

【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12月15日提出
【計算期間】	第2期(自 2020年9月16日至 2021年9月15日)
【ファンド名】	りそな・リスクコントロールファンド2019-10
【発行者名】	りそなアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役 西岡 明彦
【本店の所在の場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【事務連絡者氏名】	塚田 光子
【連絡場所】	東京都江東区木場一丁目5番65号
【電話番号】	03-6704-3821
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

安定した収益の確保と、信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。

ファンドの基本的性格

1) 商品分類

単体型投信・ 追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単体型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ()
	内外	資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

2) 属性区分

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株	年2回			
中小型株	年4回	日本		
債券		北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
一般	年6回 (隔月)	欧州		
公債				
社債				
その他債券	年12回 (毎月)	アジア		
クレジット属性 ()		オセアニア		
日々				
不動産投信	その他 ()	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
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」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記 から に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

(3)不動産投信

これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

(4)その他資産

組入れている資産を記載するものとする。

(5)資産複合

以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

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

2. 決算頻度による属性区分

- 年1回：目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
 年2回：目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
 年4回：目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
 年6回(隔月)：目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
 年12回(毎月)：目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
 日々：目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。

その他：上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

3. 投資対象地域による属性区分(重複使用可能)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4. 投資形態による属性区分

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

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

5. 為替ヘッジによる属性区分

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

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

6. インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分

日経225

TOPIX

その他の指数：前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

7. 特殊型

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

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

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

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

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

ファンドの特色

◆「保証契約」の表記について

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

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

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

◆「保証会社」の表記について

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

投資対象

- 主として複数のマザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内、先進国および新興国の債券・株式ならびに国内および先進国の不動産投資信託証券（リート）などへの分散投資を行います。
- RMマネーマザーファンドを除く各マザーファンドは、各投資対象資産における代表的なインデックスの動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

※投資するマザーファンドについては後述の「ファンドの仕組み」を、各インデックスについては後述の「インデックスの著作権等について」をご参照ください。

ファンドの特色

- 1** 投資環境の変化に応じた資産配分の調整を通じて、信託財産の収益確保を目指します。
- 2** ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した「確保ライン」を上回る水準で運用を継続することを目指します。
- 3** 以下の条件に該当した場合、ファンドは繰上償還*します。このとき、ファンド設定時に締結するりそな銀行との保証契約の履行により「確保ライン」を下回ることなく繰上償還します。

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

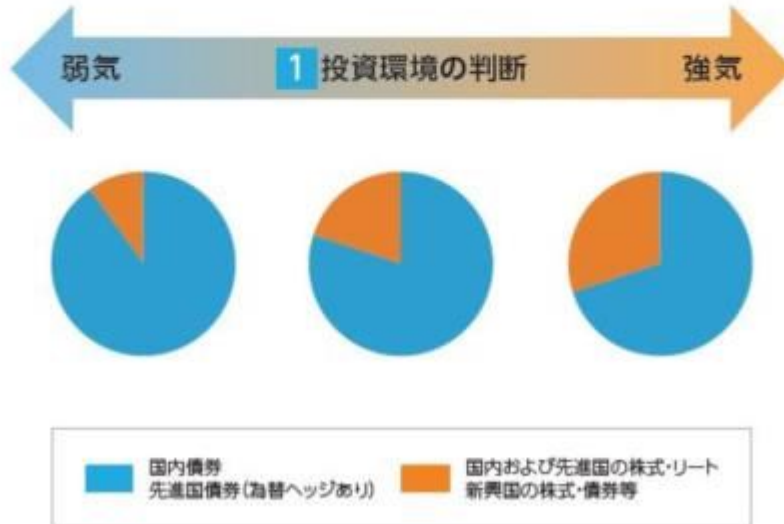
*基準価額が「確保ライン」を上回っている場合でも、上記の条件以外の理由によって委託会社が繰上償還を決定することがあります。

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

Point

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

投資環境の判断と投資割合のイメージ

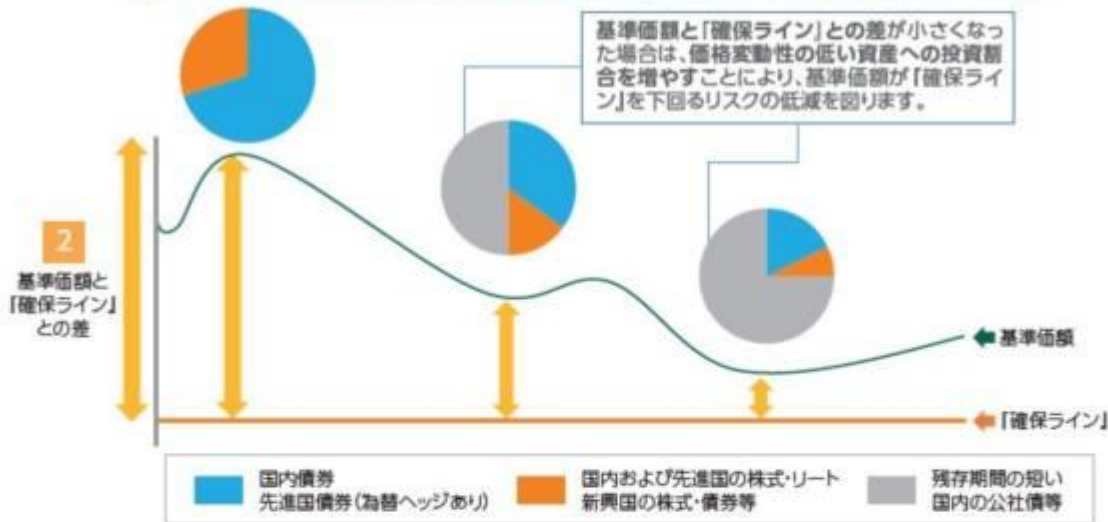


2 ファンドの基準価額下落時においても、あらかじめ設定した「確保ライン」を上回る水準で運用を継続することを目指します。

Point

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

「基準価額と「確保ライン」との差」と投資割合のイメージ

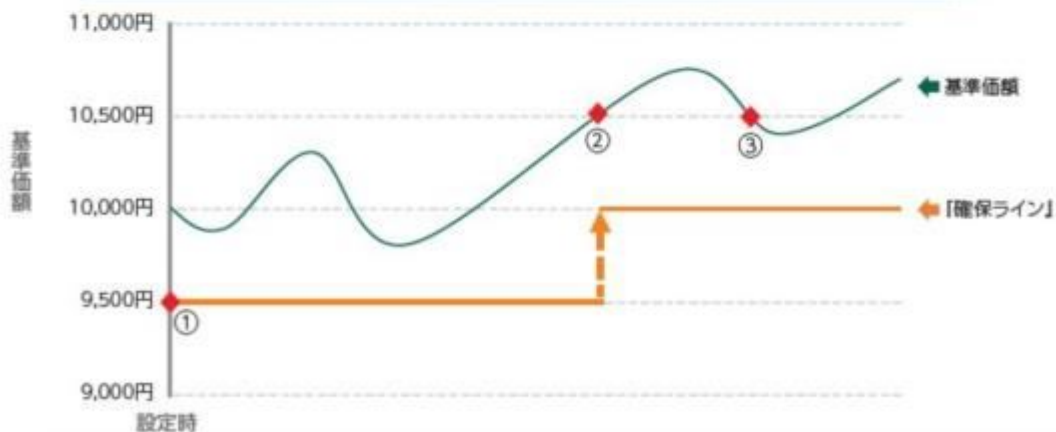


「確保ライン」は設定後に見直される場合があります。

Point

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

「確保ライン」の引き上げイメージ



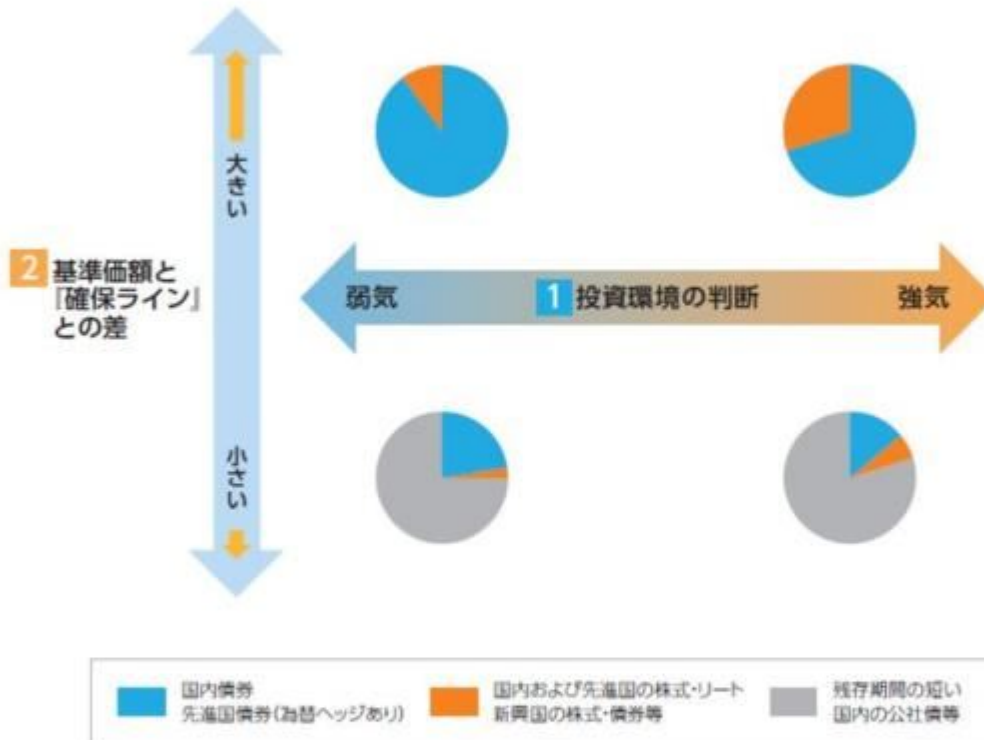
⚠️ ご注意ください

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

投資対象資産への投資割合のイメージ

1 投資環境の判断 と 2 基準価額と「確保ライン」との差

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

⚠️ **ご注意ください**

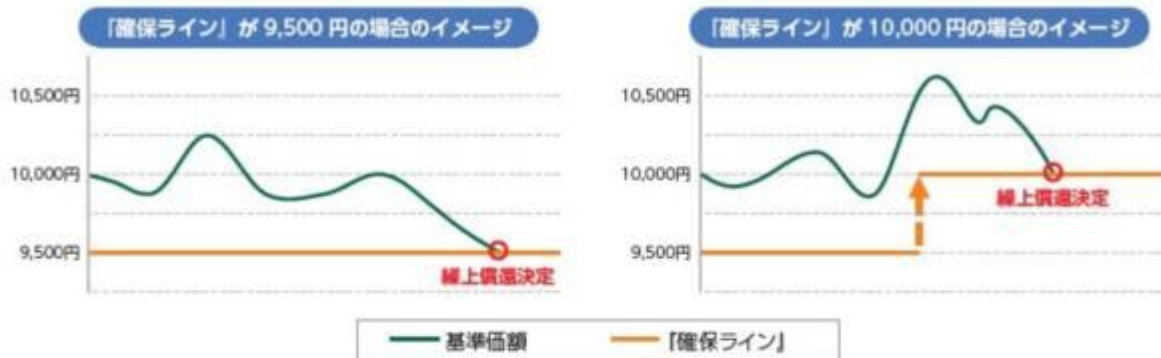
上記の図は、ファンドにおける投資割合の変化について説明することを目的に単純化したものであり、実際の運用において上記の投資割合で運用することを示唆・保証するものではありません。

3

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

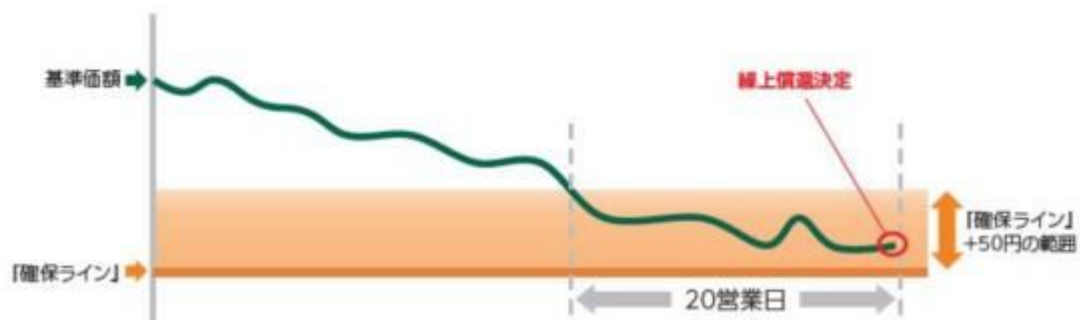
条件① 基準価額が「確保ライン」まで下落した場合

短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替え、繰上償還します。



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

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

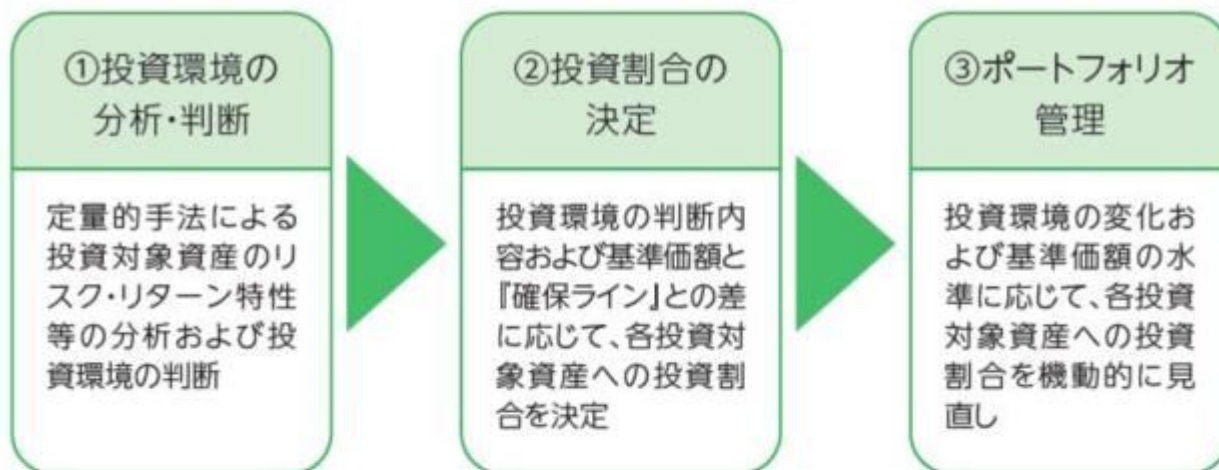


※繰上償還を決定した日の翌営業日より保有するすべてのマザーファンド受益証券を売却し、短期金融資産等を中心とした安定的運用に切り替え、繰上償還します。実質的投資対象資産の流動性や海外休業日の影響等により、繰上償還を決定した日から償還日まで日数を要する場合があります。

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

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

運用プロセスのイメージ



※上記の運用プロセスおよびイメージ図は、今後変更になる場合があります。

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

分配方針

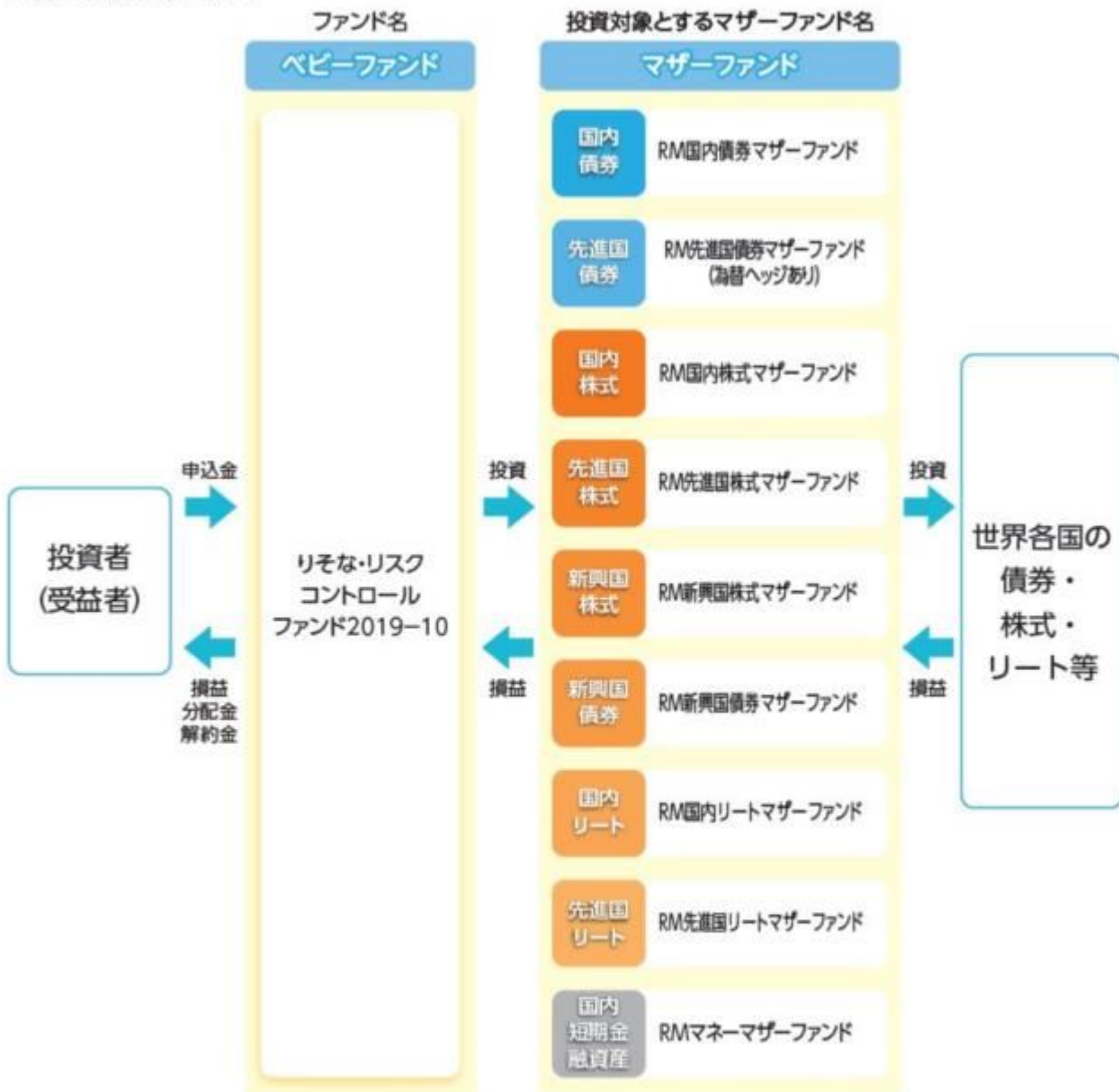
原則、毎年9月15日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- ①分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
- ②原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- ③留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。

★将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ ファンドの仕組み

ファンドは各マザーファンドを通じて世界各国の債券、株式およびリートなど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。

インデックスの著作権等について

●RM国内債券マザーファンド

「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。野村證券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

●RM先進国債券マザーファンド(為替ヘッジあり)

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

●RM国内株式マザーファンド

「東証株価指数(TOPIX、配当込み)」は、東京証券取引所第一部に上場している国内普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、配当を考慮したものです。なお、指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利は東京証券取引所に帰属します。

●RM先進国株式マザーファンド

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

●RM新興国株式マザーファンド

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

●RM新興国債券マザーファンド

「JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(円換算ベース)」は、JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)をもとに、委託会社が円換算して計算したものです。JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド(米ドルベース)は、J.P.モルガン・セキュリティーズ・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国内リートマザーファンド

