		8.9%
メキシコペソ	株式 22銘柄	98.0%		1.9%
	投資証券 1銘柄		2.0%	0.0%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	100.0%		5.0%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%		0.5%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
ユーロ	株式 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%		0.3%
チェココルナ	株式 3銘柄	100.0%		0.1%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	100.0%		0.3%
ポーランドズロチ	株式 14銘柄	100.0%		0.8%
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%		23.9%
マレーシアリングgit	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%		1.3%
韓国ウォン	株式 103銘柄	100.0%		13.2%
新台湾ドル	株式 87銘柄	100.0%		14.5%
インドルピー	株式 101銘柄	100.0%		11.8%
カタールリアル	株式 12銘柄	100.0%		0.7%
南アフリカランド	株式 36銘柄	98.7%		3.1%
	投資証券 1銘柄		1.3%	0.0%
アラブディルハム	株式 9銘柄	100.0%		0.8%
クウェートディナール	株式 6銘柄	100.0%		0.6%

オフショア人民元	株式	471銘柄	100.0%		4.8%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%		3.3%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	440,263,589
投資証券	31,829,864,800
未収配当金	168,039,832
差入委託証拠金	20,608,000
流動資産合計	32,458,776,221
資産合計	32,458,776,221
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	683,240
前受金	349,000
未払金	212,481,150
未払解約金	8,763,000
未払利息	1,194
その他未払費用	1,577
流動負債合計	222,279,161
負債合計	222,279,161
純資産の部	
元本等	
元本	21,134,985,630
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,101,511,430
元本等合計	32,236,497,060
純資産合計	32,236,497,060
負債純資産合計	32,458,776,221

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 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	16,103,147,715円
期中追加設定元本額	21,908,599,106円
期中一部解約元本額	16,876,761,191円
期末元本額	21,134,985,630円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	830,830,430円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	709,202,965円
りそなラップ型ファンド(成長型)	610,801,098円
DCりそな グローバルバランス	17,524,632円
つみたてバランスファンド	1,049,318,538円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	157,208,821円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	85,800,029円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	54,310,821円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	14,694,172円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	9,613,462円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,184,005円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	7,210,734円
リスクコントロール・オープン	2,406,558円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	77,726,408円
FWりそな国内リートインデックスオープン	4,349,502,705円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,476,760,579円
Smart-i Jリートインデックス	2,532,808,199円
Smart-i 8資産バランス 安定型	28,006,741円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	73,325,003円
Smart-i 8資産バランス 成長型	84,210,670円

りそな・リスクコントロールファンド2019-06	132,524,683円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	246,089,867円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	145,316,059円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	106,318,086円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	121,083,215円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	20,689,666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)	1,553,772円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,033,333,853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)	2,352,179,478円
2. 計算日における受益権の総数	21,134,985,630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	1.5253円
(10,000口当たり純資産額)	(15,253円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20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 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		3,245,637,254
合計		3,245,637,254

（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 8月20日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	不動産投信指数先物取引				
	買建	389,291,240	-	388,608,000	683,240
合計		389,291,240	-	388,608,000	683,240

(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ではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(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	549	76,640,400	
	サンケイリアルエステート投資法人	668	87,641,600	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,145	203,695,500	
	東海道リート投資法人	209	22,488,400	
	日本アコモデーションファンド投資法人	942	629,256,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,209	513,440,000	
	産業ファンド投資法人	3,874	836,396,600	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,728	998,448,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,864	438,226,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,367	644,540,500	
	G L P 投資法人	8,837	1,765,632,600	

コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,229	427,692,000	
日本プロロジスリート投資法人	4,323	1,660,032,000	
星野リゾート・リート投資法人	421	290,911,000	
Oneリート投資法人	425	143,862,500	
イオンリート投資法人	3,209	484,559,000	
ヒューリックリート投資法人	2,399	454,850,400	
日本リート投資法人	842	371,743,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,340	392,924,400	
積水ハウス・リート投資法人	8,026	764,877,800	
トーセイ・リート投資法人	570	80,313,000	
ケネディクス商業リート投資法人	1,089	320,166,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人	582	87,474,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人	618	73,789,200	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,824	1,523,022,400	
いちごホテルリート投資法人	452	38,736,400	
ラサールロジポート投資法人	3,340	652,302,000	
スターアジア不動産投資法人	2,820	164,406,000	
マリモ地方創生リート投資法人	256	33,177,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,014	640,848,000	
大江戸温泉リート投資法人	440	34,760,000	
投資法人みらい	3,111	167,994,000	
森トラスト・ホテルリート投資法人	640	82,816,000	
三菱地所物流リート投資法人	693	354,123,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	936	202,831,200	
ザイマックス・リート投資法人	396	47,163,600	
タカラレーベン不動産投資法人	866	104,612,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,064	173,112,800	
日本ビルファンド投資法人	3,092	2,189,136,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,729	1,825,701,000	
日本都市ファンド投資法人	13,768	1,466,292,000	
オリックス不動産投資法人	5,437	1,093,924,400	
日本プライムリアルティ投資法人	1,793	736,026,500	
NTT都市開発リート投資法人	2,465	382,321,500	
東急リアル・エステート投資法人	1,829	348,241,600	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,895	233,843,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,143	954,007,900	

森トラスト総合リート投資法人	1,950	297,375,000	
インヴィンシブル投資法人	12,010	473,194,000	
フロンティア不動産投資法人	957	456,010,500	
平和不動産リート投資法人	1,768	301,797,600	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,783	609,786,000	
福岡リート投資法人	1,411	252,710,100	
ケネディクス・オフィス投資法人	844	661,696,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,236	215,550,400	
大和証券オフィス投資法人	577	438,520,000	
阪急阪神リート投資法人	1,233	201,225,600	
スタートプロシード投資法人	425	110,202,500	
大和ハウスリート投資法人	3,893	1,280,797,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,359	511,570,800	
大和証券リビング投資法人	3,569	435,061,100	
ジャパンエクセレント投資法人	2,532	365,367,600	
合計	174,015	31,829,864,800	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国リートマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 8月20日現在

資産の部	
流動資産	
預金	128,804,669
コール・ローン	252,371,699
株式	91,220,454
投資証券	25,953,789,230
派生商品評価勘定	26,526

2021年 8月20日現在

未収入金	22,276,251
未収配当金	50,848,021
流動資産合計	26,499,336,850
資産合計	26,499,336,850
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	596,437
未払金	353,466,295
未払解約金	132,000
未払利息	684
その他未払費用	330
流動負債合計	354,195,746
負債合計	354,195,746
純資産の部	
元本等	
元本	19,584,896,436
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,560,244,668
元本等合計	26,145,141,104
純資産合計	26,145,141,104
負債純資産合計	26,499,336,850

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 8月20日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月25日
期首元本額	22,332,515,594円
期中追加設定元本額	18,840,235,093円
期中一部解約元本額	21,587,854,251円
期末元本額	19,584,896,436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）	1,177,639,340円
りそなラップ型ファンド（成長型）	959,241,152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	593,205,702円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	361,120,143円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	196,544,746円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	124,258,453円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	34,222,256円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	22,286,479円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	11,886,951円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	16,550,880円
リスクコントロール・オープン	10,980,157円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	181,979,669円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,291,112,664円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,110,381,117円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,805,661,665円
Smart-i 8資産バランス 安定型	65,330,027円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	167,972,475円
Smart-i 8資産バランス 成長型	192,921,710円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	304,069,555円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	568,942,816円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	336,780,709円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	245,154,377円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	278,803,641円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	47,980,699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）	1,119,387,806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	19,584,896,436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	1.3350円
(10,000口当たり純資産額)	(13,350円)

(注) は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

2021年 8月20日現在	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 これらは、株価変動リスク、リートの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 デリバティブ取引等を行った場合は、信託約款に記載した目的で取引を行っております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。 また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。