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

●RM先進国リートマザーファンド

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

※RMマネーマザーファンドには対象インデックスはありません。

信託金限度額

500億円を限度とします。

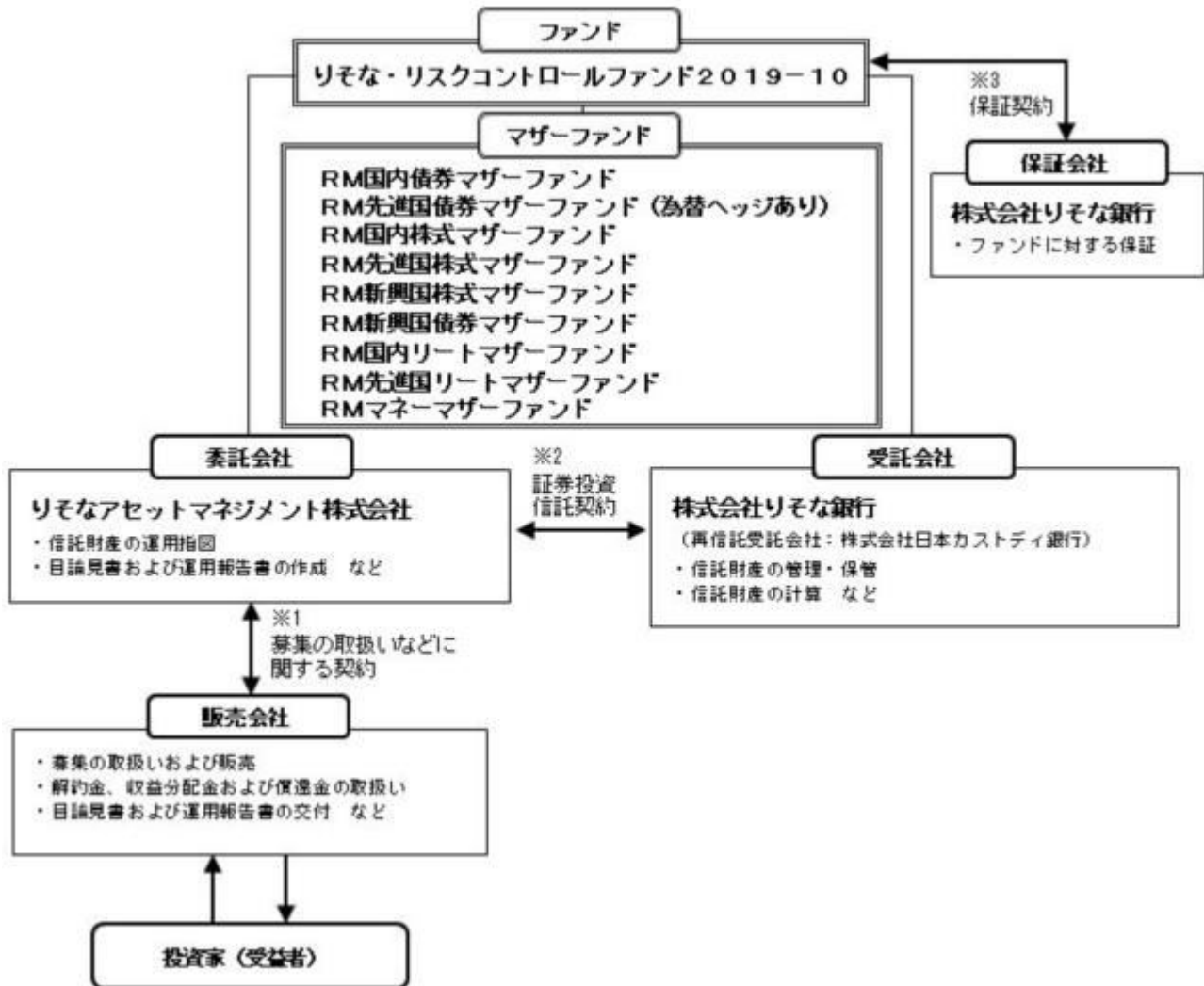
(2)【ファンドの沿革】

2019年10月31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を。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を。運用の基本方針、投資対象、投資制限、信託報酬、受益者の権利、募集方法の取決めの内容などが含まれています。
- 3 基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を保証会社が信託財産に支払うことを規定したものを。

注) 本契約は民法上の保証契約を意味するものではなく、保証類似行為として行われるものです。
また本契約は、株式会社りそな銀行がファンドの元本を保証するものではありません。

委託会社の概況（2021年9月末現在）

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

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

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

*上記は設定時点における主要投資対象であり、将来の市場環境および市場構造の変化等によっては、一部のマザーファンドへの投資割合がゼロとなる場合や、新たに主要投資対象を追加する場合があります。

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

新名称	旧名称
RM国内債券マザーファンド	RAM国内債券マザーファンド
RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	RAM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）
RM国内株式マザーファンド	RAM国内株式マザーファンド
RM先進国株式マザーファンド	RAM先進国株式マザーファンド
RM新興国株式マザーファンド	RAM新興国株式マザーファンド
RM新興国債券マザーファンド	RAM新興国債券マザーファンド
RM国内リートマザーファンド	RAM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	RAM先進国リートマザーファンド
RMマネーマザーファンド	RAMマネーマザーファンド

主として、次項に掲げる各マザーファンド受益証券への投資を通じ、実質的に国内債券および先進国債券（為替ヘッジあり）に投資を行い、安定した収益を確保しつつ、定量的手法による投資環境の判定基準に従って、国内および先進国の株式・不動産投資信託証券（リート）ならびに新興国の株式・債券等へも機動的に投資することにより、中長期的に信託財産の着実な成長を目指します。各投資対象資産への投資は、各資産を投資対象とするマザーファンドを通じて行います。また、各マザーファンドは下記のインデックスに連動する投資成果を目指します。

マザーファンド	実質的投資対象	インデックス
RM国内債券マザーファンド	国内債券	NOMURA - BPI総合
RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	先進国債券	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
RM国内株式マザーファンド	国内株式	東証株価指数（TOPIX、配当込み）
RM先進国株式マザーファンド	先進国株式	MSCI - KOKUSA I 指数（配当込み、円換算ベース）
RM新興国株式マザーファンド	新興国株式	MSCI エマージング・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）
RM新興国債券マザーファンド	新興国債券	JPMorgan GBI - EM グローバル・ダイバーシファイド（円換算ベース）
RM国内リートマザーファンド	国内リート	東証REIT指数（配当込み）
RM先進国リートマザーファンド	先進国リート	S&P 先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）

実質組入外貨建資産については、一部為替ヘッジを行います。

投資環境の悪化等により、基準価額があらかじめ定めた閾値（以下『確保ライン』といいます。）に近づいた場合は、基準価額が『確保ライン』を下回るリスクを低減するために、RMマネーマザーファンド受益証券への投資を通じて残存期間の短い国内の公社債等へ投資を行い、価格変動性の低い資産への投資割合を増やします。

ファンドは、基準価額が下落時においても『確保ライン』を下回ることがないように運用リスクの調整を図りつつ信託財産の着実な成長を目指して運用を行いますが、常にファンドの基準価額が『確保ライン』を上回ることを委託者が保証するものではありません。

設定時における『確保ライン』は9,500円とします。設定後、基準価額が最初に10,500円を上回った日の翌営業日以降は『確保ライン』を10,000円に見直すものとし、その後の信託期間においては『確保ライン』の見直しは行わないものとします。また、『確保ライン』の引き下げは行いません。

上記の方針に関わらず、以下の場合、短期金融資産等を中心とした安定的な運用に切り替えた後、繰上償還を行います。

イ 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。

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

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

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

(2)【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

有価証券の指図範囲

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

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

- 13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
- 14) 投資証券、新投資口予約権証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
- 15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
- 16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
- 17) 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
- 18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19) 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
- 20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
- 21) 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって19)の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの

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

金融商品の指図範囲

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

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

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

その他の投資対象と指図範囲

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

《参考情報》

投資対象とするマザーファンドの概要

< RM国内債券マザーファンド >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。
主な投資対象	次の有価証券を主要投資対象とします。 ・ NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券
投資方針	主として、NOMURA - B P I 総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA - B P I 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、NOMURA - B P I 総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。債券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合および信託が終了する場合等のやむを得ない事情が発生したときは、上記のような運用ができない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限り ます。</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。 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国内株式マザーファンド >

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

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

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

主な投資対象	<p>次の有価証券を主要投資対象とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・金融商品取引所に上場されているまたは店頭登録されている（上場予定および店頭登録予定を含みます。）先進国株式（*）（日本の株式を除きます。以下同じ。） （*）DR（預託証券）もしくは株式と同等の投資効果が得られる権利を表示する証券および証書等を含みます。 ・先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）
投資方針	<p>主として、先進国株式または先進国株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券）に投資し、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。なお、MSCI-KOKUSAI指数（配当込み、円換算ベース）への連動性を高めるため、海外の金融商品取引市場に上場する株価指数先物取引を活用することがあります。</p> <p>株式またはETF（上場投資信託証券）の組入比率は、通常の状態で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。 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、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。 ・ 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	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。 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。 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、ます。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。 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

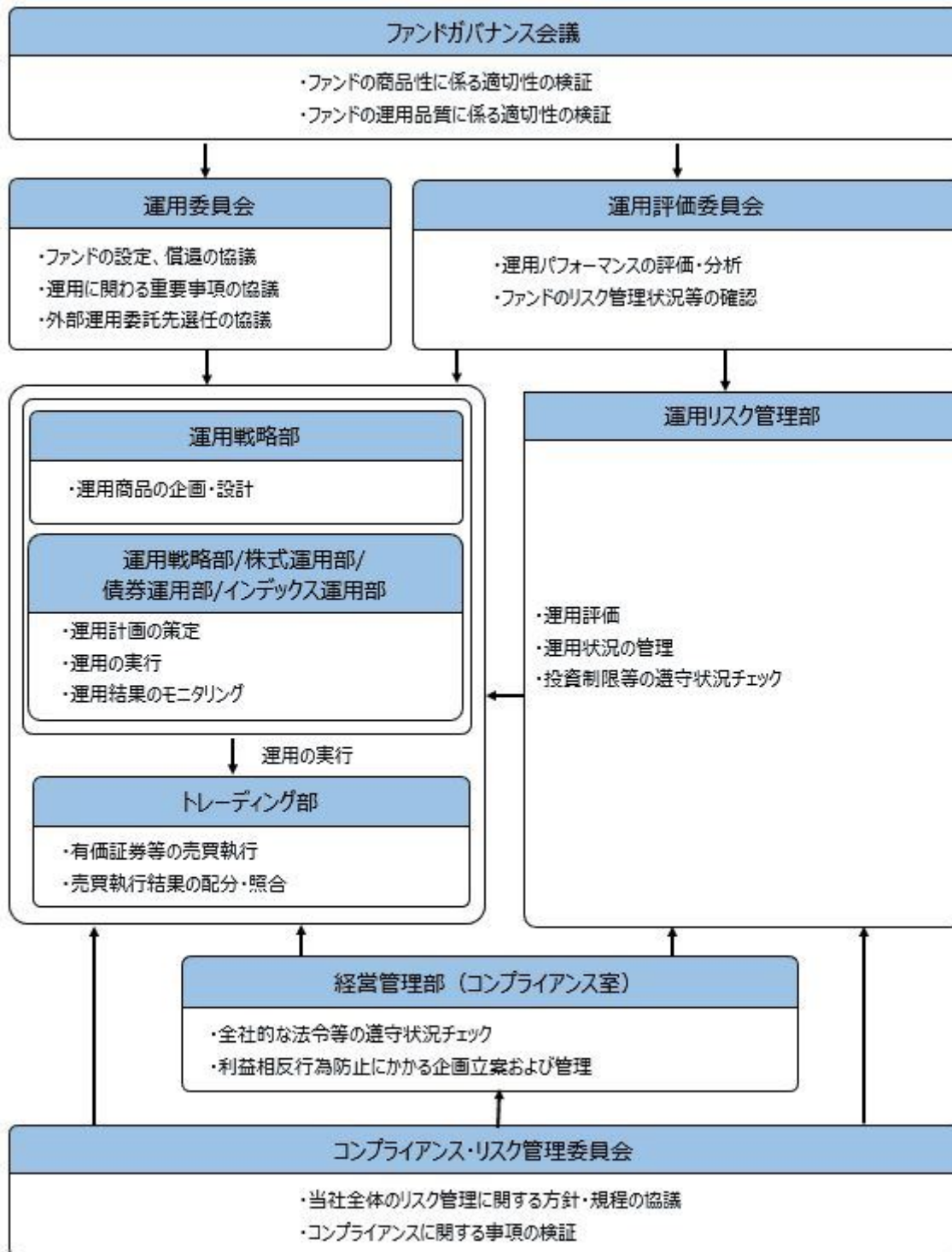
< R Mマネーマザーファンド >

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

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

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下のとおりです。



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

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

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

ファンドの関係法人に対する管理体制

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

上記の運用体制は、2021年9月末現在のものであり、今後変更となる可能性があります。

（４）【分配方針】

収益分配方針

原則として毎決算時に以下の収益分配方針に基づいて分配を行います。

- 1) 分配対象額は、元本超過額または経費控除後の配当等収益のいずれか多い額とします。
- 2) 原則として、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
- 3) 留保益は、運用の基本方針に基づいて運用します。
委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

収益分配金の支払い

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

（５）【投資制限】

約款に定める投資制限

- 1) 株式への実質投資割合には、制限を設けません。
- 2) 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の 20% 以下とします。
- 3) 投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 5% 以下とします。
- 4) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- 5) デリバティブ取引は、投資対象とする現物資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的ならびに価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
- 6) 一般社団法人投資信託協会規則に規定するデリバティブ取引等について、同規則に従い、合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 7) 一般社団法人投資信託協会規則に規定する一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれの区分毎に 10%、合計で 20% を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 8) 投資する株式等の範囲
 1. 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
 2. 前記 1. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとします。
- 9) 信用取引の指図範囲
 1. 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
 2. 前記 1. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 - イ) 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 - ロ) 株式分割により取得する株券
 - ハ) 有償増資により取得する株券
 - ニ) 売出しにより取得する株券
 - ホ) 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第 236 条第 1 項第 3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前

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

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

10) 先物取引等の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)).
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受け取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等(株式、株価指数にかかる先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受け取る配当金も含まれます。)ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
2. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占めるヘッジ対象とする外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
 - ハ) コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ10)で規定する全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
3. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行うことの指図をすることができます。
 - イ) 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受け取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用されているものをいい、以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
 - ロ) 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受け取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに約款第14条第2項第1号から第6号までに掲げる金融商品で運用している額(以下ロ)において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建で、信託財産

の外貨建資産組入可能額（約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。）に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受け取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。

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

11) スワップ取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

12) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図および範囲

1. 委託者は、信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「金利先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下3.において「ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記ヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額がヘッジ対象金利商品の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下4.において「為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。）が、信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産にかかる保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額（以下「保有外貨建資産の時価総額の合計額」といいます。）を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、為替先渡取引の想定元本の合計額が保

有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。

5. 前記3.および4.においてマザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。また、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるヘッジ対象金利商品および保有外貨建資産の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
6. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
7. 委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

13) 直物為替先渡取引の運用指図

1. 委託者は、信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、直物為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として、信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. 直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下3.において「直物為替先渡取引の想定元本の合計額」といいます。)が、保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額の合計額が減少して、直物為替先渡取引の想定元本の合計額が保有外貨建資産の時価総額の合計額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する直物為替先渡取引の一部の解約(反対の売買による解消を含む。)を指図するものとします。
4. 前記3.においてマザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかる直物為替先渡取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 直物為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
6. 委託者は、直物為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

14) 有価証券の貸付けの指図および範囲

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式、公社債および投資信託証券を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。
 - イ) 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ロ) 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
 - ハ) 投資信託証券の貸付けは、貸付時点において、貸付投資信託証券の時価合計額が、信託財産で保有する投資信託証券の時価合計額を超えないものとします。
2. 前記1.に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
3. 委託者は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

15) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

16) 外国為替予約取引の指図および範囲

委託者は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産

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

17) 資金の借入れ

1. 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から、信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
3. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

法令による投資制限

同一法人の発行する株式(投資信託及び投資法人に関する法律)

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

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスク

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

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

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

市場リスク

・株価変動リスク

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

・金利(債券価格)変動リスク

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

・リートの価格変動リスク

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

・為替変動リスク

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

資産配分リスク

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

信用リスク

実質的に組み入れている有価証券等の発行体が倒産した場合、発行体の財務状況が悪化した場合ま

たはそれらが予想された場合等には、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなることにより、基準価額の下落要因となります。

流動性リスク

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

カントリーリスク

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

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証契約は保証会社（株式会社りそな銀行）の信用リスクの影響を受けます。保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったときは、ファンドは繰上償還します。この場合、基準価額または償還価額は『確保ライン』を下回る可能性があります。

（その他の留意点）

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

当ファンドは、基準価額が『確保ライン』を下回らないことを目的とした保証契約を締結し基準価額下落時における損失の限定を図りますが、保証会社の破綻等により保証契約が履行されない場合には、基準価額または償還価額が『確保ライン』を下回る可能性があります。

次のいずれかの場合には、委託会社は、受託会社と合意の上、繰上償還します。

- ・基準価額が『確保ライン』まで下落した場合。
- ・基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して50円未満となった場合。
- ・保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき。

また次のいずれかの場合には、委託会社は、事前に受益者の意向を確認し、受託会社と合意の上、繰上償還することができます。

- ・信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき。
- ・繰上償還することが受益者のため有利であると認めるとき。
- ・やむを得ない事情が発生したとき。

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

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

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

上記体制は2021年9月末現在のものであり、今後変更となる場合があります。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、ファンドの信託財産の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。

1) 当初設定日以降、2019年12月5日まで

年率1.243%（税抜1.13%）

2) 2019年12月6日以降

1カ月に1度見直すものとし、前月末営業日における各マザーファンド（RMマネーマザーファンドを除きます。）の時価総額のうち当ファンドが保有する部分の合計が、純資産総額に占める割合（以下「リスク性資産割合」といいます。）に応じ、以下の表に掲げる率を毎月初第5営業日より適用するものとします。

リスク性資産割合	信託報酬
50%以上	年率1.243%（税抜1.13%）
25%以上50%未満	年率0.561%（税抜0.51%）
25%未満	年率0.297%（税抜0.27%）

3) 2)にかかわらず、前月末営業日以降にリスク性資産割合が25%未満となった場合においては、前月末営業日のリスク性資産割合に関わらず、委託会社の判断により信託報酬を年率0.297%（税抜0.27%）を上限として変更し、毎月初5営業日以外の営業日より適用する場合があります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落し、繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の信託報酬の総額は0円とします。

信託報酬の配分

信託報酬の配分（年率）は、以下の通りとします。

1) 当初設定日以降、2019年12月5日まで

信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
委託会社	販売会社	受託会社
0.495%	0.605%	0.03%

2) 2019年12月6日以降

リスク性資産割合	信託報酬 = 日々の純資産総額 × 信託報酬率		
	委託会社	販売会社	受託会社
50%以上	0.495%	0.605%	0.03%
25%以上50%未満	0.216%	0.264%	0.03%
25%未満	0.108%	0.132%	0.03%

表中の率は税抜です。別途消費税がかかります。

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

支払時期

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

保証料

保証契約にかかる保証料は、ファンドの純資産総額に対して、年率0.216%を乗じて得た額とします。信託期間を通じて毎日費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（当該終了日が休業日の場合はその翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産から支払われます。

上記の信託報酬に保証料を加えた費用は最大で年率1.459%（税込）となります。

税法が改正された場合等には、税率等が変更される場合があります。

基準価額が『確保ライン』まで下落し、繰上償還が決定した場合は、繰上償還を決定した日の翌日以降の保証料の総額は0円とします。

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

とし、当該益金から支払われます。

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

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

個人受益者の場合

１）収益分配金に対する課税

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

２）解約金および償還金に対する課税

解約時および償還時の差益（譲渡益）^{*}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

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

２）益金不算入制度の適用

益金不算入制度は適用されません。

買取請求による換金の際の課税については、販売会社にお問い合わせください。

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

上記は2021年9月末現在のものですので、税法が改正された場合などには、税率などの課税上の取扱いが変更になる場合があります。税金の取扱いの詳細については、税務専門家などにご確認されることをお勧めします。

５【運用状況】

【りそな・リスクコントロールファンド2019-10】

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 【投資状況】

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	17,332,362,089	99.91
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		16,079,217	0.09
合計(純資産総額)		17,348,441,306	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)	10,095,140,229	1.0440	10,539,326,400	1.0400	10,498,945,838	60.52
日本	親投資信託受益証券	R M国内債券マザーファンド	2,520,013,065	1.0509	2,648,281,731	1.0520	2,651,053,744	15.28
日本	親投資信託受益証券	R M先進国株式マザーファンド	1,323,068,073	1.7220	2,278,323,222	1.9060	2,521,767,747	14.54
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	258,019,599	1.6374	422,481,292	1.6289	420,288,124	2.42
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	313,008,641	1.1916	372,981,097	1.3322	416,990,111	2.40
日本	親投資信託受益証券	R M国内株式マザーファンド	276,820,932	1.3673	378,497,261	1.4826	410,414,713	2.37
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	191,059,632	1.0967	209,535,099	1.0917	208,579,800	1.20
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	136,351,026	1.4120	192,527,649	1.4985	204,322,012	1.18

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.91
合計	99.91

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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（2020年 9月15日）	21,555	21,555	0.9660	0.9660
第2計算期間末（2021年 9月15日）	17,723	17,723	0.9901	0.9901
2020年 9月末日	21,413		0.9646	
10月末日	20,970		0.9610	
11月末日	20,914		0.9685	
12月末日	20,520		0.9714	
2021年 1月末日	20,207		0.9718	
2月末日	19,629		0.9653	
3月末日	19,362		0.9704	
4月末日	19,112		0.9745	
5月末日	18,756		0.9755	
6月末日	18,298		0.9803	
7月末日	18,127		0.9897	
8月末日	17,961		0.9932	
9月末日	17,348		0.9788	