金融商品の時価等に関する事項

2021年 8月20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 8月20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 8月20日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		12,372,222
投資証券		3,669,195,611
合計		3,681,567,833

(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 8月20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	250,784,021	-	250,214,110	569,911	
	米ドル	172,613,688	-	172,522,904	90,784	
	カナダドル	5,812,926	-	5,744,392	68,534	
	ユーロ	16,321,145	-	16,304,615	16,530	
	英ポンド	20,085,652	-	19,936,327	149,325	
	オーストラリアドル	22,226,680	-	22,007,748	218,932	
シンガポールドル	13,723,930	-	13,698,124	25,806		

合計	250,784,021	-	250,214,110	569,911
----	-------------	---	-------------	---------

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものではありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BROADSTONE NET LEASE INC-A	23,530	25.91	609,662.30	
米ドル 小計		23,530		609,662.30 (66,995,790)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	92,276	3.34	308,201.84	
オーストラリアドル 小計		92,276		308,201.84 (24,224,664)	
合計		115,806		91,220,454 (91,220,454)	

(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	260,925.14	
		AGREE REALTY CORP	10,639	789,520.19	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,826	214,030.02	
		ALEXANDER'S INC	282	75,542.16	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,187	4,347,360.53	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,448	279,821.36	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,174	1,025,668.56	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	17,753	147,882.49	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	42,376	1,724,703.20	
		AMERICOLD REALTY TRUST	39,120	1,458,784.80	
		APARTMENT INCOME REIT CO	24,311	1,216,522.44	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,021	154,695.24	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	32,743	472,481.49	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	10,442	134,075.28	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,543	4,824,554.85	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	38,919.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	21,974	2,480,205.38	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	27,094	363,059.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	45,365	1,018,444.25	
		BRT APARTMENTS CORP	877	16,101.72	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	14,933	2,194,553.68	
		CARETRUST REIT INC	14,780	316,144.20	
		CENTERSPACE	2,032	199,440.80	
		CHATHAM LODGING TRUST	6,046	67,957.04	
		CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	14,320.00	
		CITY OFFICE REIT INC	5,694	73,281.78	
		CLIPPER REALTY INC	1,350	10,381.50	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,563	316,313.52	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,585	170,681.85	
		COREPOINT LODGING INC	4,988	66,739.44	
		CORESITE REALTY CORP	6,558	956,418.72	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,384	493,705.60	
		COUSINS PROPERTIES INC	23,163	888,764.31	
CTO REALTY GROWTH INC	900	47,745.00			
CUBESMART	30,799	1,570,749.00			

CYRUSONE INC	18,740	1,410,747.20
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,908	263,879.16
DIGITAL REALTY TRUST INC	43,417	7,072,629.30
DIGITALBRIDGE GROUP INC	76,416	508,930.56
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,684	134,233.48
DOUGLAS EMMETT INC	25,741	822,682.36
DUKE REALTY CORP	57,928	2,931,736.08
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	13,400	291,450.00
EASTGROUP PROPERTIES INC	6,134	1,071,732.48
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,548	220,005.08
EPR PROPERTIES	11,436	539,893.56
EQUINIX INC	13,808	11,515,319.68
EQUITY COMMONWEALTH	18,850	494,624.00
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,214	2,183,101.92
EQUITY RESIDENTIAL	53,107	4,374,954.66
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	18,166	551,156.44
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,038	3,198,608.70
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,646	3,644,019.00
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	37,413.32
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,991	1,266,822.66
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,581	1,081,458.63
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,955	326,610.60
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12,675	60,459.75
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,816	1,596,791.52
GEO GROUP INC/THE	19,712	159,667.20
GETTY REALTY CORP	5,766	178,630.68
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,761	129,219.23
GLADSTONE LAND CORP	4,296	100,612.32
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,379	126,355.32
GLOBAL NET LEASE INC	15,494	266,961.62
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	22,066	659,552.74
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	33,968	1,007,490.88
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	83,241	2,925,921.15
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	50,256.90

HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,306	737,357.32	
HOST HOTELS & RESORTS INC	108,328	1,609,754.08	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	23,071	592,924.70	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,188	300,722.40	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,736	263,358.80	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,676	842,098.08	
INVITATION HOMES INC	87,651	3,525,323.22	
IRON MOUNTAIN INC	44,646	2,044,340.34	
JBG SMITH PROPERTIES	17,210	505,974.00	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	87,700	65,775.00	
KILROY REALTY CORP	16,129	1,049,675.32	
KIMCO REALTY CORP	93,070	1,960,984.90	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,509	234,293.57	
LEXINGTON REALTY TRUST	42,016	562,174.08	
LIFE STORAGE INC	11,901	1,432,642.38	
LTC PROPERTIES INC	5,856	201,153.60	
MACERICH CO/THE	26,440	406,118.40	
MACK-CALI REALTY CORP	12,808	222,603.04	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	156,849.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	89,825	1,765,959.50	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,679	3,328,778.91	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,510	275,690.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,775	1,252,266.75	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,979	661,719.96	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,995	414,313.85	
NETSTREIT CORP	3,551	91,118.66	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	103,413.60	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,640	219,310.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	187,854.96	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,022	1,179,360.28	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	67,079.20	
PARAMOUNT GROUP INC	24,691	216,540.07	
PARK HOTELS & RESORTS INC	35,881	624,688.21	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,727	397,893.59	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	18,080.66	

PHYSICIANS REALTY TRUST	32,660	604,210.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18,539	337,409.80	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	92,250.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,628	77,547.60	
PRIME US REIT	58,100	49,094.50	
PROLOGIS INC	114,042	15,184,692.30	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,163	481,250.45	
PUBLIC STORAGE	23,478	7,570,950.66	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	10,336	803,107.20	
REALTY INCOME CORP	57,703	4,128,072.62	
REGENCY CENTERS CORP	24,500	1,577,800.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,903	322,863.24	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	33,921	413,836.20	
RETAIL VALUE INC	2,135	54,784.10	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	20,519	1,254,736.85	
RLJ LODGING TRUST	26,131	353,291.12	
RPT REALTY	12,942	157,374.72	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,618	626,959.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,693	507,722.29	
SAFEHOLD INC	2,242	198,977.50	
SAUL CENTERS INC	2,130	96,936.30	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,880	83,790.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,427	268,509.12	
SIMON PROPERTY GROUP INC	50,701	6,513,050.46	
SITE CENTERS CORP	26,450	405,214.00	
SL GREEN REALTY CORP	10,513	741,271.63	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,780	876,020.60	
STAG INDUSTRIAL INC	24,788	1,036,386.28	
STORE CAPITAL CORP	37,795	1,324,336.80	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	17,091	144,931.68	
SUN COMMUNITIES INC	17,268	3,410,257.32	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,870	351,051.60	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,692	251,856.60	
TERRENO REALTY CORP	10,833	717,577.92	
UDR INC	45,876	2,431,428.00	

	UMH PROPERTIES INC	6,220	141,753.80
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,693	99,734.63
	URBAN EDGE PROPERTIES	16,309	295,355.99
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,952	74,258.08
	VENTAS INC	57,930	3,161,240.10
	VEREIT INC	35,506	1,771,749.40
	VICI PROPERTIES INC	82,908	2,426,717.16
	VORNADO REALTY TRUST	23,888	976,302.56
	WASHINGTON REIT	12,508	304,069.48
	WELLTOWER INC	64,416	5,416,097.28
	WHITESTONE REIT	5,243	48,864.76
	WP CAREY INC	27,251	2,102,142.14
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,546	282,490.60
	米ドル 小計	3,810,674	177,702,938.29 (19,527,775,888)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,835	419,954.50
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,346	95,728.62
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	44,905.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,575	164,092.50
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,806	761,957.00
	CHOICE PROPERTIES REIT	25,700	384,215.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,992	151,113.60
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,406	115,820.48
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,346	145,804.62
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,935	246,427.50
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	85,404.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,077	280,222.11
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,026	447,866.86
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	22,739	358,366.64
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	178,985.40
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	166,020.48
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,257	54,371.13
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	43,434.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,384	198,453.60
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	45,100.00