【分配の推移】

期	期間	1口当たりの分配金（円）
第1期	2019年10月31日～2020年 9月15日	0.0000
第2期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0.0000

【収益率の推移】

期	期間	収益率（％）
第1期	2019年10月31日～2020年 9月15日	3.40
第2期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	2.49

(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	2019年10月31日～2020年 9月15日	26,468,299,071	4,152,545,217
第2期	2020年 9月16日～2021年 9月15日	0	4,415,421,562

(注)第1計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

R M国内債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	95,515,262,490	82.79
地方債証券	日本	6,205,268,475	5.38
特殊債券	日本	7,153,690,035	6.20
社債券	日本	4,539,293,000	3.93
	フランス	200,299,000	0.17
	オーストラリア	100,107,000	0.09
	小計	4,839,699,000	4.19
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		1,657,766,299	1.44
合計（純資産総額）		115,371,686,299	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	数量又は額面総額	簿価単価（円）	簿価金額（円）	評価単価（円）	評価金額（円）	利率（％）	償還期限	投資比率（％）
日本	国債証券	第139回利付国債（5年）	1,680,000,000	100.71	1,691,999,800	100.54	1,689,139,200	0.100	2024/3/20	1.46
日本	国債証券	第140回利付国債（5年）	1,590,000,000	100.75	1,601,994,600	100.59	1,599,524,100	0.100	2024/6/20	1.39
日本	国債証券	第144回利付国債（5年）	1,360,000,000	100.96	1,373,166,200	100.78	1,370,648,800	0.100	2025/6/20	1.19
日本	国債証券	第138回利付国債（5年）	1,240,000,000	100.64	1,248,023,600	100.48	1,246,063,600	0.100	2023/12/20	1.08
日本	国債証券	第146回利付国債（5年）	1,230,000,000	100.97	1,241,938,400	100.84	1,240,418,100	0.100	2025/12/20	1.08
日本	国債証券	第136回利付国債（5年）	1,180,000,000	100.55	1,186,503,400	100.37	1,184,460,400	0.100	2023/6/20	1.03
日本	国債証券	第346回利付国債（10年）	1,150,000,000	101.21	1,163,999,800	100.98	1,161,362,000	0.100	2027/3/20	1.01

日本	国債証券	第137回利付国債(5年)	1,070,000,000	100.59	1,076,368,200	100.43	1,074,643,800	0.100	2023/9/20	0.93
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,050,000,000	101.27	1,063,438,400	101.03	1,060,899,000	0.100	2028/3/20	0.92
日本	国債証券	第142回利付国債(5年)	1,050,000,000	100.84	1,058,880,800	100.67	1,057,119,000	0.100	2024/12/20	0.92
日本	国債証券	第356回利付国債(10年)	1,020,000,000	101.08	1,031,112,000	100.91	1,029,353,400	0.100	2029/9/20	0.89
日本	国債証券	第145回利付国債(5年)	1,020,000,000	101.00	1,030,225,300	100.81	1,028,333,400	0.100	2025/9/20	0.89
日本	国債証券	第143回利付国債(5年)	1,010,000,000	100.93	1,019,456,400	100.73	1,017,373,000	0.100	2025/3/20	0.88
日本	国債証券	第135回利付国債(5年)	1,000,000,000	100.49	1,004,940,000	100.32	1,003,230,000	0.100	2023/3/20	0.87
日本	国債証券	第359回利付国債(10年)	990,000,000	100.77	997,680,600	100.78	997,751,700	0.100	2030/6/20	0.86
日本	国債証券	第361回利付国債(10年)	980,000,000	100.14	981,444,900	100.59	985,850,600	0.100	2030/12/20	0.85
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	970,000,000	101.27	982,392,900	101.01	979,826,100	0.100	2028/9/20	0.85
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	970,000,000	101.17	981,389,200	100.94	979,147,100	0.100	2026/12/20	0.85
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	960,000,000	101.21	971,647,600	101.04	970,070,400	0.100	2027/9/20	0.84
日本	国債証券	第353回利付国債(10年)	960,000,000	101.16	971,222,100	101.01	969,724,800	0.100	2028/12/20	0.84
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	960,000,000	101.16	971,181,100	100.92	968,860,800	0.100	2026/9/20	0.84
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	950,000,000	101.15	960,977,400	101.06	960,079,500	0.100	2027/12/20	0.83
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	934,000,000	102.47	957,153,860	102.03	952,988,220	0.400	2025/9/20	0.83
日本	国債証券	第362回利付国債(10年)	930,000,000	100.42	933,919,400	100.47	934,380,300	0.100	2031/3/20	0.81
日本	国債証券	第147回利付国債(5年)	930,000,000	100.50	934,680,100	100.44	934,166,400	0.005	2026/3/20	0.81
日本	国債証券	第357回利付国債(10年)	920,000,000	101.07	929,921,100	100.86	927,939,600	0.100	2029/12/20	0.80
日本	国債証券	第423回利付国債(2年)	870,000,000	100.23	872,083,700	100.19	871,696,500	0.005	2023/4/1	0.76
日本	国債証券	第360回利付国債(10年)	860,000,000	100.69	865,982,900	100.71	866,157,600	0.100	2030/9/20	0.75
日本	国債証券	第427回利付国債(2年)	840,000,000	100.26	842,186,100	100.23	841,999,200	0.005	2023/8/1	0.73
日本	国債証券	第134回利付国債(5年)	830,000,000	100.44	833,710,100	100.26	832,174,600	0.100	2022/12/20	0.72

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	82.79
地方債証券	5.38
特殊債券	6.20
社債券	4.19
合計	98.56

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 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	128,479,905,496	46.27
	カナダ	5,339,293,889	1.92
	メキシコ	1,897,008,592	0.68
	ドイツ	20,719,329,416	7.46
	イタリア	26,205,560,312	9.44
	フランス	28,297,061,610	10.19
	オランダ	5,152,929,201	1.86
	スペイン	16,510,561,746	5.95
	ベルギー	6,549,847,810	2.36
	オーストリア	4,076,851,599	1.47
	フィンランド	1,687,545,927	0.61
	アイルランド	2,223,933,114	0.80
	イギリス	16,767,353,912	6.04
	スウェーデン	794,103,081	0.29
	ノルウェー	660,316,917	0.24
	デンマーク	1,363,838,422	0.49
	ポーランド	1,535,514,914	0.55
	オーストラリア	5,066,723,500	1.82
	シンガポール	1,230,101,430	0.44
	マレーシア	1,302,288,371	0.47
イスラエル	1,269,822,236	0.46	
	小計	277,129,891,495	99.81
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		528,399,401	0.19
合計（純資産総額）		277,658,290,896	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		282,385,185,422	101.70

(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	18,720,000	10,841.69	2,029,564,442	10,853.61	2,031,797,026	0.750	2028/1/31	0.73
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	15,650,000	10,659.33	1,668,186,214	10,397.19	1,627,160,592	0.625	2030/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,850,000	11,478.16	1,589,726,532	11,298.67	1,564,866,237	1.625	2031/5/15	0.56
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	13,450,000	11,179.56	1,503,651,794	11,168.39	1,502,148,670	0.125	2023/7/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,740,000	10,802.09	1,268,165,555	10,823.01	1,270,621,748	1.125	2031/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	11,280,000	11,185.64	1,261,740,700	11,185.00	1,261,668,564	0.125	2023/2/28	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,900,000	11,184.29	1,219,088,054	11,181.50	1,218,784,317	0.125	2023/3/31	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,580,000	11,194.96	1,184,427,396	11,177.13	1,182,540,860	0.375	2024/4/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,910,000	11,862.21	1,175,545,314	11,925.59	1,181,826,936	2.375	2051/5/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,450,000	10,775.89	1,126,080,891	10,605.94	1,108,321,768	0.875	2030/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,800,000	11,028.34	1,080,778,213	10,993.51	1,077,364,626	0.500	2026/2/28	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	10,120,000	10,781.50	1,091,088,452	10,431.73	1,055,691,156	0.625	2030/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,390,000	12,749.01	1,069,642,589	12,348.79	1,036,064,091	2.875	2028/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,230,000	11,189.55	1,032,796,143	11,190.25	1,032,860,139	0.125	2022/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,190,000	11,067.31	1,017,086,019	11,177.57	1,027,218,903	1.250	2028/3/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	9,000,000	11,162.99	1,004,669,641	11,151.77	1,003,660,037	0.250	2024/3/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,890,000	11,197.86	995,490,061	11,156.14	991,781,715	0.375	2024/7/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,760,000	11,192.00	980,420,039	11,196.01	980,770,483	0.125	2022/8/31	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,500,000	11,627.42	988,331,392	11,516.39	978,893,344	1.500	2024/10/31	0.35
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	4,280,000	24,194.26	1,035,514,691	22,468.24	961,640,986	4.500	2041/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,040,000	11,991.48	964,115,038	11,794.00	948,238,122	2.500	2024/5/15	0.34
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,110,000	15,934.49	973,597,899	15,444.97	943,688,095	2.750	2027/10/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,400,000	11,147.81	936,416,145	11,085.76	931,204,117	0.750	2026/5/31	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,300,000	11,129.28	923,730,513	11,124.67	923,347,799	0.250	2024/6/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,600,000	10,263.00	882,618,362	10,656.00	916,416,627	1.875	2051/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	8,360,000	10,911.70	912,218,286	10,927.93	913,575,633	1.875	2041/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,760,000	11,778.69	914,027,044	11,611.70	901,067,920	2.250	2041/5/15	0.32
フランス	国債証券	GOV OF FRANCE	6,080,000	15,392.38	935,857,226	14,785.98	898,988,159	1.500	2031/5/25	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,970,000	11,112.22	885,643,988	11,103.68	884,963,877	0.750	2026/3/31	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	7,920,000	11,183.39	885,725,164	11,147.84	882,909,172	0.375	2024/8/15	0.32

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率（%）
国債証券	99.81
合計	99.81

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	1,166,887,000.00	130,191,075,678	130,558,668,948	47.02
	カナダドル	売建	63,301,000.00	5,563,189,394	5,556,327,566	2.00
	メキシコペソ	売建	364,332,000.00	1,989,460,389	1,975,444,537	0.71
	ユーロ	売建	872,926,000.00	113,821,865,120	113,392,563,644	40.84
	英ポンド	売建	115,926,000.00	17,501,314,140	17,434,621,213	6.28
	スウェーデンクローナ	売建	63,576,000.00	811,852,804	808,050,960	0.29
	ノルウェークローネ	売建	52,861,000.00	680,437,364	675,463,144	0.24
	デンマーククローネ	売建	79,895,000.00	1,401,132,197	1,395,765,650	0.50
	ポーランドズロチ	売建	56,075,000.00	1,576,920,402	1,571,871,970	0.57
	オーストラリアドル	売建	64,838,000.00	5,230,254,527	5,216,742,287	1.88
	シンガポールドル	売建	15,206,000.00	1,248,524,820	1,249,562,173	0.45
	マレーシアリングット	売建	47,280,000.00	1,253,208,720	1,263,189,216	0.45
	イスラエルシェケル	売建	37,027,000.00	1,287,036,303	1,286,914,114	0.46

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M国内株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	56,858,375,480	99.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		526,412,951	0.92
合計（純資産総額）		57,384,788,431	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	771,590,000	1.34

(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	1,034,600	1,642.28	1,699,106,252	2,000.00	2,069,200,000	3.61
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	128,000	10,741.46	1,374,907,446	12,455.00	1,594,240,000	2.78
日本	株式	キーエンス	電気機器	20,100	56,789.93	1,141,477,704	67,000.00	1,346,700,000	2.35
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	159,000	8,584.92	1,365,002,325	6,480.00	1,030,320,000	1.80
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	139,800	5,063.37	707,860,025	6,832.00	955,113,600	1.66
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1,378,100	529.95	730,335,186	657.90	906,651,990	1.58
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	234,400	2,794.24	654,970,558	3,085.00	723,124,000	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	37,000	19,002.55	703,094,648	18,900.00	699,300,000	1.22
日本	株式	HOYA	精密機器	39,900	13,922.44	555,505,480	17,475.00	697,252,500	1.22
日本	株式	日立製作所	電気機器	98,200	4,961.91	487,259,976	6,640.00	652,048,000	1.14
日本	株式	ダイキン工業	機械	26,000	22,970.77	597,240,264	24,460.00	635,960,000	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	11,700	62,033.57	725,792,825	54,310.00	635,427,000	1.11
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	169,900	3,736.84	634,889,320	3,699.00	628,460,100	1.10
日本	株式	日本電産	電気機器	49,200	13,809.45	679,425,212	12,420.00	611,064,000	1.06
日本	株式	村田製作所	電気機器	60,000	9,881.59	592,895,410	9,960.00	597,600,000	1.04
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	12,000	44,816.96	537,803,566	49,670.00	596,040,000	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	160,700	3,333.91	535,760,857	3,691.00	593,143,700	1.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	160,800	3,037.45	488,422,210	3,455.00	555,564,000	0.97
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	139,400	3,556.59	495,789,939	3,944.00	549,793,600	0.96
日本	株式	第一三共	医薬品	160,500	3,225.13	517,634,034	2,979.50	478,209,750	0.83
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	140,700	3,218.59	452,855,704	3,277.00	461,073,900	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	17,900	26,628.48	476,649,864	24,565.00	439,713,500	0.77
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	273,700	1,480.52	405,218,631	1,584.50	433,677,650	0.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	122,500	2,880.41	352,850,580	3,536.00	433,160,000	0.75
日本	株式	S M C	機械	6,000	66,918.17	401,509,034	70,080.00	420,480,000	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	78,700	4,295.26	338,037,022	5,085.00	400,189,500	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	66,300	5,368.81	355,952,108	6,021.00	399,192,300	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	156,200	2,185.37	341,355,460	2,464.00	384,876,800	0.67
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	20,800	16,337.82	339,826,776	18,130.00	377,104,000	0.66
日本	株式	富士通	電気機器	18,400	17,174.29	316,007,086	20,310.00	373,704,000	0.65

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.20
		建設業	2.29

	食料品	3.40
	繊維製品	0.47
	パルプ・紙	0.22
	化学	6.98
	医薬品	5.10
	石油・石炭製品	0.41
	ゴム製品	0.71
	ガラス・土石製品	0.76
	鉄鋼	0.81
	非鉄金属	0.66
	金属製品	0.60
	機械	5.32
	電気機器	18.43
	輸送用機器	7.63
	精密機器	2.94
	その他製品	2.18
	電気・ガス業	1.13
	陸運業	3.27
	海運業	0.48
	空運業	0.48
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.36
	卸売業	4.72
	小売業	4.46
	銀行業	4.96
	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	2.01
	その他金融業	1.13
	不動産業	1.99
	サービス業	5.98
	合 計	99.08

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	取引所	名称	建別	数量	通貨	契約額等（円）	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	38	日本円	779,160,900	771,590,000	1.34

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

R M先進国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	75,934,397,875	62.01
	カナダ	3,895,994,554	3.18
	パナマ	40,803,650	0.03
	ドイツ	3,122,632,279	2.55
	イタリア	631,122,298	0.52
	フランス	3,551,587,850	2.90
	オランダ	2,304,237,271	1.88
	スペイン	840,359,769	0.69
	ベルギー	286,380,014	0.23
	オーストリア	77,091,840	0.06
	ルクセンブルク	100,387,120	0.08
	フィンランド	441,253,979	0.36
	アイルランド	2,072,008,506	1.69
	ポルトガル	50,197,507	0.04
	イギリス	4,627,667,712	3.78
	スイス	3,591,900,282	2.93
	スウェーデン	1,164,713,441	0.95
	ノルウェー	229,084,801	0.19
	デンマーク	907,950,656	0.74
	ケイマン	201,977,635	0.16
	リベリア	45,665,039	0.04
	オーストラリア	2,097,807,650	1.71
	バミューダ	230,952,972	0.19
	ニュージーランド	106,510,838	0.09
	パプアニューギニア	11,378,631	0.01
	香港	782,430,224	0.64
	シンガポール	307,518,913	0.25
	イスラエル	204,256,187	0.17
	キュラソー	90,712,121	0.07
	ジャージー	426,613,074	0.35
マン島	34,844,605	0.03	
小計		108,410,439,293	88.52
投資証券	アメリカ	2,172,276,267	1.77
	カナダ	7,872,535	0.01

	フランス	49,883,262	0.04
	イギリス	69,345,753	0.06
	オーストラリア	153,731,738	0.13
	香港	36,312,016	0.03
	シンガポール	51,088,000	0.04
	小計	2,540,509,571	2.07
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		11,513,106,556	9.40
合計（純資産総額）		122,464,055,420	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	9,566,091,993	7.81
	買建	ドイツ	2,364,828,516	1.93

(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		846,855,662	0.69

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	305,110	15,752.02	4,806,101,143	15,985.53	4,877,346,157	3.98
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	130,855	26,949.25	3,526,444,380	31,785.27	4,159,262,814	3.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	8,301	376,610.74	3,126,245,761	369,461.35	3,066,898,670	2.50
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	メディア・娯楽	43,885	33,130.38	1,453,927,137	38,009.15	1,668,031,600	1.36
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	5,509	233,645.39	1,287,152,468	300,736.87	1,656,759,441	1.35
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	5,335	234,454.54	1,250,815,002	301,111.80	1,606,431,487	1.31
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	15,012	89,394.50	1,341,990,300	87,444.21	1,312,712,559	1.07
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	45,598	17,311.08	789,350,856	22,962.62	1,047,049,839	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	55,456	15,643.71	867,538,063	18,573.12	1,029,991,165	0.84

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	48,283	18,472.31	891,899,013	18,357.11	886,336,748	0.72
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	31,073	23,507.05	730,434,766	25,370.02	788,322,805	0.64
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	17,309	40,718.65	704,799,249	44,813.88	775,683,574	0.63
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CLASS B	各種金融	24,361	27,339.30	666,012,927	31,034.29	756,026,504	0.62
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	19,510	32,943.19	642,721,771	37,709.20	735,706,601	0.60
スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	53,034	12,525.86	664,296,616	13,481.70	714,988,732	0.58
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	44,905	14,833.02	666,076,771	15,894.87	713,759,515	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	141,487	3,777.63	534,486,248	4,820.39	682,023,142	0.56
オランダ	株式	ASML HOLDING NV	半導体・半導体製造装置	7,687	65,881.06	506,427,763	84,110.32	646,556,045	0.53
アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア・娯楽	33,416	19,546.60	653,169,275	19,326.34	645,809,165	0.53
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CLASS A	ソフトウェア・サービス	16,268	37,762.66	614,322,985	39,529.02	643,058,175	0.53
アメリカ	株式	PAYPAL HOLDINGS INC	ソフトウェア・サービス	20,518	29,228.28	599,705,991	28,987.27	594,761,011	0.49
アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア・サービス	8,789	56,923.04	500,296,666	64,656.18	568,263,201	0.46
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	8,169	62,779.56	512,846,284	67,046.79	547,705,270	0.45
アメリカ	株式	SALESFORCE.COM INC	ソフトウェア・サービス	17,892	25,869.27	462,852,991	30,274.35	541,668,849	0.44
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	84,450	5,742.03	484,915,152	6,259.68	528,630,449	0.43
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	12,947	39,074.00	505,891,105	40,525.43	524,682,794	0.43
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	77,935	5,612.88	437,440,328	6,701.76	522,302,414	0.43
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	102,891	4,251.99	437,492,083	4,871.87	501,272,358	0.41
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	77,523	5,317.08	412,196,046	6,209.32	481,365,238	0.39
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	7,230	58,061.64	419,785,674	64,868.83	469,001,655	0.38

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	3.07

	素材	3.66
	資本財	5.72
	商業・専門サービス	1.14
	運輸	1.74
	自動車・自動車部品	1.93
	耐久消費財・アパレル	1.70
	消費者サービス	1.73
	メディア・娯楽	6.82
	小売	5.22
	食品・生活必需品小売り	1.27
	食品・飲料・タバコ	3.42
	家庭用品・パーソナル用品	1.55
	ヘルスケア機器・サービス	4.71
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.87
	銀行	5.64
	各種金融	4.29
	保険	2.75
	不動産	0.34
	ソフトウェア・サービス	11.28
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.40
	電気通信サービス	1.49
	公益事業	2.56
	半導体・半導体製造装置	4.23
投資証券		2.07
合計		90.60

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	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	SP500MIN2112	買建	393	米ドル	87,108,715	9,749,207,383	85,472,587.5	9,566,091,993	7.81
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	STX E6002112	買建	804	ユーロ	18,586,973	2,413,704,317	18,210,600	2,364,828,516	1.93

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

資産の種類	名称	建別	数量	契約額等(円)	評価額(円)	投資 比率 (%)
-------	----	----	----	---------	--------	-----------------

為替予約取引	米ドル	買建	5,736,000.00	639,991,874	641,952,306	0.52
	カナダドル	買建	295,000.00	25,926,474	25,902,986	0.02
	ユーロ	買建	759,000.00	98,634,943	98,567,022	0.08
	英ポンド	買建	231,000.00	34,881,822	34,748,389	0.03
	スイスフラン	買建	98,000.00	11,752,142	11,748,748	0.01
	スウェーデンクローナ	買建	273,000.00	3,484,041	3,469,830	0.00
	ノルウェークローネ	買建	90,000.00	1,160,991	1,150,200	0.00
	オーストラリアドル	買建	189,000.00	15,213,611	15,206,940	0.01
	香港ドル	買建	327,000.00	4,697,122	4,701,737	0.00
	シンガポールドル	買建	21,000.00	1,727,262	1,726,141	0.00
	イスラエルシェケル	買建	221,000.00	7,686,386	7,681,363	0.01

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国株式マザーファンド

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	57,356,912	0.33
	アルゼンチン	963,295	0.01
	メキシコ	280,655,532	1.62
	ブラジル	676,444,219	3.89
	チリ	65,631,592	0.38
	コロンビア	25,488,197	0.15
	ペルー	2,422,905	0.01
	オランダ	54,803,576	0.32
	ルクセンブルク	37,898,089	0.22
	ギリシャ	27,494,894	0.16
	トルコ	39,126,715	0.23
	チェコ	18,112,696	0.10
	キプロス	25,689,512	0.15
	ハンガリー	38,641,006	0.22
	ポーランド	103,351,494	0.60
	ロシア	493,568,446	2.84
	ケイマン	3,180,343,880	18.31
	バミューダ	95,995,844	0.55
	香港	169,149,853	0.97
	シンガポール	3,314,230	0.02
マレーシア	202,091,757	1.16	
タイ	246,641,663	1.42	

	フィリピン	98,079,974	0.56
	インドネシア	200,933,855	1.16
	韓国	1,902,578,517	10.95
	台湾	2,165,774,664	12.47
	中国	1,702,624,221	9.80
	インド	1,851,661,353	10.66
	カタール	110,690,711	0.64
	エジプト	9,682,041	0.06
	南アフリカ	454,133,749	2.61
	ジャージー	11,627,753	0.07
	英ヴァージン諸島	3,898,688	0.02
	アラブ首長国連邦	122,690,371	0.71
	マン島	6,159,868	0.04
	クウェート	89,629,948	0.52
	サウジアラビア	500,392,880	2.88
	小計	15,075,744,900	86.80
投資証券	メキシコ	7,264,848	0.04
	南アフリカ	6,676,186	0.04
	小計	13,941,034	0.08
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		2,278,512,966	13.12
合計(純資産総額)		17,368,198,900	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,316,704,800	13.34

(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		207,189,634	1.19
	売建		142,508	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

国・地域	種類	銘柄名	業種	数量又は額面総額	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	半導体・半導体製造装置	421,700	2,572.30	1,084,739,821	2,335.31	984,801,070	5.67

ケイマン	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	メディア・ 娯楽	98,700	9,409.21	928,689,805	6,686.70	659,977,290	3.80
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	81,869	8,036.52	657,942,095	7,017.27	574,496,878	3.31
ケイマン	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD	小売	260,340	3,400.34	885,245,177	2,132.55	555,189,108	3.20
ケイマン	株式	MEITUAN	小売	69,200	4,942.13	341,995,711	3,595.00	248,774,000	1.43
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LTD	エネルギー	49,019	3,126.84	153,274,911	3,817.05	187,108,145	1.08
インド	株式	INFOSYS LTD	ソフトウェア・サービス	58,534	2,108.66	123,428,528	2,555.29	149,571,784	0.86
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	1,654,000	85.96	142,181,199	80.09	132,479,776	0.76
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	銀行	29,449	3,925.49	115,601,780	4,147.13	122,129,111	0.70
ケイマン	株式	JD.COM INC-ADR	小売	14,947	10,144.43	151,628,845	8,015.71	119,810,823	0.69
ロシア	株式	GAZPROM PAO -SPON ADR	エネルギー	102,058	698.11	71,248,590	1,106.44	112,921,167	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	62,000	1,744.27	108,144,996	1,809.00	112,158,248	0.65
ブラジル	株式	VALE SA	素材	68,100	2,016.44	137,319,806	1,566.64	106,688,835	0.61
台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	26,000	3,640.65	94,656,943	3,676.10	95,578,683	0.55
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	14,152	7,222.05	102,206,534	6,676.34	94,483,705	0.54
インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	88,079	859.46	75,700,800	1,071.34	94,362,996	0.54
ロシア	株式	SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	銀行	46,567	1,675.42	78,019,554	2,023.51	94,228,958	0.54
ケイマン	株式	NIO INC - ADR	自動車・自動車部品	23,442	6,281.50	147,251,040	3,931.74	92,168,074	0.53
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	ソフトウェア・サービス	15,906	5,027.74	79,971,259	5,725.76	91,074,082	0.52
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	214,800	481.02	103,323,484	422.77	90,811,426	0.52
韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	9,376	11,914.98	111,714,919	9,470.00	88,790,720	0.51
中国	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	109,000	1,298.91	141,581,444	784.42	85,502,761	0.49
ケイマン	株式	BAIDU INC - SPON ADR	メディア・娯楽	4,787	25,956.18	124,252,268	17,002.88	81,392,817	0.47
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	247,800	417.51	103,459,312	316.36	78,394,008	0.45
ロシア	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	エネルギー	7,204	8,796.45	63,369,631	10,791.32	77,740,715	0.45
韓国	株式	NAVER CORP	メディア・娯楽	2,118	34,315.41	72,680,056	36,648.89	77,622,370	0.45
サウジアラビア	株式	AL RAJHI BANK	銀行	21,069	2,455.98	51,745,156	3,616.69	76,200,042	0.44
ケイマン	株式	PINDUODUO INC-ADR	小売	7,561	17,036.23	128,810,945	9,967.59	75,364,987	0.43
南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	小売	3,738	24,835.23	92,834,091	18,929.70	70,759,219	0.41
サウジアラビア	株式	THE SAUDI NATIONAL BANK	銀行	37,761	1,397.65	52,776,682	1,799.37	67,946,313	0.39

ロ. 種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	エネルギー	5.11
		素材	7.49
		資本財	2.56
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	1.57
		自動車・自動車部品	3.16
		耐久消費財・アパレル	1.52
		消費者サービス	0.95
		メディア・娯楽	6.57
		小売	7.26
		食品・生活必需品小売り	1.09
		食品・飲料・タバコ	3.13
		家庭用品・パーソナル用品	0.91
		ヘルスケア機器・サービス	1.00
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3.27
		銀行	12.42
		各種金融	2.21
		保険	2.27
		不動産	1.70
		ソフトウェア・サービス	2.61
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.38		
電気通信サービス	2.41		
公益事業	1.94		
半導体・半導体製造装置	8.22		
投資証券			0.08
合計			86.88

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 2112	買建	335	米ドル	21,549,315	2,411,799,325	20,699,650	2,316,704,800	13.34

(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	1,851,272.05	206,145,808	207,189,634	1.19
	ブラジルレアル	売建	6,759.71	138,965	139,710	0.00
	オフショア人民元	売建	162.00	2,796	2,798	0.00

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

R M新興国債券マザーファンド

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資信託受益証券	アメリカ	1,961,758,060	29.60
	アイルランド	4,638,369,334	69.99
	小計	6,600,127,394	99.60
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		26,769,113	0.40
合計（純資産総額）		6,626,896,507	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	774,647	6,424.63	4,976,823,840	5,987.71	4,638,369,334	69.99
アメリカ	投資信託受益証券	VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	586,032	3,585.57	2,101,263,589	3,347.52	1,961,758,060	29.60

ロ.種類別の投資比率

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.60
合計	99.60

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

RM国内リートマザーファンド

以下の運用状況は2021年 9月30日現在です。

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

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	31,975,123,600	98.85
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		370,843,509	1.15
合計（純資産総額）		32,345,967,109	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	460,272,000	1.42

(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	3,191	636,406.19	2,030,772,175	725,000	2,313,475,000	7.15
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,815	634,319.6	1,785,609,676	668,000	1,880,420,000	5.81
日本	投資証券	G L P 投資法人	9,118	176,889.26	1,612,876,316	183,200	1,670,417,600	5.16
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	4,460	341,534.97	1,523,245,983	372,500	1,661,350,000	5.14
日本	投資証券	日本都市ファンド投資法人	14,205	101,865.24	1,446,995,791	107,300	1,524,196,500	4.71
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	9,104	161,563.86	1,470,877,463	160,600	1,462,102,400	4.52
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	4,227	290,288.79	1,227,050,718	326,500	1,380,115,500	4.27
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	5,610	182,457.71	1,023,587,767	194,000	1,088,340,000	3.36
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	2,815	328,038.37	923,428,029	362,000	1,019,030,000	3.15
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	6,338	144,467.39	915,634,356	150,800	955,770,400	2.95
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	3,997	195,690.21	782,173,789	202,700	810,191,900	2.50
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	8,281	81,665.74	676,274,026	92,400	765,164,400	2.37
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	1,850	387,363.96	716,623,341	405,000	749,250,000	2.32
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	1,500	446,458.26	669,687,398	457,000	685,500,000	2.12
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	871	707,147.66	615,925,620	767,000	668,057,000	2.07
日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人	3,447	170,849.76	588,919,126	187,500	646,312,500	2.00

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	1,047	547,994.3	573,750,040	590,000	617,730,000	1.91
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,840	316,613.17	582,568,237	331,000	609,040,000	1.88
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	972	593,839.04	577,211,554	625,000	607,500,000	1.88
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,625	58,083.93	500,973,947	67,100	578,737,500	1.79
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	12,392	38,540.01	477,587,914	43,900	544,008,800	1.68
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	3,311	150,731.79	499,072,987	151,000	499,961,000	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	3,311	145,223.88	480,836,297	149,800	495,987,800	1.53
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	987	449,182.5	443,343,130	489,000	482,643,000	1.49
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	595	702,172.71	417,792,767	752,000	447,440,000	1.38
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,268	315,345.52	399,858,124	343,500	435,558,000	1.35
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	2,475	166,447.98	411,958,753	175,500	434,362,500	1.34
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	1,923	198,678.14	382,058,080	217,200	417,675,600	1.29
日本	投資証券	大和証券リビング投資法人	3,682	104,141.44	383,448,811	111,800	411,647,600	1.27
日本	投資証券	N T T 都市開発リート投資法人	2,543	140,416.86	357,080,077	153,400	390,096,200	1.21

ロ. 種類別の投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.85
合計	98.85

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	223	日本円	476,326,030	460,272,000	1.42

(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 9月30日現在です。

・投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

投資状況

資産の種類	国・地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	68,099,571	0.26
	オーストラリア	26,146,824	0.10
	小計	94,246,395	0.36

投資証券	アメリカ	19,388,742,232	75.02
	カナダ	510,273,133	1.97
	ドイツ	68,307,049	0.26
	イタリア	6,893,387	0.03
	フランス	504,371,875	1.95
	オランダ	43,346,176	0.17
	スペイン	111,028,992	0.43
	ベルギー	343,053,360	1.33
	アイルランド	26,953,653	0.10
	イギリス	1,399,095,138	5.41
	オーストラリア	1,726,544,134	6.68
	ニュージーランド	103,564,450	0.40
	香港	346,820,579	1.34
	シンガポール	922,029,988	3.57
	韓国	42,412,715	0.16
	イスラエル	17,194,167	0.07
ガーンジー	67,445,621	0.26	
小計	25,628,076,649	99.16	
コール・ローン等・その他資産(負債控除後)		123,740,101	0.48
合計（純資産総額）		25,846,063,145	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		202,646,846	0.78

(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	112,532	11,983.34	1,348,509,754	14,151.16	1,592,458,877	6.16
アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	13,661	81,999.73	1,120,198,328	89,712.83	1,225,567,020	4.74
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	23,231	27,288.02	633,928,021	33,835.65	786,036,087	3.04
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	50,078	11,772.61	589,548,801	14,980.49	750,193,078	2.90
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,054	16,094.11	692,915,891	16,425.37	707,178,276	2.74
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	64,353	7,703.20	495,724,428	9,377.77	603,488,070	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,291	20,014.72	426,133,535	25,182.00	536,149,962	2.07
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	51,933	7,478.39	388,375,747	9,127.07	473,996,438	1.83
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,030	19,529.32	410,701,725	21,582.65	453,883,188	1.76

オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	256,444	1,489.24	381,907,075	1,710.57	438,667,875	1.70
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	59,048	7,019.56	414,491,466	7,392.31	436,501,475	1.69
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	20,407	14,434.37	294,562,253	19,251.35	392,862,487	1.52
アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	87,899	3,602.29	316,638,319	4,359.28	383,176,704	1.48
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	59,987	5,716.25	342,901,246	6,313.40	378,722,358	1.47
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,688	16,234.38	287,153,845	21,259.20	376,032,800	1.45
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	17,683	17,546.53	310,275,412	21,145.04	373,907,841	1.45
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,851	29,364.75	289,272,219	36,254.24	357,140,573	1.38
イギリス	投資証券	SEGRO PLC	183,363	1,517.43	278,240,899	1,814.18	332,654,551	1.29
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	57,804	4,740.83	274,039,322	5,441.55	314,543,379	1.22
アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	82,251	3,518.09	289,366,442	3,806.39	313,080,141	1.21
アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	93,062	3,110.26	289,447,340	3,231.13	300,695,457	1.16
香港	投資証券	LINK REIT	317,600	1,006.35	319,617,140	938.29	298,002,492	1.15
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	21,687	10,918.16	236,782,268	12,447.74	269,954,189	1.04
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	15,396	12,489.00	192,280,693	16,798.07	258,623,129	1.00
アメリカ	投資証券	UDR INC	42,586	4,709.33	200,551,897	5,991.07	255,136,031	0.99
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	28,113	7,816.08	219,733,596	8,276.48	232,676,795	0.90
アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,091	7,457.01	194,561,004	8,888.68	231,914,717	0.90
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORP	93,907	1,968.93	184,897,168	2,400.68	225,441,032	0.87
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	44,169	3,826.17	168,998,289	4,959.17	219,041,809	0.85
アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	90,917	2,387.87	217,098,453	2,314.50	210,427,906	0.81

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			99.16
合計			99.52

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	1,410,000.00	157,262,620	157,803,438	0.61
	ユーロ	買建	76,000.00	9,868,941	9,869,629	0.04
	英ポンド	買建	67,000.00	10,130,008	10,078,646	0.04
	オーストラリアドル	買建	195,000.00	15,718,285	15,689,700	0.06
	香港ドル	買建	120,000.00	1,721,280	1,725,432	0.01
	シンガポールドル	買建	91,000.00	7,469,993	7,480,001	0.03

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本書提出日現在、取得申込みの受付は行なってありません。

2【換金（解約）手続等】

（1）解約の受付

販売会社の営業日に受け付けます。

（2）取扱時間

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

（3）解約請求不可日

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

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

（4）解約制限

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

（5）解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

委託会社の照会先

りそなアセットマネジメント株式会社

電話番号：0120-223351

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時）

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

（6）手取額

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

（7）解約単位

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

（8）解約代金の支払い

原則として、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

（9）受付の中止および取消

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

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

- ・解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日（この計算日が解約請求を受け付けない日であるときは、この計算日以降の最初の解約

請求を受け付けることができる日とします。)に解約請求を受け付けたものとして取り扱います。

- ・また基準価額が『確保ライン』まで下落した場合は、償還日までの一定期間において解約請求の受付を中止する場合があります。

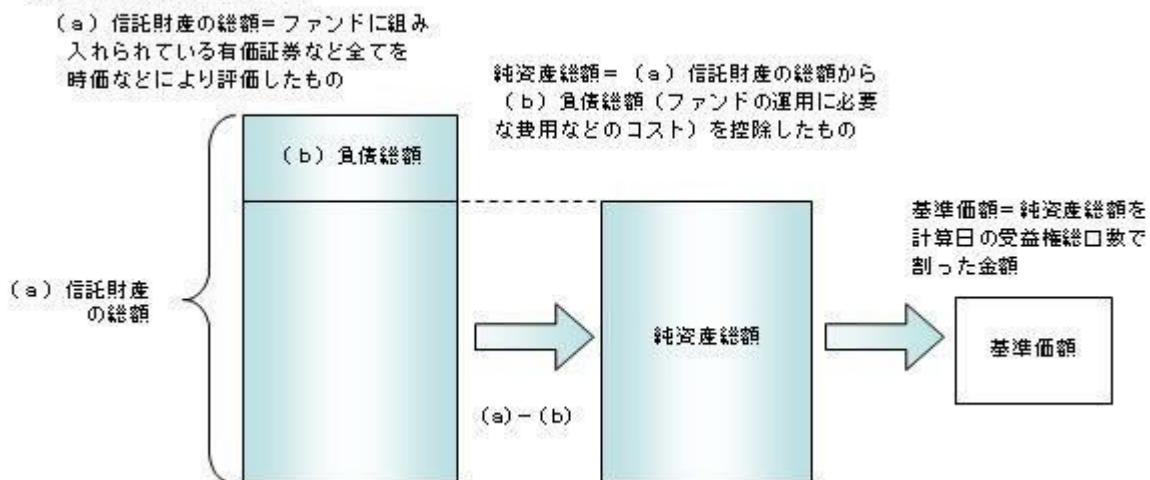
3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出

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

<基準価額算出の流れ>



有価証券などの評価基準

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

<主な資産の評価方法>

マザーファンド受益証券

基準価額計算日の基準価額で評価します。

国内上場株式

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

外国株式

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

公社債(国内・外国)

原則として、基準価額計算日^{*}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】

2029年9月18日までとします（2019年10月31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9月16日から翌年9月15日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始されます。

（５）【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 1) 委託会社は、次のいずれかの場合には、受託会社と合意の上、信託契約を解約し繰上償還させることができます。
 - イ) 信託財産の純資産総額が10億円を下回ることとなったとき
 - ロ) 繰上償還することが受益者のために有利であると認めるとき
 - ハ) やむを得ない事情が発生したとき
- 2) この場合、委託会社は書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、次のいずれかの場合には、後述の「書面決議」の規定は適用せず、信託契約を解約し繰上償還させます。
 - イ) 基準価額が『確保ライン』まで下落した場合
 - ロ) 基準価額と『確保ライン』との差が20営業日連続して 50円未満となった場合
 - ハ) 保証会社が破綻したとき、または保証会社による保証契約の継続・履行が困難となったとき
 - ニ) 信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合で、書面決議が困難な場合
 - ホ) 監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたとき
 - ヘ) 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したとき（監督官庁がこの信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、書面決議で可決された場合、存続します。）
 - ト) 受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した場合またはその任務に違反するなどして解任された場合に、委託会社が新受託会社を選任できないとき
- 4) 繰上償還を行なう際には、委託会社は、その旨をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

償還金について

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

信託約款の変更など

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

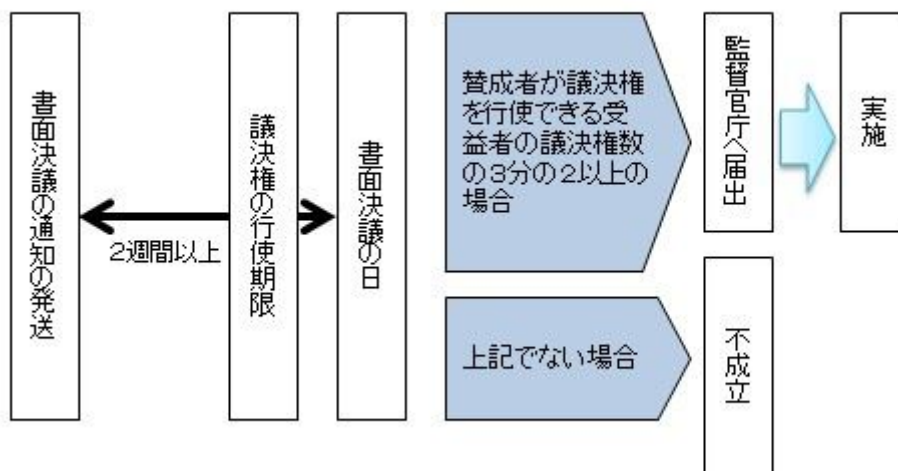
と、または当ファンドと他のファンドとの併合（以下「併合」といいます。）を行なうことができます。信託約款の変更または併合を行なう際には、委託会社は、その旨および内容をあらかじめ監督官庁に届け出ます。

- 2) この変更事項のうち、その内容が重大なもの（保証会社を変更する場合があります。以下同じ。）または併合（受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものを除きます。）については、書面決議を行いません。（後述の「書面決議」をご覧ください。）
- 3) 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、後述の「書面決議」の規定を適用します。