	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,837	517,024.53
	SLATE GROCERY REIT	2,561	34,291.79
	SLATE OFFICE REIT	4,169	22,304.15
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,562	315,275.70
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,930	276,572.70
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	40,237.50
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,574	183,283.12
	カナダドル 小計	269,429	5,777,232.53 (495,339,917)
ユーロ	AEDIFICA	5,390	657,580.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	27,825	498,902.25
	ALTAREA	598	117,208.00
	BEFIMMO	3,878	137,669.00
	CARE PROPERTY INVEST	4,207	117,796.00
	CARMILA	7,876	92,779.28
	COFINIMMO	4,480	628,096.00
	COVIVIO	7,455	588,348.60
	CROMWELL REIT EUR	43,440	109,468.80
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIE-CV	5,323	115,722.02
	GECINA SA	8,358	1,107,435.00
	HAMBORNER REIT AG	11,656	117,492.48
	HIBERNIA REIT PLC	105,660	138,203.28
	ICADE	4,944	365,856.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	27,560.71
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	40,253	374,352.90
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,876	98,450.40
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	68,224	107,111.68
	KLEPIERRE	30,491	619,577.12
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	43,852.99
	MERCIALYS	5,259	52,142.98
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	51,236	503,342.46
	MONTEA NV	1,597	188,765.40
	NSI NV	2,837	101,422.75
	RETAIL ESTATES	1,743	120,267.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,463	1,574,096.42
	VASTNED RETAIL NV	2,828	68,013.40

	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,741	801,017.42
	WERELDHAVE NV	6,360	86,241.60
	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,620	139,646.00
	ユーロ 小計	515,586	9,698,417.94 (1,245,082,895)
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	21,160.00
	ASSURA PLC	419,571	323,908.81
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,612	390,839.12
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	123,187	123,433.37
	BRITISH LAND CO PLC	143,240	737,113.04
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	131,258	222,351.05
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	103,528.47
	CUSTODIAN REIT PLC	53,561	54,739.34
	DERWENT LONDON PLC	17,491	647,167.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	98,564	96,986.97
	GCP STUDENT LIVING PLC	67,882	144,588.66
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	40,109	309,842.02
	HAMMERSON PLC	670,421	218,356.11
	HOME REIT PLC	35,027	40,281.05
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,357	63,549.83
	INTU PROPERTIES PLC	117,549	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	114,915	815,896.50
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	139,144	360,661.24
	LXI REIT PLC	100,508	144,128.47
	NEWRIVER REIT PLC	39,505	31,801.52
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	91,730	88,152.53
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	201,064	333,364.11
	REGIONAL REIT LTD	63,471	55,981.42
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,906	368,547.20
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	68,450	34,841.05
	SEGRO PLC	185,170	2,364,620.90
	SHAFTESBURY PLC	46,808	289,507.48
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	50,439.00
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	121,418	148,433.50
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	65,502.50

	TRITAX BIG BOX REIT PLC	261,402	607,498.24
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	116,460	93,517.38
	UNITE GROUP PLC	61,809	752,833.62
	WORKSPACE GROUP PLC	20,047	193,654.02
	英債券 小計	3,904,264	10,297,225.52 (1,543,554,105)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	62,398	207,785.34
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	94,449.93
	ARENA REIT	57,189	232,187.34
	AVENTUS GROUP	61,838	202,210.26
	BWP TRUST	77,963	316,529.78
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	76,573	300,931.89
	CENTURIA OFFICE REIT	49,819	125,543.88
	CHARTER HALL GROUP	71,538	1,211,853.72
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	88,884	459,530.28
	CHARTER HALL RETAIL REIT	76,733	288,516.08
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	42,983	156,028.29
	CROMWELL PROPERTY GROUP	282,409	252,756.05
	DEXUS/AU	165,349	1,749,392.42
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	76,285.25
	GOODMAN GROUP	259,841	5,854,217.73
	GPT GROUP	293,441	1,385,041.52
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	46,211	188,078.77
	HOME CONSORTIUM	29,930	175,689.10
	HOMECO DAILY NEEDS REIT	68,755	101,413.62
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	99,966.60
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	48,374	301,370.02
	IRONGATE GROUP	69,568	108,526.08
	MIRVAC GROUP	601,102	1,845,383.14
	NATIONAL STORAGE REIT	158,895	357,513.75
	RURAL FUNDS GROUP	63,091	162,774.78
	SCENTRE GROUP	804,558	2,051,622.90
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,342	444,133.14
	STOCKLAND	363,570	1,654,243.50
	VICINITY CENTRES	603,973	948,237.61
	WAYPOINT REIT LTD	117,252	325,960.56

	オーストラリアドル 小計	4,932,153	21,678,173.33 (1,703,904,423)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	135,240	217,736.40
	GOODMAN PROPERTY TRUST	174,709	451,622.76
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	226,618	265,143.06
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	173,901	290,414.67
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	63,535	208,077.12
	ニュージーランドドル 小計	774,003	1,432,994.01 (107,589,190)
香港ドル	CHAMPION REIT	294,000	1,287,720.00
	FORTUNE REIT	223,000	1,962,400.00
	LINK REIT	321,100	23,408,190.00
	PROSPERITY REIT	163,000	500,410.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	178,000	882,880.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	247,000	1,002,820.00
	香港ドル 小計	1,426,100	29,044,420.00 (409,816,766)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	58,500	87,165.00
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	184,100	165,690.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	510,000	1,575,900.00
	ASCOTT TRUST	298,296	301,278.96
	CAPITALAND CHINA TRUST	161,600	210,080.00
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	693,132	1,448,645.88
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	122,600	143,442.00
	EC WORLD REIT	50,000	40,750.00
	ESR REIT	392,600	188,448.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	92,916.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	43,498.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	213,700	493,647.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	68,187.00
	FRASERS LOGISTICS & COMMERC I	444,279	670,861.29
	IREIT GLOBAL	95,000	60,800.00
	KEPPEL DC REIT	191,300	487,815.00
	KEPPEL REIT	300,900	337,008.00
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	122,408.00

	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	55,124.20	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	344,100	712,287.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	298,500	868,635.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	446,000	923,220.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	325,300	325,300.00	
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	148,797.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	61,600	299,376.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	91,400	40,673.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,300	59,799.00	
	SPH REIT	164,700	146,583.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	237,500	144,875.00	
	SUNTEC REIT	329,100	477,195.00	
	シンガポールドル 小計	7,935,307	10,740,404.33 (865,461,780)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	15,000	99,600,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	22,320,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	94,860,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	25,026,040.00	
	LOTTE REIT CO LTD	15,761	90,940,970.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	46,965,595.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	40,663,540.00	
	韓国ウォン 小計	72,085	420,376,145.00 (39,515,357)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	25,765	465,573.55	
	イスラエルシェケル 小計	25,765	465,573.55 (15,748,909)	
合計			25,953,789,230 (25,953,789,230)	

(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%		0.3%
	投資証券	153銘柄		99.7%	74.9%
カナダドル	投資証券	27銘柄		100.0%	1.9%
ユーロ	投資証券	30銘柄		100.0%	4.8%
英ポンド	投資証券	34銘柄		100.0%	5.9%
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%
イスラエルシェケル	投資証券	1銘柄		100.0%	0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

2【ファンドの現況】

以下のファンドの現況は2021年 8月31日現在です。

【埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG】

【純資産額計算書】

資産総額	6,274,582,117円
負債総額	18,971,498円
純資産総額(-)	6,255,610,619円
発行済口数	5,565,746,410口
1口当たり純資産額(/)	1.1239円