書面決議

- 1) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に対して、委託会社は書面決議を行いません。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびにその内容および理由などの事項を定め、決議の日の2週間前までに知れている受益者に対し書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- 2) 受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、書面決議について賛成するものとみなします。
- 3) 書面決議は、議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行いません。
- 4) 繰上償還、信託約款の重大な変更または併合に関する委託会社の提案に対して、すべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときは、書面決議を行いません。
- 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年間請求を行なわない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(2) 解約請求権

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

(3) 帳簿閲覧権

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

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2020年9月16日から2021年9月15日まで)の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

1【財務諸表】

【りそな・リスクコントロールファンド2019-10】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 2020年 9月15日現在	第2期 2021年 9月15日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,186,222,319	133,475,110
親投資信託受益証券	17,447,542,052	17,707,580,860
未収入金	-	44,404,000
流動資産合計	21,633,764,371	17,885,459,970
資産合計	21,633,764,371	17,885,459,970
負債の部		
流動負債		
未払解約金	23,883,040	41,588,729
未払受託者報酬	2,676,211	2,929,238
未払委託者報酬	32,454,339	95,960,205
未払利息	11,354	362
その他未払費用	18,788,651	21,066,608
流動負債合計	77,813,595	161,545,142
負債合計	77,813,595	161,545,142
純資産の部		
元本等		
元本	22,315,753,854	17,900,332,292
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	759,803,078	176,417,464
元本等合計	21,555,950,776	17,723,914,828
純資産合計	21,555,950,776	17,723,914,828
負債純資産合計	21,633,764,371	17,885,459,970

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期		第2期	
	自	2019年10月31日	自	2020年 9月16日
	至	2020年 9月15日	至	2021年 9月15日
営業収益				
有価証券売買等損益		631,432,346		704,031,434
営業収益合計		631,432,346		704,031,434
営業費用				
支払利息		2,075,016		3,120,039
受託者報酬		6,943,086		6,475,678
委託者報酬		172,771,029		180,140,843
その他費用		48,038,494		44,070,264
営業費用合計		229,827,625		233,806,824
営業利益又は営業損失()		861,259,971		470,224,610
経常利益又は経常損失()		861,259,971		470,224,610
当期純利益又は当期純損失()		861,259,971		470,224,610
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		-		-
期首剰余金又は期首欠損金()		-		759,803,078
剰余金増加額又は欠損金減少額		101,456,893		113,161,004
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		101,456,893		113,161,004
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		759,803,078		176,417,464

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2020年 9月15日現在	第2期 2021年 9月15日現在		
1. 投資信託財産に係る元本の状況	1. 投資信託財産に係る元本の状況		
設定年月日	2019年10月31日	設定年月日	2019年10月31日
設定元本額	26,468,299,071円	設定元本額	26,468,299,071円
期首元本額	26,468,299,071円	期首元本額	22,315,753,854円
元本残存率	84.3%	元本残存率	67.6%
2. 計算期間の末日における受益権の総数	22,315,753,854口	2. 計算期間の末日における受益権の総数	17,900,332,292口
3. 元本の欠損		3. 元本の欠損	
純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	759,803,078円	純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額	176,417,464円
4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	0.9660円	4. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	0.9901円
1口当たり純資産額		1口当たり純資産額	
(10,000口当たり純資産額)	(9,660円)	(10,000口当たり純資産額)	(9,901円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日	第2期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日		
分配金の計算過程	分配金の計算過程		
A 当ファンドの配当等収益額	2,075,016円	A 当ファンドの配当等収益額	3,120,039円
B 親ファンドの配当等収益額	220,274,758円	B 親ファンドの配当等収益額	201,642,715円
R A M国内株式マザーファンド	2,116,669円	R M国内株式マザーファンド	5,360,943円
R A M国内リートマザーファンド	6,176,560円	R M国内リートマザーファンド	6,178,871円
R A M先進国株式マザーファンド	26,783,651円	R M先進国株式マザーファンド	27,231,540円
R A M新興国株式マザーファンド	3,702,608円	R M新興国株式マザーファンド	5,749,968円
R A M先進国リートマザーファンド	9,597,617円	R M先進国リートマザーファンド	10,165,998円
R A M国内債券マザーファンド	13,988,273円	R M国内債券マザーファンド	13,188,099円

R A M新興国債券マザーファン ド	11,821,242円	R M新興国債券マザーファンド	7,911,033円
R A M先進国債券マザーファン ド(為替ヘッジあり)	147,624,879円	R M先進国債券マザーファンド (為替ヘッジあり)	127,069,681円
R A Mマネーマザーファンド	1,536,741円	R Mマネーマザーファンド	1,213,418円
C 配当等収益額合計(A+B)	218,199,742円	C 配当等収益額合計(A+B)	198,522,676円
D 経費	227,752,609円	D 経費	230,686,785円
E 差引配当等収益額(C-D)	9,552,867円	E 差引配当等収益額(C-D)	32,164,109円
F 当ファンドの当期末残存受益権 口数	22,315,753,854口	F 当ファンドの当期末残存受益権 口数	17,900,332,292口
G 当ファンドの期中平均残存受益 権口数	24,303,640,765口	G 当ファンドの期中平均残存受益 権口数	20,146,336,780口
H 分配対象配当等収益額(E×F/G)	0円	H 分配対象配当等収益額(E×F/G)	0円
I 元本超過額	0円	I 元本超過額	0円
J 分配可能額(H<I)	0円	J 分配可能額(H<I)	0円
K 10,000口当たり分配可能額 (J/F×10,000)	0円	K 10,000口当たり分配可能額 (J/F×10,000)	0円
L 10,000口当たりの分配額	0円	L 10,000口当たりの分配額	0円
M 収益分配金金額(L×F/10,000)	0円	M 収益分配金金額(L×F/10,000)	0円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日	第2期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、リートの価格変動リスク、投資信託受益証券の価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>運用リスクを管理する部門では、信託財産の運用成果とその内容について、客観的に把握するため、定期的にパフォーマンス分析と評価を実施し、運用評価委員会に報告します。</p> <p>また、運用ガイドライン等の遵守状況及び運用事務状況をモニタリングし、定期的にコンプライアンス・リスク管理委員会に報告します。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

金融商品の時価等に関する事項

第1期 2020年 9月15日現在	第2期 2021年 9月15日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>同左</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>親投資信託受益証券</p> <p>同左</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明</p> <p>同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日	第2期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日
該当事項はありません。	同左

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 有価証券に関する注記

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2019年10月31日 至 2020年 9月15日	第2期 自 2020年 9月16日 至 2021年 9月15日

	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）	計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	202,549,293	284,678,063
合計	202,549,293	284,678,063

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	2,581,182,438	2,722,889,353	
	R M先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）	10,344,998,421	10,912,938,834	
	R M国内株式マザーファンド	273,351,331	415,220,671	
	R M先進国株式マザーファンド	1,272,826,957	2,438,100,036	
	R M新興国株式マザーファンド	246,078,063	406,767,038	
	R M新興国債券マザーファンド	186,487,931	205,752,134	
	R M国内リートマザーファンド	134,125,257	204,795,854	
	R M先進国リートマザーファンド	298,939,440	401,116,940	
合計		15,337,989,838	17,707,580,860	

(注) 券面総額欄の数値は口数を表しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査意見の対象外となっております。

RM国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
金銭信託	809,482
コール・ローン	1,006,287,509
国債証券	94,886,324,400
地方債証券	6,015,814,540
特殊債券	6,862,446,055
社債券	4,746,783,000
未収入金	167,021,300
未収利息	245,075,152
前払費用	21,922,344
流動資産合計	113,952,483,782
資産合計	113,952,483,782
負債の部	
流動負債	
未払金	568,737,400
未払解約金	30,410,000
未払利息	2,729
流動負債合計	599,150,129
負債合計	599,150,129
純資産の部	
元本等	
元本	107,454,317,590
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	5,899,016,063
元本等合計	113,353,333,653
純資産合計	113,353,333,653
負債純資産合計	113,952,483,782

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	83,995,022,050円
期中追加設定元本額	51,337,855,614円
期中一部解約元本額	27,878,560,074円
期末元本額	107,454,317,590円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	6,975,224,505円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,053,190,022円
りそなラップ型ファンド(成長型)	203,299,366円
DCりそな グローバルバランス	591,560,430円
つみたてバランスファンド	3,220,110,504円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,699,588,625円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	633,587,324円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	185,370,683円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	175,712,275円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	51,965,388円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	11,297,643円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	8,180,167円
リスクコントロール・オープン	87,995,298円
FWりそな円建債券アクティブファンド	1,042,802,434円
FWりそな国内債券インデックスファンド	61,209,621,683円
Smart-i 国内債券インデックス	1,283,432,625円
Smart-i 8資産バランス 安定型	879,736,609円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	606,298,099円
Smart-i 8資産バランス 成長型	238,949,639円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,320,859,146円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	4,346,142,271円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	2,581,182,438円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	1,873,278,621円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,125,882,221円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	362,137,957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)	14,350,093円

りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,018,273,318円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	2,654,112,070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)	131,674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)	38,749円
りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	5,713円
2. 計算日における受益権の総数	107,454,317,590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	1.0549円
(10,000口当たり純資産額)	(10,549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 9月15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 9月15日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 9月15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 9月15日現在
	損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	9,726,920
地方債証券	1,344,580
特殊債券	5,596,481
社債券	9,690,000
合計	12,475,859

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

2 デリバティブ取引に関する注記

該当事項はありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第4 1 7 回利付国債（2年）	350,000,000	350,836,500	
	第4 1 8 回利付国債（2年）	440,000,000	441,139,600	
	第4 2 0 回利付国債（2年）	820,000,000	822,435,400	
	第4 2 1 回利付国債（2年）	600,000,000	601,902,000	
	第4 2 3 回利付国債（2年）	970,000,000	972,095,200	
	第4 2 4 回利付国債（2年）	600,000,000	601,362,000	
	第4 2 5 回利付国債（2年）	350,000,000	350,836,500	
	第4 2 6 回利付国債（2年）	470,000,000	471,179,700	
	第4 2 7 回利付国債（2年）	570,000,000	571,499,100	
	第1 3 4 回利付国債（5年）	830,000,000	832,299,100	
	第1 3 5 回利付国債（5年）	1,000,000,000	1,003,390,000	
	第1 3 6 回利付国債（5年）	1,180,000,000	1,184,779,000	
	第1 3 7 回利付国債（5年）	1,070,000,000	1,074,954,100	
	第1 3 8 回利付国債（5年）	1,240,000,000	1,246,460,400	
	第1 3 9 回利付国債（5年）	1,680,000,000	1,689,710,400	
	第1 4 0 回利付国債（5年）	1,590,000,000	1,600,112,400	
	第1 4 1 回利付国債（5年）	680,000,000	684,726,000	
	第1 4 2 回利付国債（5年）	1,050,000,000	1,057,906,500	
	第1 4 3 回利付国債（5年）	1,010,000,000	1,017,999,200	
	第1 4 4 回利付国債（5年）	1,360,000,000	1,371,546,400	
	第1 4 5 回利付国債（5年）	1,020,000,000	1,029,251,400	
	第1 4 6 回利付国債（5年）	1,230,000,000	1,241,586,600	
	第1 4 7 回利付国債（5年）	790,000,000	794,289,700	
	第1 4 8 回利付国債（5年）	820,000,000	824,510,000	
	第1 回利付国債（40年）	40,000,000	57,991,200	
	第2 回利付国債（40年）	100,000,000	140,767,000	
	第3 回利付国債（40年）	110,000,000	155,492,700	
	第4 回利付国債（40年）	170,000,000	241,515,600	
	第5 回利付国債（40年）	170,000,000	233,479,700	
	第6 回利付国債（40年）	210,000,000	283,842,300	
	第7 回利付国債（40年）	230,000,000	299,225,400	
	第8 回利付国債（40年）	250,000,000	304,520,000	
	第9 回利付国債（40年）	420,000,000	383,909,400	
	第1 0 回利付国債（40年）	390,000,000	416,325,000	
第1 1 回利付国債（40年）	300,000,000	310,527,000		
第1 2 回利付国債（40年）	360,000,000	336,610,800		
第1 3 回利付国債（40年）	370,000,000	344,418,200		

第14回利付国債(40年)	190,000,000	188,829,600
第326回利付国債(10年)	280,000,000	282,878,400
第327回利付国債(10年)	387,000,000	391,465,980
第328回利付国債(10年)	411,000,000	415,463,460
第329回利付国債(10年)	297,000,000	301,841,100
第330回利付国債(10年)	257,000,000	261,790,480
第331回利付国債(10年)	90,000,000	91,314,900
第332回利付国債(10年)	652,000,000	662,712,360
第333回利付国債(10年)	225,000,000	229,101,750
第334回利付国債(10年)	261,000,000	266,274,810
第335回利付国債(10年)	345,000,000	351,568,800
第336回利付国債(10年)	210,000,000	214,330,200
第337回利付国債(10年)	170,000,000	172,391,900
第338回利付国債(10年)	631,000,000	642,667,190
第339回利付国債(10年)	385,000,000	392,630,700
第340回利付国債(10年)	934,000,000	953,763,440
第341回利付国債(10年)	440,000,000	447,911,200
第342回利付国債(10年)	380,000,000	383,701,200
第343回利付国債(10年)	780,000,000	788,018,400
第344回利付国債(10年)	960,000,000	970,156,800
第345回利付国債(10年)	970,000,000	980,776,700
第346回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,163,052,500
第347回利付国債(10年)	500,000,000	505,935,000
第348回利付国債(10年)	960,000,000	971,606,400
第349回利付国債(10年)	950,000,000	961,666,000
第350回利付国債(10年)	930,000,000	941,559,900
第351回利付国債(10年)	260,000,000	263,268,200
第352回利付国債(10年)	970,000,000	982,648,800
第353回利付国債(10年)	960,000,000	972,614,400
第354回利付国債(10年)	560,000,000	567,397,600
第355回利付国債(10年)	640,000,000	648,486,400
第356回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,033,127,400
第357回利付国債(10年)	820,000,000	830,200,800
第358回利付国債(10年)	430,000,000	435,138,500
第359回利付国債(10年)	990,000,000	1,001,295,900
第360回利付国債(10年)	710,000,000	717,362,700
第361回利付国債(10年)	980,000,000	989,074,800
第362回利付国債(10年)	930,000,000	937,495,800
第363回利付国債(10年)	600,000,000	604,086,000
第1回利付国債(30年)	60,000,000	73,723,800
第7回利付国債(30年)	40,000,000	49,502,800
第11回利付国債(30年)	50,000,000	59,297,500

第12回利付国債(30年)	40,000,000	49,465,200
第13回利付国債(30年)	90,000,000	110,510,100
第14回利付国債(30年)	60,000,000	76,855,800
第15回利付国債(30年)	160,000,000	207,592,000
第16回利付国債(30年)	100,000,000	130,156,000
第17回利付国債(30年)	50,000,000	64,668,500
第18回利付国債(30年)	60,000,000	77,026,800
第19回利付国債(30年)	100,000,000	128,723,000
第20回利付国債(30年)	100,000,000	131,886,000
第21回利付国債(30年)	90,000,000	116,527,500
第22回利付国債(30年)	50,000,000	66,352,500
第23回利付国債(30年)	160,000,000	212,907,200
第24回利付国債(30年)	170,000,000	226,815,700
第25回利付国債(30年)	200,000,000	261,612,000
第26回利付国債(30年)	145,000,000	192,399,050
第27回利付国債(30年)	215,000,000	290,140,350
第28回利付国債(30年)	110,000,000	149,234,800
第29回利付国債(30年)	70,000,000	94,249,400
第30回利付国債(30年)	190,000,000	253,627,200
第31回利付国債(30年)	130,000,000	171,912,000
第32回利付国債(30年)	215,000,000	289,125,550
第33回利付国債(30年)	290,000,000	375,625,400
第34回利付国債(30年)	315,000,000	420,641,550
第35回利付国債(30年)	406,000,000	529,298,140
第36回利付国債(30年)	365,000,000	477,489,350
第37回利付国債(30年)	380,000,000	491,427,400
第38回利付国債(30年)	250,000,000	319,310,000
第39回利付国債(30年)	250,000,000	324,737,500
第40回利付国債(30年)	205,000,000	262,262,650
第41回利付国債(30年)	285,000,000	358,894,800
第42回利付国債(30年)	250,000,000	315,152,500
第43回利付国債(30年)	130,000,000	164,054,800
第44回利付国債(30年)	230,000,000	290,554,400
第45回利付国債(30年)	290,000,000	354,116,100
第46回利付国債(30年)	320,000,000	391,011,200
第47回利付国債(30年)	320,000,000	398,560,000
第48回利付国債(30年)	283,000,000	340,151,850
第49回利付国債(30年)	290,000,000	348,730,800
第50回利付国債(30年)	310,000,000	329,942,300
第51回利付国債(30年)	300,000,000	284,274,000
第52回利付国債(30年)	270,000,000	267,912,900
第53回利付国債(30年)	260,000,000	263,759,600
第54回利付国債(30年)	270,000,000	286,378,200

第55回利付国債(30年)	180,000,000	190,798,200	
第56回利付国債(30年)	280,000,000	296,601,200	
第57回利付国債(30年)	280,000,000	296,399,600	
第58回利付国債(30年)	450,000,000	475,474,500	
第59回利付国債(30年)	280,000,000	288,786,400	
第60回利付国債(30年)	230,000,000	248,347,100	
第61回利付国債(30年)	260,000,000	267,342,400	
第62回利付国債(30年)	360,000,000	351,496,800	
第63回利付国債(30年)	280,000,000	265,725,600	
第64回利付国債(30年)	260,000,000	246,053,600	
第65回利付国債(30年)	240,000,000	226,756,800	
第66回利付国債(30年)	290,000,000	273,548,300	
第67回利付国債(30年)	260,000,000	258,099,400	
第68回利付国債(30年)	310,000,000	307,340,200	
第69回利付国債(30年)	310,000,000	315,359,900	
第70回利付国債(30年)	370,000,000	375,975,500	
第71回利付国債(30年)	240,000,000	243,295,200	
第59回利付国債(20年)	40,000,000	40,916,000	
第60回利付国債(20年)	30,000,000	30,573,600	
第61回利付国債(20年)	50,000,000	50,845,000	
第62回利付国債(20年)	80,000,000	81,304,000	
第63回利付国債(20年)	60,000,000	62,035,800	
第64回利付国債(20年)	120,000,000	124,898,400	
第65回利付国債(20年)	380,000,000	397,396,400	
第67回利付国債(20年)	20,000,000	21,015,800	
第68回利付国債(20年)	90,000,000	95,249,700	
第69回利付国債(20年)	60,000,000	63,348,600	
第70回利付国債(20年)	110,000,000	117,689,000	
第71回利付国債(20年)	100,000,000	106,436,000	
第72回利付国債(20年)	210,000,000	224,120,400	
第73回利付国債(20年)	180,000,000	192,520,800	
第75回利付国債(20年)	100,000,000	107,818,000	
第76回利付国債(20年)	100,000,000	107,113,000	
第77回利付国債(20年)	20,000,000	21,493,000	
第78回利付国債(20年)	50,000,000	53,813,500	
第79回利付国債(20年)	20,000,000	21,600,800	
第80回利付国債(20年)	90,000,000	97,543,800	
第81回利付国債(20年)	30,000,000	32,563,200	
第82回利付国債(20年)	170,000,000	185,209,900	
第83回利付国債(20年)	10,000,000	10,948,200	
第84回利付国債(20年)	120,000,000	130,864,800	
第85回利付国債(20年)	150,000,000	165,051,000	

第86回利付国債(20年)	100,000,000	110,940,000
第87回利付国債(20年)	90,000,000	99,438,300
第88回利付国債(20年)	185,000,000	206,328,650
第89回利付国債(20年)	120,000,000	133,260,000
第90回利付国債(20年)	170,000,000	189,738,700
第91回利付国債(20年)	80,000,000	89,692,000
第92回利付国債(20年)	255,000,000	284,740,650
第93回利付国債(20年)	80,000,000	89,302,400
第94回利付国債(20年)	140,000,000	157,054,800
第95回利付国債(20年)	185,000,000	210,716,850
第96回利付国債(20年)	70,000,000	78,919,400
第97回利付国債(20年)	130,000,000	148,036,200
第98回利付国債(20年)	70,000,000	79,288,300
第99回利付国債(20年)	85,000,000	96,718,950
第100回利付国債(20年)	151,000,000	173,574,500
第101回利付国債(20年)	20,000,000	23,251,800
第102回利付国債(20年)	145,000,000	169,493,400
第103回利付国債(20年)	100,000,000	116,213,000
第104回利付国債(20年)	10,000,000	11,485,300
第105回利付国債(20年)	12,000,000	13,844,400
第106回利付国債(20年)	40,000,000	46,430,000
第107回利付国債(20年)	80,000,000	92,701,600
第108回利付国債(20年)	220,000,000	251,717,400
第109回利付国債(20年)	80,000,000	91,892,800
第110回利付国債(20年)	195,000,000	226,931,250
第111回利付国債(20年)	50,000,000	58,831,000
第112回利付国債(20年)	205,000,000	239,610,150
第113回利付国債(20年)	85,000,000	99,778,950
第114回利付国債(20年)	160,000,000	188,532,800
第115回利付国債(20年)	100,000,000	118,662,000
第116回利付国債(20年)	140,000,000	166,768,000
第117回利付国債(20年)	225,000,000	266,098,500
第118回利付国債(20年)	131,000,000	154,353,370
第119回利付国債(20年)	150,000,000	174,106,500
第120回利付国債(20年)	240,000,000	274,353,600
第121回利付国債(20年)	205,000,000	240,421,950
第122回利付国債(20年)	190,000,000	221,116,300
第123回利付国債(20年)	265,000,000	316,531,900
第124回利付国債(20年)	200,000,000	237,040,000
第125回利付国債(20年)	120,000,000	144,890,400
第126回利付国債(20年)	100,000,000	118,844,000
第127回利付国債(20年)	130,000,000	153,262,200
第128回利付国債(20年)	225,000,000	266,069,250

第129回利付国債(20年)	240,000,000	281,469,600	
第130回利付国債(20年)	220,000,000	258,735,400	
第131回利付国債(20年)	30,000,000	34,983,000	
第132回利付国債(20年)	170,000,000	198,733,400	
第133回利付国債(20年)	305,000,000	359,668,200	
第134回利付国債(20年)	45,000,000	53,203,050	
第135回利付国債(20年)	40,000,000	46,873,600	
第136回利付国債(20年)	350,000,000	406,486,500	
第137回利付国債(20年)	170,000,000	199,695,600	
第138回利付国債(20年)	90,000,000	103,797,900	
第139回利付国債(20年)	280,000,000	325,920,000	
第140回利付国債(20年)	420,000,000	494,533,200	
第141回利付国債(20年)	185,000,000	218,322,200	
第142回利付国債(20年)	310,000,000	369,296,800	
第143回利付国債(20年)	335,000,000	392,609,950	
第144回利付国債(20年)	250,000,000	290,145,000	
第145回利付国債(20年)	545,000,000	646,342,750	
第146回利付国債(20年)	520,000,000	618,009,600	
第147回利付国債(20年)	495,000,000	583,515,900	
第148回利付国債(20年)	515,000,000	602,199,800	
第149回利付国債(20年)	500,000,000	585,605,000	
第150回利付国債(20年)	630,000,000	730,963,800	
第151回利付国債(20年)	565,000,000	641,710,050	
第152回利付国債(20年)	580,000,000	659,309,200	
第153回利付国債(20年)	410,000,000	472,287,200	
第154回利付国債(20年)	308,000,000	350,932,120	
第155回利付国債(20年)	540,000,000	600,728,400	
第156回利付国債(20年)	570,000,000	585,241,800	
第157回利付国債(20年)	480,000,000	478,627,200	
第158回利付国債(20年)	250,000,000	259,982,500	
第159回利付国債(20年)	430,000,000	453,121,100	
第160回利付国債(20年)	460,000,000	491,266,200	
第161回利付国債(20年)	410,000,000	431,426,600	
第162回利付国債(20年)	360,000,000	378,522,000	
第163回利付国債(20年)	420,000,000	441,243,600	
第164回利付国債(20年)	630,000,000	651,350,700	
第165回利付国債(20年)	430,000,000	444,073,900	
第166回利付国債(20年)	610,000,000	649,485,300	
第167回利付国債(20年)	380,000,000	391,506,400	
第168回利付国債(20年)	500,000,000	505,790,000	
第169回利付国債(20年)	410,000,000	406,908,600	
第170回利付国債(20年)	530,000,000	525,060,400	

	第171回利付国債(20年)	360,000,000	355,993,200
	第172回利付国債(20年)	480,000,000	482,491,200
	第173回利付国債(20年)	450,000,000	451,575,000
	第174回利付国債(20年)	480,000,000	480,844,800
	第175回利付国債(20年)	420,000,000	427,891,800
	第176回利付国債(20年)	460,000,000	467,898,200
	第177回利付国債(20年)	160,000,000	159,561,600
	国債証券合計	89,111,000,000	94,886,324,400
地方債証券	第14回東京都公募公債	100,000,000	114,716,000
	第723回東京都公募公債	100,000,000	101,530,000
	第746回東京都公募公債	100,000,000	101,877,000
	第761回東京都公募公債	100,000,000	100,375,000
	第789回東京都公募公債	100,000,000	100,253,000
	第808回東京都公募公債	100,000,000	100,322,000
	平成28年度第8回北海道公募公債	100,000,000	100,163,000
	第15回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,909,000
	第211回神奈川県公募公債	100,000,000	101,429,000
	第220回神奈川県公募公債	100,000,000	100,360,000
	第164回大阪府公募公債	100,000,000	99,988,000
	第376回大阪府公募公債	110,000,000	111,822,700
	第444回大阪府公募公債	100,000,000	100,283,000
	第451回大阪府公募公債	100,000,000	99,901,000
	第471回大阪府公募公債	140,000,000	139,433,000
	平成27年度第13回京都府公募公債	100,000,000	100,495,000
	平成29年度第4回京都府公募公債	100,000,000	100,949,000
	平成29年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	100,918,000
	令和元年度第2回兵庫県公募公債	100,000,000	100,421,000
	平成26年度第6回静岡県公募公債	100,000,000	101,666,000
	平成30年度第14回静岡県公募公債	100,000,000	100,723,000
	平成22年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	116,175,000
	平成28年度第8回愛知県公募公債	100,000,000	100,321,000
	平成29年度第11回愛知県公募公債	100,000,000	101,128,000
	平成29年度第3回広島県公募公債	100,000,000	100,661,000
	平成30年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,067,000
	第8回埼玉県公募公債	100,000,000	116,934,000
	第16回埼玉県公募公債	100,000,000	112,911,000
	平成26年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	101,678,000
	平成24年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	115,954,000
	平成27年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	102,183,000
	第11回千葉県公募公債	100,000,000	117,707,000
	第19回千葉県公募公債	100,000,000	112,382,000
	平成29年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,300,000

	第117回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,906,000	
	第123回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,539,000	
	第133回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,797,000	
	第156回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,452,000	
	第169回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,006,000	
	第185回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,418,000	
	第191回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,666,000	
	第207回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,654,000	
	第209回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,361,000	
	第216回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,885,000	
	第217回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,894,000	
	平成27年度第1回静岡市公募公債	100,000,000	101,996,000	
	第11回大阪市公募公債	100,000,000	118,569,000	
	第17回名古屋市公募公債	100,000,000	112,627,000	
	令和元年度第4回京都市公募公債	114,500,000	115,223,640	
	第26回横浜市公募公債	100,000,000	117,979,000	
	第21回横浜市公募公債	100,000,000	116,682,000	
	平成26年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	101,680,000	
	平成27年度第2回広島市公募公債	100,000,000	101,984,000	
	平成29年度第3回千葉市公募公債	120,000,000	121,315,200	
	平成29年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	100,017,000	
	平成29年度第5回福井県公募公債	100,000,000	100,989,000	
	平成29年度第2回岡山県公募公債	100,000,000	101,240,000	
	地方債証券合計	5,784,500,000	6,015,814,540	
特殊債券	第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,021,000	
	第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,535,000	
	第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,358,000	
	第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	101,231,000	
	第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	99,523,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,966,000	
	第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	134,550,000	
	第27回道路債券	100,000,000	106,034,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	150,000,000	173,715,000	
	第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,025,000	
	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	114,000,000	116,058,840	
	第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	127,000,000	129,061,210	
	第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,496,000	

第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,795,000	
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	103,000,000	105,181,540	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	133,000,000	134,802,150	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,590,000	
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,961,000	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,225,000	
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,760,000	
第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,521,000	
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,811,000	
第1回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	126,475,000	
第13回公営企業債券	100,000,000	108,064,000	
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	127,000,000	128,855,470	
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,548,000	
F82回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,343,000	
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	145,000,000	146,039,650	
第97回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	201,786,000	
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	113,000,000	114,552,620	
F132回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,159,000	
F228回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	110,903,000	
F305回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	115,379,000	
第10回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)	100,000,000	117,528,000	
第97回都市再生債券	100,000,000	107,415,000	
第2回一般担保住宅金融公庫債券	100,000,000	112,007,000	
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	74,121,000	73,895,672	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	79,391,000	79,376,709	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,299,000	
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	117,856,000	
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,211,000	
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,695,000	82,949,018	
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,855,000	82,888,828	
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,265,000	84,190,074	
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,515,000	83,548,912	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,879,000	86,810,787	
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,982,000	88,402,416	
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,235,000	92,062,520	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,080,000	94,512,768	

	第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,777,000	97,579,281
	第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,679,000	99,869,068
	第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,504,000	100,360,729
	第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,847,000	100,311,288
	第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,455,000
	第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	50,714,000	50,670,893
	第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	52,252,000	52,240,504
	第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	55,978,000	56,007,108
	第340回信金中金債	100,000,000	100,130,000
	第358回信金中金債(5年)	100,000,000	99,954,000
	第372回信金中金債	100,000,000	100,125,000
	第376回信金中金債	100,000,000	100,090,000
	第31回国際協力機構債券	100,000,000	102,064,000
	第87回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,089,000
	第29回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,188,000
	第52回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	99,983,000
	第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	100,050,000
	特殊債券合計	6,607,769,000	6,862,446,055
社債券	第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	100,000,000	100,246,000
	第3回ピー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	100,000,000	100,125,000
	第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,039,000
	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	100,000,000	99,325,000
	第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	100,000,000	99,988,000
	第12回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,019,000
	第3回株式会社電通無担保社債	100,000,000	101,123,000
	第20回株式会社オリエンタルランド無担保社債	100,000,000	99,925,000
	第12回Zホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,071,000
	第10回株式会社資生堂無担保社債	100,000,000	99,819,000
	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,133,000
	第15回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,733,000
	第12回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	99,918,000
	第18回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	99,933,000
	第17回J A三井リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,153,000
	第5回大日本印刷株式会社無担保社債	100,000,000	100,054,000
	第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債	100,000,000	100,076,000
	第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,509,000

第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,067,000	
第14回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,930,000	
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,025,000	
第81アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,729,000	
第205回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,846,000	
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	100,000,000	100,435,000	
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,374,000	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,432,000	
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,689,000	
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,348,000	
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,413,000	
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	117,595,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	100,972,000	
第22回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,347,000	
第543回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,076,000	
第536回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,171,000	
第541回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,301,000	
第413回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,206,000	
第338回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,181,000	
第343回北陸電力株式会社社債	100,000,000	100,048,000	
第531回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,095,000	
第289回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,663,000	
第462回九州電力株式会社社債	100,000,000	101,218,000	
第493回九州電力株式会社社債	100,000,000	100,093,000	
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,489,000	
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	104,045,000	
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債	100,000,000	100,526,000	
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,976,000	
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	101,304,000	
社債券合計	4,700,000,000	4,746,783,000	
合計		112,511,367,995	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

RM先進国債券マザーファンド（為替ヘッジあり）

貸借対照表

（単位：円）

2021年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	62,642,027
コール・ローン	870,792,743
国債証券	275,183,493,689
派生商品評価勘定	357,027,485
未収入金	181,051,861
未収利息	1,148,075,740
前払費用	140,071,616
流動資産合計	277,943,155,161
資産合計	
277,943,155,161	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	64,002,540
未払金	5,222,324
未払解約金	216,158,000
未払利息	2,361
流動負債合計	285,385,225
負債合計	
285,385,225	
純資産の部	
元本等	
元本	263,214,121,421
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	14,443,648,515
元本等合計	277,657,769,936
純資産合計	
277,657,769,936	
負債純資産合計	
277,943,155,161	

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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	174,303,735,274円
期中追加設定元本額	158,754,761,521円
期中一部解約元本額	69,844,375,374円
期末元本額	263,214,121,421円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	26,440,600,929円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	14,781,540,083円
りそなラップ型ファンド(成長型)	2,207,689,211円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	2,704,599,317円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	634,792,502円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	185,337,343円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	175,933,897円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	52,123,945円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	11,342,533円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	8,195,693円
リスクコントロール・オープン	352,668,660円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	2,402,783,120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)	143,846,719,354円
Smart-i 先進国債券インデックス(為替ヘッジあり)	1,081,166,865円
Smart-i 8資産バランス 安定型	880,850,000円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	607,279,055円
Smart-i 8資産バランス 成長型	239,666,804円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	9,306,561,065円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	17,416,709,997円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	10,344,998,421円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	7,507,266,590円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	8,522,485,578円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	1,453,028,892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)	7,678,779,841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)	14,377,585円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	1,645,035,571円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	1,454,592,588円
りそなVIGlobal・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	507,120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)	291,754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)	13,798円
2. 計算日における受益権の総数	263,214,121,421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	1.0549円
(10,000口当たり純資産額)	(10,549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 9月15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 9月15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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
国債証券		4,576,743,142
合計		4,576,743,142

(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 9月15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	609,130,987	-	609,514,698	383,711
	米ドル	304,624,383	-	304,797,564	173,181
	ユーロ	246,847,917	-	247,020,964	173,047
	英ポンド	317,742	-	317,913	171

デンマーククローネ	34,223,378	-	34,248,952	25,574
オーストラリアドル	23,117,567	-	23,129,305	11,738
売建	276,954,712,891	-	276,662,071,657	292,641,234
米ドル	126,757,431,889	-	126,612,280,539	145,151,350
カナダドル	5,459,090,933	-	5,419,659,240	39,431,693
メキシコペソ	1,968,704,395	-	2,000,984,210	32,279,815
ユーロ	112,035,836,529	-	111,882,299,872	153,536,657
英ポンド	17,353,725,503	-	17,372,571,394	18,845,891
スウェーデンクローナ	808,522,843	-	809,322,480	799,637
ノルウェークローネ	666,860,544	-	669,394,701	2,534,157
デンマーククローネ	1,393,156,484	-	1,390,971,950	2,184,534
ポーランドズロチ	1,587,444,558	-	1,592,647,757	5,203,199
オーストラリアドル	5,167,832,877	-	5,164,058,586	3,774,291
シンガポールドル	1,239,104,185	-	1,240,303,239	1,199,054
マレーシアリンギット	1,253,208,720	-	1,243,194,504	10,014,216
イスラエルシェケル	1,263,793,431	-	1,264,383,185	589,754
合計	277,563,843,878	-	277,271,586,355	293,024,945

(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。

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	2,340,000.00	2,380,423.73	
		US TREASURY N/B	6,610,000.00	6,707,662.75	
		US TREASURY N/B	8,760,000.00	8,764,867.93	
		US TREASURY N/B	3,420,000.00	3,468,533.56	
		US TREASURY N/B	5,230,000.00	5,320,574.70	
		US TREASURY N/B	1,740,000.00	1,772,308.84	
		US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,802,793.86	
		US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,514,729.67	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,550,390.50	
		US TREASURY N/B	3,810,000.00	3,891,929.85	
		US TREASURY N/B	7,180,000.00	7,307,893.75	
		US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,276,090.67	
		US TREASURY N/B	6,470,000.00	6,472,148.04	
		US TREASURY N/B	3,550,000.00	3,617,325.04	
		US TREASURY N/B	4,440,000.00	4,555,162.50	
		US TREASURY N/B	9,230,000.00	9,231,441.72	
		US TREASURY N/B	2,330,000.00	2,372,868.27	
		US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,412,638.85	
		US TREASURY N/B	3,830,000.00	3,948,864.43	
		US TREASURY N/B	4,630,000.00	4,753,164.94	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,544,140.50	
		US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,345,910.07	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,554,697.20	
		US TREASURY N/B	11,280,000.00	11,278,897.94	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,519,003.60	
		US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,184,806.25	
US TREASURY N/B	2,350,000.00	2,435,141.44			

US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,896,806.30	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,505,331.90	
US TREASURY N/B	1,650,000.00	1,689,380.71	
US TREASURY N/B	3,740,000.00	3,897,707.94	
US TREASURY N/B	4,410,000.00	4,526,451.34	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,897,638.55	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,111,338.90	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,879,347.60	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,298,292.94	
US TREASURY N/B	7,750,000.00	7,759,233.35	
US TREASURY N/B	3,160,000.00	3,228,013.94	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,317,081.48	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,085,241.88	
US TREASURY N/B	13,450,000.00	13,435,550.66	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,141,794.83	
US TREASURY N/B	3,890,000.00	4,076,446.14	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,356,324.83	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,654,081.90	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,992,382.40	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,372,970.24	
US TREASURY N/B	2,130,000.00	2,236,000.72	
US TREASURY N/B	6,850,000.00	6,838,895.46	
US TREASURY N/B	6,940,000.00	6,926,987.50	
US TREASURY N/B	3,330,000.00	3,408,306.94	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,041,377.55	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,911,773.20	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,900,476.54	
US TREASURY N/B	5,480,000.00	5,775,833.96	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,000,390.50	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,519,730.37	
US TREASURY N/B	3,180,000.00	3,363,533.06	
US TREASURY N/B	6,600,000.00	6,580,019.16	
US TREASURY N/B	1,920,000.00	2,006,887.48	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,845,388.52	
US TREASURY N/B	5,470,000.00	5,450,235.24	

US TREASURY N/B	3,410,000.00	3,568,778.12	
US TREASURY N/B	3,980,000.00	4,188,327.92	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,168,796.44	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	5,925,828.12	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,880,648.28	
US TREASURY N/B	3,360,000.00	3,530,100.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,989,687.19	
US TREASURY N/B	5,350,000.00	5,593,675.38	
US TREASURY N/B	10,580,000.00	10,589,505.07	
US TREASURY N/B	2,320,000.00	2,421,273.33	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,086,885.04	
US TREASURY N/B	5,840,000.00	6,174,431.10	
US TREASURY N/B	6,060,000.00	6,042,956.25	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	3,279,091.95	
US TREASURY N/B	8,300,000.00	8,272,765.21	
US TREASURY N/B	2,380,000.00	2,487,936.57	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,637,631.25	
US TREASURY N/B	8,890,000.00	8,886,526.67	
US TREASURY N/B	1,480,000.00	1,553,681.94	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,157,031.20	
US TREASURY N/B	6,110,000.00	6,461,682.43	
US TREASURY N/B	7,920,000.00	7,913,193.55	
US TREASURY N/B	2,640,000.00	2,754,520.29	
US TREASURY N/B	2,480,000.00	2,541,612.37	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,649,642.15	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,850,239.02	
US TREASURY N/B	2,420,000.00	2,556,077.56	
US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,779,901.60	
US TREASURY N/B	5,460,000.00	5,770,110.52	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,368,960.84	
US TREASURY N/B	4,880,000.00	5,040,887.25	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,538,796.80	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,958,679.64	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,795,928.80	
US TREASURY N/B	3,290,000.00	3,386,707.90	

US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,145,241.89	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,476,497.86	
US TREASURY N/B	4,140,000.00	4,226,600.10	
US TREASURY N/B	2,530,000.00	2,715,747.28	
US TREASURY N/B	7,640,000.00	7,629,703.57	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,752,030.31	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,619,302.56	
US TREASURY N/B	5,950,000.00	6,287,708.91	
US TREASURY N/B	2,470,000.00	2,678,647.32	
US TREASURY N/B	5,320,000.00	5,256,408.97	
US TREASURY N/B	2,120,000.00	2,291,918.64	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	4,590,421.87	
US TREASURY N/B	2,250,000.00	2,445,864.07	
US TREASURY N/B	4,720,000.00	4,656,021.81	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,640,839.45	
US TREASURY N/B	1,890,000.00	2,047,622.97	
US TREASURY N/B	7,000,000.00	6,898,280.90	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	2,659,710.81	
US TREASURY N/B	6,020,000.00	5,927,936.14	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,411,062.50	
US TREASURY N/B	7,180,000.00	7,061,782.01	
US TREASURY N/B	5,570,000.00	5,936,836.30	
US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,878,025.00	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,730,331.56	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,840,250.00	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,403,613.00	
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,055,734.23	
US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,103,920.00	
US TREASURY N/B	6,860,000.00	7,134,667.54	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,834,638.64	
US TREASURY N/B	9,800,000.00	9,711,569.70	
US TREASURY N/B	2,670,000.00	2,853,040.78	
US TREASURY N/B	7,970,000.00	7,980,273.33	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,687,792.75	
US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,706,917.68	