(参考)

R M国内債券マザーファンド(埼玉重視型)

純資産額計算書

資産総額	1,059,982,822円
負債総額	100円
純資産総額(-)	1,059,982,722円
発行済口数	1,059,066,708口
1口当たり純資産額(/)	1.0009円

R M先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

純資産額計算書

資産総額	277,469,260,691円
負債総額	374,853,728円
純資産総額(-)	277,094,406,963円
発行済口数	262,230,149,576口
1口当たり純資産額(/)	1.0567円

R M先進国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	41,703,544,866円
負債総額	316,341,011円
純資産総額(-)	41,387,203,855円
発行済口数	37,673,534,814口
1口当たり純資産額(/)	1.0986円

R M新興国債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	6,555,438,747円
負債総額	56,360,472円
純資産総額(-)	6,499,078,275円
発行済口数	5,889,069,828口
1口当たり純資産額(/)	1.1036円

R M国内株式E S Gマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,150,017,294円
負債総額	80,763円
純資産総額(-)	2,149,936,531円
発行済口数	1,732,140,736口
1口当たり純資産額(/)	1.2412円

R M先進国株式E S Gマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	2,145,782,325円
負債総額	24,993円
純資産総額(-)	2,145,757,332円
発行済口数	1,477,553,861口
1口当たり純資産額(/)	1.4522円

R M新興国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	17,128,010,348円
負債総額	135,025,491円
純資産総額（ - ）	16,992,984,857円
発行済口数	10,351,630,991口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6416円

R M国内リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	32,936,057,006円
負債総額	210,492,095円
純資産総額（ - ）	32,725,564,911円
発行済口数	21,152,920,462口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5471円

R M先進国リートマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	26,543,345,473円
負債総額	3,406,690円
純資産総額（ - ）	26,539,938,783円
発行済口数	19,459,862,105口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3638円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

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

するものとしします。

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

受益権の譲渡の対抗要件

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

(4) 受益証券の再発行

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

(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8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8月末現在）

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は取締役会の決議をもって決定します。

取締役会は、その決議によって代表取締役を選定します。取締役会は、業務執行を分担して行う責任者を執行役員として選任することができます。また、取締役会は、取締役および執行役員の職務執行を監督します。

取締役会は、法令に別段の定めがある場合を除き、取締役社長がこれを招集し、議長となります。取締役社長に事故または欠員があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序に従い、他の取締役が取締役会を招集し、議長となります。

取締役会の決議は、議決に加わることができる取締役の過半数が出席し、出席した取締役の過半数をもって行います。

取締役は株主総会において選任されます。取締役（監査等委員である取締役を除く。）の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。監査等委員である取締役の任期は、選任後2年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までです。

経営会議は、経営に関する全般的な重要事項および重要な業務執行案件を協議します。

監査等委員会は、代表取締役その他の業務執行取締役の職務の執行を監査する独立の機関であるとともに、監査等委員である取締役以外の業務執行取締役の選任・解任・辞任および報酬等について監査等委員会としての意見を決定します。

投資運用の意思決定機構

委託会社では、以下P.D.C.Aサイクルにて投資運用の意思決定を行っています。

PLAN：計画

- ・運用戦略部は、運用基本方針や主な投資制限などを策定し、運用委員会にて協議します。

DO：実行

- ・運用部門のファンドマネージャーは、決定された運用基本方針等に基づいて運用計画を策定し、ファンドマネージャーが所属する部の部長が承認します。
- ・ファンドマネージャーは、決定された運用計画に沿って運用指図を行いポートフォリオを構築し、ファンドの運用状況を管理します。
- ・運用部門の各部長は、ファンドの運用が運用計画に沿って行われていることを確認します。
- ・売買発注の執行は、運用計画の策定等から組織的に分離されたトレーディング部が、発注先証券会社等の選定ルール等に基づく最良執行を行うよう努めます。