US TREASURY N/B	5,420,000.00	5,640,081.26	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,872,968.75	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,402,296.56	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,842,488.18	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,534,531.25	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,738,378.76	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,965,234.00	
US TREASURY N/B	5,830,000.00	6,033,708.36	
US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,375,068.50	
US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,457,764.64	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,624,638.96	
US TREASURY N/B	5,740,000.00	6,087,538.62	
US TREASURY N/B	2,550,000.00	2,656,183.53	
US TREASURY N/B	2,720,000.00	2,851,750.00	
US TREASURY N/B	2,270,000.00	2,349,893.33	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	5,942,589.42	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,195.30	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,765,546.84	
US TREASURY N/B	4,180,000.00	4,096,073.12	
US TREASURY N/B	4,620,000.00	5,004,488.41	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,478,812.08	
US TREASURY N/B	4,280,000.00	4,185,037.50	
US TREASURY N/B	6,760,000.00	6,556,143.41	
US TREASURY N/B	5,550,000.00	5,980,341.45	
US TREASURY N/B	4,290,000.00	4,184,425.67	
US TREASURY N/B	6,870,000.00	6,644,578.12	
US TREASURY N/B	5,010,000.00	4,874,573.18	
US TREASURY N/B	5,240,000.00	5,648,965.23	
US TREASURY N/B	6,100,000.00	5,975,616.73	
US TREASURY N/B	7,920,000.00	7,748,915.32	
US TREASURY N/B	20,170,000.00	19,870,600.55	
US TREASURY N/B	5,850,000.00	6,494,413.77	
US TREASURY N/B	9,190,000.00	9,329,285.47	
US TREASURY N/B	6,090,000.00	6,822,346.25	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,592,167.40	

US TREASURY N/B	7,200,000.00	7,296,750.00	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	5,777,343.46	
US TREASURY N/B	220,000.00	285,922.64	
US TREASURY N/B	8,390,000.00	9,415,153.12	
US TREASURY N/B	6,480,000.00	7,397,577.72	
US TREASURY N/B	6,610,000.00	7,329,095.29	
US TREASURY N/B	6,010,000.00	6,561,933.75	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,185,644.50	
US TREASURY N/B	3,990,000.00	4,177,342.86	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,460,699.14	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,108,331.25	
US TREASURY N/B	10,120,000.00	9,636,532.18	
US TREASURY N/B	15,650,000.00	14,863,831.64	
US TREASURY N/B	10,450,000.00	10,127,926.81	
US TREASURY N/B	3,210,000.00	4,408,734.37	
US TREASURY N/B	9,890,000.00	9,784,918.75	
US TREASURY N/B	13,850,000.00	14,315,272.74	
US TREASURY N/B	4,680,000.00	4,667,934.02	
US TREASURY N/B	540,000.00	759,775.73	
US TREASURY N/B	130,000.00	194,314.44	
US TREASURY N/B	690,000.00	976,754.27	
US TREASURY N/B	2,620,000.00	3,765,431.25	
US TREASURY N/B	960,000.00	1,240,087.48	
US TREASURY N/B	1,290,000.00	1,820,562.81	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,947,920.21	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	2,296,187.36	
US TREASURY N/B	780,000.00	1,154,369.50	
US TREASURY N/B	950,000.00	1,369,261.69	
US TREASURY N/B	4,640,000.00	4,181,074.76	
US TREASURY N/B	1,410,000.00	1,916,608.48	
US TREASURY N/B	8,140,000.00	7,308,193.75	
US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,738,214.03	
US TREASURY N/B	8,700,000.00	8,146,054.47	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,727,843.66	
US TREASURY N/B	8,360,000.00	8,516,750.00	

US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,640,309.69	
US TREASURY N/B	6,760,000.00	7,309,250.00	
US TREASURY N/B	1,080,000.00	1,453,063.96	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,880,500.00	
US TREASURY N/B	1,040,000.00	1,287,406.22	
US TREASURY N/B	1,340,000.00	1,661,547.60	
US TREASURY N/B	1,070,000.00	1,300,969.45	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,920,657.79	
US TREASURY N/B	1,860,000.00	2,177,871.02	
US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,777,337.47	
US TREASURY N/B	3,710,000.00	4,432,000.49	
US TREASURY N/B	2,430,000.00	3,243,954.98	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	3,076,160.12	
US TREASURY N/B	3,140,000.00	4,207,845.23	
US TREASURY N/B	2,710,000.00	3,508,814.77	
US TREASURY N/B	3,930,000.00	4,905,438.18	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,430,984.20	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,815,966.93	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,072,460.75	
US TREASURY N/B	2,590,000.00	3,120,443.91	
US TREASURY N/B	1,820,000.00	2,242,936.69	
US TREASURY N/B	3,070,000.00	3,476,055.39	
US TREASURY N/B	4,010,000.00	4,544,144.43	
US TREASURY N/B	4,250,000.00	4,600,126.90	
US TREASURY N/B	2,220,000.00	2,691,923.38	
US TREASURY N/B	2,940,000.00	3,646,288.84	
US TREASURY N/B	3,190,000.00	3,961,830.38	
US TREASURY N/B	3,430,000.00	4,078,484.37	
US TREASURY N/B	4,050,000.00	4,820,923.57	
US TREASURY N/B	4,650,000.00	5,790,521.31	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,734,335.59	
US TREASURY N/B	5,090,000.00	6,351,564.13	
US TREASURY N/B	5,530,000.00	7,372,828.81	
US TREASURY N/B	5,280,000.00	6,611,137.10	
US TREASURY N/B	5,190,000.00	6,361,399.08	

	US TREASURY N/B	5,670,000.00	6,167,675.17
	US TREASURY N/B	4,150,000.00	4,637,300.47
	US TREASURY N/B	6,190,000.00	6,395,527.18
	US TREASURY N/B	6,850,000.00	5,914,546.87
	US TREASURY N/B	7,600,000.00	6,766,671.40
	US TREASURY N/B	7,120,000.00	6,740,081.07
	US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,634,937.50
	US TREASURY N/B	9,910,000.00	11,115,458.32
	US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,309,749.76
	米ドル 小計	1,103,140,000.00	1,151,683,541.35 (126,282,100,309)
カナダドル	GOV OF CANADA	2,390,000.00	2,406,610.50
	GOV OF CANADA	2,600,000.00	2,598,928.80
	GOV OF CANADA	2,250,000.00	2,248,425.00
	GOV OF CANADA	1,810,000.00	1,848,107.74
	GOV OF CANADA	2,300,000.00	2,296,665.00
	GOV OF CANADA	1,330,000.00	1,356,300.75
	GOV OF CANADA	2,020,000.00	2,014,283.40
	GOV OF CANADA	2,580,000.00	2,659,990.32
	GOV OF CANADA	740,000.00	740,746.66
	GOV OF CANADA	840,000.00	876,265.32
	GOV OF CANADA	2,630,000.00	2,613,252.16
	GOV OF CANADA	1,180,000.00	1,242,804.32
	GOV OF CANADA	1,110,000.00	1,140,172.02
	GOV OF CANADA	600,000.00	602,787.00
	GOV OF CANADA	840,000.00	857,867.64
	GOV OF CANADA	1,250,000.00	1,322,826.25
	GOV OF CANADA	3,490,000.00	3,460,115.13
	GOV OF CANADA	2,260,000.00	2,206,438.00
	GOV OF CANADA	850,000.00	877,814.55
	GOV OF CANADA	1,850,000.00	1,863,599.35
	GOV OF CANADA	920,000.00	926,052.68
	GOV OF CANADA	1,000,000.00	1,067,684.00
	GOV OF CANADA	350,000.00	472,120.95
	GOV OF CANADA	1,340,000.00	1,462,368.80

	GOV OF CANADA	3,850,000.00	3,893,693.65
	GOV OF CANADA	3,750,000.00	3,530,925.00
	GOV OF CANADA	3,030,000.00	3,107,628.60
	GOV OF CANADA	1,020,000.00	1,505,985.12
	GOV OF CANADA	690,000.00	1,032,313.83
	GOV OF CANADA	960,000.00	1,353,096.00
	GOV OF CANADA	1,270,000.00	1,730,461.36
	GOV OF CANADA	1,210,000.00	1,484,193.26
	GOV OF CANADA	4,770,000.00	5,064,285.15
	GOV OF CANADA	240,000.00	237,930.48
	GOV OF CANADA	520,000.00	661,615.76
	カナダドル 小計	59,840,000.00	62,764,354.55 (5,420,329,658)
メキシコペソ	UNITED MEXICAN STATE	21,430,000.00	21,810,596.80
	UNITED MEXICAN STATE	29,990,000.00	31,319,018.84
	UNITED MEXICAN STATE	30,000,000.00	31,437,600.00
	UNITED MEXICAN STATE	28,740,000.00	31,864,359.88
	UNITED MEXICAN STATE	43,180,000.00	41,803,257.51
	UNITED MEXICAN STATE	35,040,000.00	36,227,302.36
	UNITED MEXICAN STATE	33,010,000.00	36,127,834.10
	UNITED MEXICAN STATE	28,156,000.00	29,659,248.84
	UNITED MEXICAN STATE	9,600,000.00	10,075,104.00
	UNITED MEXICAN STATE	8,200,000.00	10,215,600.18
	UNITED MEXICAN STATE	24,200,000.00	26,524,741.54
	UNITED MEXICAN STATE	22,210,000.00	22,675,961.35
	UNITED MEXICAN STATE	23,390,000.00	24,399,009.50
	メキシコペソ 小計	337,146,000.00	354,139,634.90 (1,951,132,318)
ユーロ	GOV OF AUSTRIA	690,000.00	694,895.19
	GOV OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,049,217.00
	GOV OF AUSTRIA	920,000.00	930,695.92
	GOV OF AUSTRIA	1,290,000.00	1,308,092.25
	GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,400,835.53
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,235,020.38
	GOV OF AUSTRIA	1,210,000.00	1,300,320.45
	GOV OF AUSTRIA	700,000.00	716,368.80

GOV OF AUSTRIA	1,340,000.00	1,443,470.78	
GOV OF AUSTRIA	1,030,000.00	1,289,853.55	
GOV OF AUSTRIA	1,430,000.00	1,526,349.11	
GOV OF AUSTRIA	1,350,000.00	1,428,125.85	
GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,710,677.90	
GOV OF AUSTRIA	1,220,000.00	1,312,824.55	
GOV OF AUSTRIA	1,380,000.00	1,463,719.08	
GOV OF AUSTRIA	1,330,000.00	1,353,975.91	
GOV OF AUSTRIA	910,000.00	920,956.66	
GOV OF AUSTRIA	1,180,000.00	1,532,746.84	
GOV OF AUSTRIA	1,450,000.00	2,345,143.00	
GOV OF AUSTRIA	420,000.00	393,849.96	
GOV OF AUSTRIA	780,000.00	1,266,381.09	
GOV OF AUSTRIA	980,000.00	1,234,309.02	
GOV OF AUSTRIA	610,000.00	652,214.44	
GOV OF AUSTRIA	430,000.00	923,597.43	
GOV OF AUSTRIA	430,000.00	417,973.33	
GOV OF AUSTRIA	690,000.00	1,191,624.72	
GOV OF AUSTRIA	300,000.00	410,293.80	
GOV OF BELGIUM	1,670,000.00	1,756,031.85	
GOV OF BELGIUM	1,570,000.00	1,652,673.06	
GOV OF BELGIUM	1,280,000.00	1,304,599.42	
GOV OF BELGIUM	1,550,000.00	1,692,977.57	
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	1,835,091.75	
GOV OF BELGIUM	2,400,000.00	2,531,688.71	
GOV OF BELGIUM	930,000.00	1,149,219.60	
GOV OF BELGIUM	2,020,000.00	2,171,706.04	
GOV OF BELGIUM	1,580,000.00	1,698,997.70	
GOV OF BELGIUM	1,010,000.00	1,037,684.10	
GOV OF BELGIUM	1,770,000.00	2,474,660.01	
GOV OF BELGIUM	2,230,000.00	2,412,371.63	
GOV OF BELGIUM	1,760,000.00	1,923,662.04	
GOV OF BELGIUM	1,740,000.00	1,784,635.17	
GOV OF BELGIUM	1,840,000.00	2,040,688.80	
GOV OF BELGIUM	1,600,000.00	1,605,881.60	

GOV OF BELGIUM	1,130,000.00	1,617,882.02	
GOV OF BELGIUM	1,200,000.00	1,372,824.00	
GOV OF BELGIUM	700,000.00	957,210.80	
GOV OF BELGIUM	2,270,000.00	3,759,337.92	
GOV OF BELGIUM	600,000.00	706,991.40	
GOV OF BELGIUM	980,000.00	1,228,420.20	
GOV OF BELGIUM	640,000.00	631,380.48	
GOV OF BELGIUM	2,120,000.00	3,614,409.20	
GOV OF BELGIUM	1,110,000.00	1,883,385.84	
GOV OF BELGIUM	1,270,000.00	1,542,129.25	
GOV OF BELGIUM	1,170,000.00	1,458,379.26	
GOV OF BELGIUM	710,000.00	1,024,459.00	
GOV OF BELGIUM	780,000.00	1,142,349.00	
GOV OF BELGIUM	590,000.00	520,798.24	
GOV OF FINLAND	530,000.00	542,634.14	
GOV OF FINLAND	660,000.00	683,958.00	
GOV OF FINLAND	660,000.00	669,801.66	
GOV OF FINLAND	510,000.00	546,524.67	
GOV OF FINLAND	460,000.00	469,599.74	
GOV OF FINLAND	520,000.00	613,992.08	
GOV OF FINLAND	670,000.00	711,070.33	
GOV OF FINLAND	840,000.00	882,948.36	
GOV OF FINLAND	740,000.00	784,334.14	
GOV OF FINLAND	470,000.00	574,007.71	
GOV OF FINLAND	510,000.00	542,253.93	
GOV OF FINLAND	1,240,000.00	1,320,499.56	
GOV OF FINLAND	360,000.00	366,892.92	
GOV OF FINLAND	490,000.00	534,477.30	
GOV OF FINLAND	410,000.00	420,491.90	
GOV OF FINLAND	390,000.00	445,147.95	
GOV OF FINLAND	580,000.00	580,373.52	
GOV OF FINLAND	470,000.00	471,052.80	
GOV OF FINLAND	490,000.00	731,224.55	
GOV OF FINLAND	410,000.00	517,698.39	
GOV OF FINLAND	400,000.00	367,678.00	

GOV OF FRANCE	3,520,000.00	3,635,679.52	
GOV OF FRANCE	2,120,000.00	2,141,238.16	
GOV OF FRANCE	6,020,000.00	6,084,482.60	
GOV OF FRANCE	5,910,000.00	6,156,139.68	
GOV OF FRANCE	4,330,000.00	4,785,689.20	
GOV OF FRANCE	3,690,000.00	3,749,174.29	
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,511,462.50	
GOV OF FRANCE	3,770,000.00	4,069,149.50	
GOV OF FRANCE	4,220,000.00	4,546,058.30	
GOV OF FRANCE	5,420,000.00	5,536,817.26	
GOV OF FRANCE	5,250,000.00	5,467,917.00	
GOV OF FRANCE	3,250,000.00	4,141,605.00	
GOV OF FRANCE	4,190,000.00	4,470,013.51	
GOV OF FRANCE	4,970,000.00	5,089,647.78	
GOV OF FRANCE	4,910,000.00	5,837,076.74	
GOV OF FRANCE	5,000,000.00	5,244,855.00	
GOV OF FRANCE	4,310,000.00	4,478,374.46	
GOV OF FRANCE	1,230,000.00	1,259,864.40	
GOV OF FRANCE	4,550,000.00	4,929,852.20	
GOV OF FRANCE	6,110,000.00	7,318,863.50	
GOV OF FRANCE	5,560,000.00	5,979,679.92	
GOV OF FRANCE	6,310,000.00	6,801,283.98	
GOV OF FRANCE	4,240,000.00	6,137,001.44	
GOV OF FRANCE	4,820,000.00	5,105,146.38	
GOV OF FRANCE	5,330,000.00	5,421,169.65	
GOV OF FRANCE	5,330,000.00	6,589,436.36	
GOV OF FRANCE	5,650,000.00	5,707,245.80	
GOV OF FRANCE	6,080,000.00	7,018,448.00	
GOV OF FRANCE	3,070,000.00	3,075,338.73	
GOV OF FRANCE	4,140,000.00	6,798,794.94	
GOV OF FRANCE	4,420,000.00	5,026,211.84	
GOV OF FRANCE	3,210,000.00	5,206,254.06	
GOV OF FRANCE	4,900,000.00	5,594,462.30	
GOV OF FRANCE	2,980,000.00	4,807,687.64	
GOV OF FRANCE	3,480,000.00	4,324,627.32	

GOV OF FRANCE	2,400,000.00	2,418,410.40	
GOV OF FRANCE	4,280,000.00	7,558,218.92	
GOV OF FRANCE	1,460,000.00	1,439,422.76	
GOV OF FRANCE	2,720,000.00	4,345,825.60	
GOV OF FRANCE	3,370,000.00	4,467,831.42	
GOV OF FRANCE	3,520,000.00	4,228,752.00	
GOV OF FRANCE	3,560,000.00	3,532,723.28	
GOV OF FRANCE	900,000.00	885,299.40	
GOV OF FRANCE	2,110,000.00	4,114,430.37	
GOV OF FRANCE	1,890,000.00	3,860,797.50	
GOV OF FRANCE	1,480,000.00	1,949,577.36	
GOV OF FRANCE	970,000.00	797,599.96	
GOV OF GERMANY	2,020,000.00	2,064,308.70	
GOV OF GERMANY	1,550,000.00	1,561,294.85	
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,811,379.77	
GOV OF GERMANY	1,180,000.00	1,190,812.34	
GOV OF GERMANY	2,340,000.00	2,415,670.92	
GOV OF GERMANY	2,130,000.00	2,153,284.08	
GOV OF GERMANY	2,460,000.00	2,488,805.61	
GOV OF GERMANY	2,310,000.00	2,396,842.14	
GOV OF GERMANY	1,810,000.00	1,832,887.45	
GOV OF GERMANY	2,650,000.00	2,791,346.23	
GOV OF GERMANY	600,000.00	608,576.40	
GOV OF GERMANY	3,140,000.00	3,189,390.61	
GOV OF GERMANY	3,520,000.00	3,735,512.00	
GOV OF GERMANY	2,530,000.00	2,578,487.45	
GOV OF GERMANY	2,520,000.00	2,673,067.32	
GOV OF GERMANY	2,810,000.00	2,955,099.40	
GOV OF GERMANY	2,760,000.00	2,823,744.96	
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	3,065,948.12	
GOV OF GERMANY	2,120,000.00	2,174,929.20	
GOV OF GERMANY	3,000,000.00	3,205,065.00	
GOV OF GERMANY	3,320,000.00	3,416,919.09	
GOV OF GERMANY	350,000.00	360,964.24	
GOV OF GERMANY	3,410,000.00	3,593,219.30	

GOV OF GERMANY	2,980,000.00	3,074,781.88
GOV OF GERMANY	3,770,000.00	3,896,558.90
GOV OF GERMANY	510,000.00	527,042.16
GOV OF GERMANY	3,490,000.00	3,662,590.97
GOV OF GERMANY	1,680,000.00	2,393,076.00
GOV OF GERMANY	3,790,000.00	4,046,143.36
GOV OF GERMANY	3,140,000.00	3,257,059.20
GOV OF GERMANY	1,730,000.00	2,428,349.10
GOV OF GERMANY	3,130,000.00	3,353,732.40
GOV OF GERMANY	1,140,000.00	1,564,319.40
GOV OF GERMANY	3,220,000.00	3,404,728.18
GOV OF GERMANY	1,820,000.00	1,889,245.54
GOV OF GERMANY	2,860,000.00	3,029,352.04
GOV OF GERMANY	3,150,000.00	3,275,388.90
GOV OF GERMANY	1,150,000.00	1,814,180.20
GOV OF GERMANY	3,310,000.00	3,441,224.95
GOV OF GERMANY	4,020,000.00	4,175,690.58
GOV OF GERMANY	700,000.00	730,978.50
GOV OF GERMANY	2,070,000.00	3,249,827.55
GOV OF GERMANY	2,790,000.00	2,892,791.97
GOV OF GERMANY	1,570,000.00	1,624,234.08
GOV OF GERMANY	2,850,000.00	4,733,345.55
GOV OF GERMANY	2,940,000.00	2,997,647.52
GOV OF GERMANY	1,400,000.00	1,417,103.93
GOV OF GERMANY	3,160,000.00	5,213,731.40
GOV OF GERMANY	2,360,000.00	4,221,256.48
GOV OF GERMANY	2,180,000.00	4,194,490.04
GOV OF GERMANY	2,250,000.00	3,805,740.00
GOV OF GERMANY	3,270,000.00	5,146,505.85
GOV OF GERMANY	3,500,000.00	5,633,874.39
GOV OF GERMANY	3,250,000.00	4,236,482.25
GOV OF GERMANY	4,300,000.00	4,116,175.00
GOV OF IRELAND	510,000.00	513,547.05
GOV OF IRELAND	730,000.00	780,732.08
GOV OF IRELAND	820,000.00	903,286.65