CHECK：検証 ACTION：改善

- ・法令等や主な投資制限の遵守状況等については、運用部門から独立した運用リスク管理部がモニタリングを行います。その結果は、運用評価委員会に報告するとともにすみやかに運用部門

にフィードバックされ、ファンドの運用に反映されます。

- ・運用実績等については運用評価委員会が統括し、運用部門に対する管理・指導を行います。

2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年8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	101	1,099,363
単位型株式投資信託	8	103,560
合計	109	1,202,924

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					株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計	その他 利益剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	1,000,000	490,000	490,000	7,236	7,236	1,482,763
当期変動額						

当期純利益	-	-	-	1,785,287	1,785,287	1,785,287
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,785,287	1,785,287	1,785,287
当期末残高	1,000,000	490,000	490,000	1,778,051	1,778,051	3,268,051

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

(単位:千円)

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

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

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

時価のあるもの

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

その他の有形固定資産につきましては、定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 8～15年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

賞与引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

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

(3) 連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用

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

(未適用の会計基準等)

1. 収益認識に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

ステップ1: 顧客との契約を識別する。

ステップ2: 契約における履行義務を識別する。

ステップ3: 取引価格を算定する。

ステップ4: 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5: 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当財務諸表に与える影響はありません。

2. 時価の算定に関する会計基準等

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

(1) 概要

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

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

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

当財務諸表に与える影響はありません。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社に対する資産及び負債

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

(注) 当該金額は、連結納税親会社と受払いする金額であります。

(損益計算書関係)

1 関係会社に対する主な取引

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2．配当に関する事項

該当事項はありません。

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

資金運用については短期的な預金等に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

当社は、国の預金保護の対象となる決済性預金に預け入れ管理しております。

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

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

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

2．金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

前事業年度（2020年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（2021年3月31日）

（単位：千円）

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

金融商品の時価の算定方法に関する事項

資産

預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬

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

負債

未払手数料、その他未払金

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

（税効果会計関係）

1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

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

(*1) 税務上の繰越欠損金及びその繰延税金資産の繰越期限別の金額

前事業年度(2020年3月31日)

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

税務上の繰越欠損金は、法定実効税率を乗じた額

当事業年度(2021年3月31日)

該当事項はありません。

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

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

法定実効税率 30.61%

（調整）

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

（セグメント情報等）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

（3）主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	2,218,664

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. セグメント情報

当社は、「資産運用業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（1）製品及びサービスごとの情報

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

（2）地域ごとの情報

営業収益

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

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

顧客の名称又は氏名	営業収益額
株式会社りそな銀行	5,083,778

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 親会社及び主要株主（会社等に限る）等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。

(2) 兄弟会社等

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2. 親会社に関する注記

親会社情報

株式会社りそなホールディングス（東京証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

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

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

(注) 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

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

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

(重要な後発事象)

前事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

- (1) 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (2) 運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- (3) 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下(4)、(5)において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または金融デリバティブ取引を行なうこと。
- (4) 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。
- (5) 上記(3)、(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- (1) 定款の変更、事業譲渡又は事業譲受、出資の状況その他の重要事項
該当事項はありません。
- (2) 訴訟事件その他の重要事項
委託会社に重要な影響を与えた事実、または与えると予想される訴訟事件などは発生していません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容

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

< 再信託受託会社の概要 >

名称 : 株式会社日本カストディ銀行

資本金の額 : 51,000百万円(2021年3月末現在)

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

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

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

日本におけるファンドの募集、解約、収益分配金および償還金の取扱いなどを行いません。

3【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
2021年 6月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2021年 6月24日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2021年5月21日

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

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

監査意見

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

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

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれておりません。

独立監査人の監査報告書

2021年10月11日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2020年9月25日から2021年8月20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、埼玉りそな・グローバルバランス・プラスE S Gの2021年8月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

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

財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

利害関係

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

以 上

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

2. X B R L データは監査の対象には含まれていません。