GOV OF IRELAND	1,350,000.00	1,635,388.65	
GOV OF IRELAND	1,530,000.00	1,639,970.57	
GOV OF IRELAND	710,000.00	735,614.67	
GOV OF IRELAND	810,000.00	877,571.01	
GOV OF IRELAND	1,260,000.00	1,390,775.40	
GOV OF IRELAND	830,000.00	1,016,745.85	
GOV OF IRELAND	1,320,000.00	1,354,921.92	
GOV OF IRELAND	530,000.00	602,967.80	
GOV OF IRELAND	1,050,000.00	1,048,705.35	
GOV OF IRELAND	420,000.00	479,341.38	
GOV OF IRELAND	590,000.00	602,755.21	
GOV OF IRELAND	650,000.00	786,947.85	
GOV OF IRELAND	350,000.00	353,192.00	
GOV OF IRELAND	980,000.00	1,291,877.16	
GOV OF IRELAND	780,000.00	936,453.96	
GOV OF ITALY	1,670,000.00	1,766,217.05	
GOV OF ITALY	2,500,000.00	2,548,921.00	
GOV OF ITALY	1,160,000.00	1,238,366.12	
GOV OF ITALY	3,020,000.00	3,037,493.04	
GOV OF ITALY	1,790,000.00	1,803,196.23	
GOV OF ITALY	1,830,000.00	1,868,389.74	
GOV OF ITALY	1,690,000.00	1,726,198.11	
GOV OF ITALY	1,940,000.00	2,098,094.67	
GOV OF ITALY	2,320,000.00	2,364,983.86	
GOV OF ITALY	2,510,000.00	2,757,480.98	
GOV OF ITALY	2,530,000.00	2,566,141.05	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,097,451.62	
GOV OF ITALY	1,610,000.00	1,646,975.26	
GOV OF ITALY	4,870,000.00	4,913,440.40	
GOV OF ITALY	1,980,000.00	2,218,188.06	
GOV OF ITALY	1,890,000.00	1,906,424.10	
GOV OF ITALY	1,400,000.00	1,482,104.40	
GOV OF ITALY	2,020,000.00	2,137,071.12	
GOV OF ITALY	1,350,000.00	1,361,348.10	
GOV OF ITALY	2,190,000.00	2,453,796.45	

GOV OF ITALY	2,050,000.00	2,162,793.05	
GOV OF ITALY	2,030,000.00	2,211,573.35	
GOV OF ITALY	3,110,000.00	3,172,753.58	
GOV OF ITALY	2,350,000.00	2,778,792.75	
GOV OF ITALY	1,540,000.00	1,633,741.34	
GOV OF ITALY	2,710,000.00	2,881,288.26	
GOV OF ITALY	2,010,000.00	2,164,478.55	
GOV OF ITALY	1,770,000.00	1,965,390.30	
GOV OF ITALY	2,310,000.00	2,517,504.99	
GOV OF ITALY	2,710,000.00	2,779,660.55	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,206,832.16	
GOV OF ITALY	2,230,000.00	2,236,259.38	
GOV OF ITALY	2,400,000.00	2,586,304.80	
GOV OF ITALY	1,820,000.00	2,007,096.00	
GOV OF ITALY	500,000.00	499,881.00	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,384,771.80	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,375,965.20	
GOV OF ITALY	1,990,000.00	2,229,223.87	
GOV OF ITALY	1,740,000.00	1,935,819.60	
GOV OF ITALY	4,120,000.00	4,316,392.16	
GOV OF ITALY	2,580,000.00	3,575,405.28	
GOV OF ITALY	2,560,000.00	2,852,920.32	
GOV OF ITALY	2,040,000.00	2,042,476.56	
GOV OF ITALY	1,180,000.00	1,197,363.70	
GOV OF ITALY	2,660,000.00	3,477,000.38	
GOV OF ITALY	2,550,000.00	3,003,706.20	
GOV OF ITALY	2,640,000.00	3,175,027.68	
GOV OF ITALY	3,280,000.00	4,558,216.00	
GOV OF ITALY	3,390,000.00	4,247,120.82	
GOV OF ITALY	2,770,000.00	2,971,365.15	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	1,979,417.04	
GOV OF ITALY	2,280,000.00	2,500,845.36	
GOV OF ITALY	2,810,000.00	2,886,769.20	
GOV OF ITALY	3,850,000.00	5,809,496.00	
GOV OF ITALY	2,300,000.00	2,290,784.82	

GOV OF ITALY	1,110,000.00	1,137,643.44	
GOV OF ITALY	2,790,000.00	3,055,329.00	
GOV OF ITALY	2,830,000.00	4,367,312.60	
GOV OF ITALY	2,090,000.00	2,468,996.42	
GOV OF ITALY	2,740,000.00	4,096,645.24	
GOV OF ITALY	1,570,000.00	2,038,621.45	
GOV OF ITALY	1,660,000.00	1,751,054.32	
GOV OF ITALY	1,810,000.00	2,105,663.50	
GOV OF ITALY	3,090,000.00	4,339,132.50	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	1,550,668.17	
GOV OF ITALY	2,110,000.00	2,675,817.60	
GOV OF ITALY	2,270,000.00	3,637,895.19	
GOV OF ITALY	1,800,000.00	2,332,648.80	
GOV OF ITALY	2,430,000.00	3,939,737.13	
GOV OF ITALY	1,710,000.00	1,838,629.62	
GOV OF ITALY	1,910,000.00	3,137,711.71	
GOV OF ITALY	1,210,000.00	1,219,422.27	
GOV OF ITALY	1,520,000.00	2,060,755.20	
GOV OF ITALY	2,420,000.00	3,003,050.60	
GOV OF ITALY	1,880,000.00	2,642,199.00	
GOV OF ITALY	1,590,000.00	2,392,107.30	
GOV OF ITALY	1,750,000.00	2,077,215.00	
GOV OF ITALY	1,340,000.00	1,354,998.62	
GOV OF ITALY	1,080,000.00	1,317,076.20	
GOV OF ITALY	560,000.00	571,080.16	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,738,790.32	
GOV OF NETHERLANDS	1,930,000.00	2,019,116.78	
GOV OF NETHERLANDS	1,830,000.00	1,861,331.43	
GOV OF NETHERLANDS	1,640,000.00	1,768,095.48	
GOV OF NETHERLANDS	2,200,000.00	2,279,222.00	
GOV OF NETHERLANDS	2,010,000.00	2,121,114.81	
GOV OF NETHERLANDS	1,910,000.00	1,967,930.30	
GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	2,090,287.92	
GOV OF NETHERLANDS	1,120,000.00	1,553,055.84	
GOV OF NETHERLANDS	1,990,000.00	2,159,028.61	

GOV OF NETHERLANDS	1,320,000.00	1,385,989.44	
GOV OF NETHERLANDS	1,610,000.00	1,653,470.00	
GOV OF NETHERLANDS	1,390,000.00	1,421,144.34	
GOV OF NETHERLANDS	1,790,000.00	2,340,321.18	
GOV OF NETHERLANDS	1,940,000.00	3,144,319.02	
GOV OF NETHERLANDS	870,000.00	860,572.93	
GOV OF NETHERLANDS	1,200,000.00	1,298,779.20	
GOV OF NETHERLANDS	2,190,000.00	3,817,062.69	
GOV OF NETHERLANDS	2,090,000.00	3,456,442.00	
GOV OF NETHERLANDS	920,000.00	857,372.84	
GOV OF SPAIN	2,080,000.00	2,105,823.20	
GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,459,212.44	
GOV OF SPAIN	2,600,000.00	2,625,965.11	
GOV OF SPAIN	2,690,000.00	2,738,376.96	
GOV OF SPAIN	2,590,000.00	2,867,909.84	
GOV OF SPAIN	1,790,000.00	2,021,223.25	
GOV OF SPAIN	2,500,000.00	2,788,509.75	
GOV OF SPAIN	1,880,000.00	1,906,375.26	
GOV OF SPAIN	2,120,000.00	2,167,677.73	
GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,660,182.10	
GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,377,236.80	
GOV OF SPAIN	2,210,000.00	2,379,783.25	
GOV OF SPAIN	2,610,000.00	3,134,343.78	
GOV OF SPAIN	2,570,000.00	2,848,053.44	
GOV OF SPAIN	1,910,000.00	1,941,238.05	
GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,180,720.55	
GOV OF SPAIN	2,490,000.00	3,257,243.70	
GOV OF SPAIN	3,060,000.00	3,319,794.00	
GOV OF SPAIN	2,670,000.00	2,938,489.86	
GOV OF SPAIN	3,140,000.00	3,327,674.66	
GOV OF SPAIN	2,410,000.00	2,654,494.50	
GOV OF SPAIN	1,250,000.00	1,260,659.25	
GOV OF SPAIN	2,630,000.00	2,897,076.50	
GOV OF SPAIN	2,990,000.00	3,302,565.63	
GOV OF SPAIN	1,780,000.00	2,448,409.58	

	GOV OF SPAIN	2,640,000.00	3,829,795.20
	GOV OF SPAIN	2,730,000.00	3,035,568.90
	GOV OF SPAIN	3,320,000.00	3,469,990.96
	GOV OF SPAIN	1,920,000.00	1,985,575.68
	GOV OF SPAIN	2,430,000.00	2,822,593.23
	GOV OF SPAIN	2,870,000.00	3,152,069.34
	GOV OF SPAIN	2,440,000.00	2,409,246.24
	GOV OF SPAIN	1,210,000.00	1,233,455.11
	GOV OF SPAIN	2,650,000.00	4,195,434.95
	GOV OF SPAIN	2,270,000.00	2,776,091.96
	GOV OF SPAIN	2,470,000.00	2,885,216.88
	GOV OF SPAIN	2,340,000.00	3,565,111.68
	GOV OF SPAIN	1,150,000.00	1,164,747.60
	GOV OF SPAIN	2,070,000.00	3,563,122.05
	GOV OF SPAIN	2,130,000.00	2,239,516.50
	GOV OF SPAIN	2,470,000.00	4,198,589.98
	GOV OF SPAIN	1,740,000.00	3,246,718.20
	GOV OF SPAIN	1,970,000.00	2,768,933.50
	GOV OF SPAIN	1,640,000.00	2,242,486.80
	GOV OF SPAIN	2,320,000.00	2,203,324.88
	GOV OF SPAIN	1,690,000.00	2,692,119.30
	GOV OF SPAIN	590,000.00	547,456.28
	ユーロ 小計	735,750,000.00	857,242,136.93 (110,987,139,468)
英bond	UK TREASURY	2,530,000.00	2,572,067.32
	UK TREASURY	3,920,000.00	3,920,196.00
	UK TREASURY	2,470,000.00	2,497,812.20
	UK TREASURY	1,840,000.00	1,916,237.08
	UK TREASURY	3,560,000.00	3,551,978.59
	UK TREASURY	1,750,000.00	1,786,470.00
	UK TREASURY	1,610,000.00	1,731,069.42
	UK TREASURY	20,000.00	19,969.24
	UK TREASURY	970,000.00	1,128,867.57
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,533,450.00
	UK TREASURY	1,250,000.00	1,335,200.00

UK TREASURY	2,160,000.00	2,140,387.20
UK TREASURY	1,470,000.00	1,552,044.37
UK TREASURY	1,230,000.00	1,227,489.57
UK TREASURY	1,610,000.00	1,687,441.00
UK TREASURY	1,480,000.00	1,825,430.81
UK TREASURY	2,130,000.00	2,082,069.46
UK TREASURY	1,520,000.00	1,640,327.45
UK TREASURY	1,210,000.00	1,681,113.50
UK TREASURY	1,590,000.00	1,626,620.88
UK TREASURY	2,240,000.00	2,181,511.36
UK TREASURY	1,430,000.00	1,954,787.12
UK TREASURY	2,640,000.00	2,518,216.80
UK TREASURY	2,060,000.00	2,801,661.80
UK TREASURY	1,350,000.00	1,956,306.60
UK TREASURY	2,780,000.00	2,669,205.88
UK TREASURY	1,900,000.00	2,764,222.22
UK TREASURY	2,410,000.00	2,687,752.50
UK TREASURY	1,710,000.00	2,742,670.36
UK TREASURY	600,000.00	609,648.72
UK TREASURY	1,680,000.00	2,585,775.36
UK TREASURY	1,520,000.00	2,382,658.36
UK TREASURY	2,950,000.00	3,060,066.85
UK TREASURY	2,020,000.00	3,358,169.20
UK TREASURY	2,510,000.00	3,608,768.06
UK TREASURY	2,080,000.00	3,134,959.36
UK TREASURY	1,120,000.00	1,073,329.60
UK TREASURY	1,860,000.00	3,176,268.06
UK TREASURY	1,860,000.00	2,048,531.46
UK TREASURY	1,500,000.00	1,751,709.60
UK TREASURY	1,260,000.00	2,252,431.44
UK TREASURY	1,690,000.00	1,514,237.97
UK TREASURY	1,110,000.00	1,165,810.80
UK TREASURY	1,350,000.00	2,321,203.50
UK TREASURY	1,590,000.00	1,857,266.91
UK TREASURY	1,890,000.00	3,672,957.96

	UK TREASURY	2,130,000.00	2,622,392.10
	UK TREASURY	1,320,000.00	2,612,371.08
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,283,280.00
	UK TREASURY	1,700,000.00	2,663,288.00
	UK TREASURY	1,720,000.00	3,416,649.96
	UK TREASURY	1,130,000.00	1,486,891.96
	英ボンド 小計	93,430,000.00	114,391,242.61 (17,317,690,218)
スウェーデンクローナ	GOV OF SWEDEN	10,350,000.00	10,750,286.25
	GOV OF SWEDEN	9,680,000.00	10,640,866.79
	GOV OF SWEDEN	9,470,000.00	9,993,548.95
	GOV OF SWEDEN	6,110,000.00	6,394,369.17
	GOV OF SWEDEN	7,090,000.00	7,437,658.15
	GOV OF SWEDEN	6,300,000.00	6,221,968.82
	GOV OF SWEDEN	3,350,000.00	4,041,289.25
	GOV OF SWEDEN	4,960,000.00	7,407,836.88
	スウェーデンクローナ 小計	57,310,000.00	62,887,824.26 (800,562,002)
ノルウェークローネ	GOV OF NORWAY	9,520,000.00	9,736,916.05
	GOV OF NORWAY	7,370,000.00	7,752,576.70
	GOV OF NORWAY	5,390,000.00	5,524,830.85
	GOV OF NORWAY	3,380,000.00	3,438,112.34
	GOV OF NORWAY	7,630,000.00	7,866,949.65
	GOV OF NORWAY	3,330,000.00	3,494,687.14
	GOV OF NORWAY	5,420,000.00	5,610,540.10
	GOV OF NORWAY	5,300,000.00	5,323,214.00
	GOV OF NORWAY	3,510,000.00	3,477,357.00
	ノルウェークローネ 小計	50,850,000.00	52,225,183.83 (661,693,079)
デンマーククローネ	GOV OF DENMARK	8,580,000.00	8,662,164.64
	GOV OF DENMARK	5,770,000.00	6,031,923.38
	GOV OF DENMARK	2,600,000.00	2,644,070.00
	GOV OF DENMARK	7,130,000.00	7,797,706.67
	GOV OF DENMARK	8,370,000.00	8,818,958.43
	GOV OF DENMARK	10,730,000.00	11,360,763.05
	GOV OF DENMARK	3,800,000.00	3,820,403.72

	GOV OF DENMARK	13,350,000.00	23,782,320.10
	GOV OF DENMARK	4,170,000.00	4,025,759.70
	デンマーククローネ 小計	64,500,000.00	76,944,069.69 (1,339,596,253)
ポーランドズロチ	GOV OF POLAND	2,390,000.00	2,529,695.50
	GOV OF POLAND	5,650,000.00	5,819,068.33
	GOV OF POLAND	4,140,000.00	4,443,669.00
	GOV OF POLAND	2,910,000.00	3,043,690.05
	GOV OF POLAND	3,560,000.00	3,709,164.00
	GOV OF POLAND	3,450,000.00	3,427,057.50
	GOV OF POLAND	4,450,000.00	4,822,195.32
	GOV OF POLAND	5,820,000.00	6,160,197.62
	GOV OF POLAND	370,000.00	348,836.00
	GOV OF POLAND	5,090,000.00	5,390,819.00
	GOV OF POLAND	4,420,000.00	4,760,561.00
	GOV OF POLAND	1,120,000.00	1,448,776.00
	GOV OF POLAND	5,170,000.00	5,566,022.00
	GOV OF POLAND	3,810,000.00	3,618,302.88
	ポーランドズロチ 小計	52,350,000.00	55,088,054.20 (1,564,798,214)
オーストラリアドル	GOV OF AUSTRALIA	3,100,000.00	3,182,121.47
	GOV OF AUSTRALIA	2,150,000.00	2,338,392.45
	GOV OF AUSTRALIA	1,460,000.00	1,563,803.50
	GOV OF AUSTRALIA	2,960,000.00	2,962,342.53
	GOV OF AUSTRALIA	2,560,000.00	2,828,004.86
	GOV OF AUSTRALIA	2,210,000.00	2,191,892.36
	GOV OF AUSTRALIA	2,200,000.00	2,571,679.00
	GOV OF AUSTRALIA	2,710,000.00	2,693,771.43
	GOV OF AUSTRALIA	1,940,000.00	2,371,962.13
	GOV OF AUSTRALIA	2,090,000.00	2,337,032.56
	GOV OF AUSTRALIA	1,860,000.00	2,026,147.29
	GOV OF AUSTRALIA	1,430,000.00	1,610,841.22
	GOV OF AUSTRALIA	2,390,000.00	2,787,353.27
	GOV OF AUSTRALIA	2,440,000.00	2,764,692.74
	GOV OF AUSTRALIA	3,270,000.00	3,646,225.27

	GOV OF AUSTRALIA	3,470,000.00	3,414,283.24
	GOV OF AUSTRALIA	3,010,000.00	3,089,456.47
	GOV OF AUSTRALIA	3,260,000.00	3,181,640.35
	GOV OF AUSTRALIA	2,190,000.00	2,183,016.30
	GOV OF AUSTRALIA	2,070,000.00	2,164,592.16
	GOV OF AUSTRALIA	1,440,000.00	1,935,288.86
	GOV OF AUSTRALIA	1,000,000.00	1,154,562.10
	GOV OF AUSTRALIA	1,370,000.00	1,763,337.54
	GOV OF AUSTRALIA	1,130,000.00	1,376,187.21
	GOV OF AUSTRALIA	1,510,000.00	1,714,303.60
	GOV OF AUSTRALIA	1,540,000.00	1,819,804.58
	GOV OF AUSTRALIA	1,750,000.00	1,606,253.94
	オーストラリアドル 小計	58,510,000.00	63,278,988.43 (5,074,974,872)
シンガポールドル	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	811,175.31
	GOV OF SINGAPORE	1,100,000.00	1,121,186.00
	GOV OF SINGAPORE	910,000.00	948,675.00
	GOV OF SINGAPORE	490,000.00	507,983.00
	GOV OF SINGAPORE	1,090,000.00	1,170,442.00
	GOV OF SINGAPORE	540,000.00	574,938.00
	GOV OF SINGAPORE	700,000.00	694,750.00
	GOV OF SINGAPORE	820,000.00	870,516.10
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	987,450.00
	GOV OF SINGAPORE	550,000.00	602,800.00
	GOV OF SINGAPORE	790,000.00	885,590.00
	GOV OF SINGAPORE	1,010,000.00	1,137,260.00
	GOV OF SINGAPORE	330,000.00	336,312.47
	GOV OF SINGAPORE	710,000.00	845,255.00
	GOV OF SINGAPORE	870,000.00	931,482.90
	GOV OF SINGAPORE	380,000.00	414,580.00
	GOV OF SINGAPORE	620,000.00	713,858.70
	GOV OF SINGAPORE	690,000.00	802,815.00
	GOV OF SINGAPORE	770,000.00	771,282.05
	シンガポールドル 小計	14,030,000.00	15,128,351.53 (1,234,170,917)
マレーシアリングット	GOV OF MALAYSIA	1,000,000.00	1,020,889.70

	GOV OF MALAYSIA	2,600,000.00	2,662,297.29	
	GOV OF MALAYSIA	820,000.00	843,860.60	
	GOV OF MALAYSIA	830,000.00	858,725.80	
	GOV OF MALAYSIA	1,560,000.00	1,607,126.19	
	GOV OF MALAYSIA	1,470,000.00	1,544,523.40	
	GOV OF MALAYSIA	1,260,000.00	1,321,208.78	
	GOV OF MALAYSIA	730,000.00	763,805.27	
	GOV OF MALAYSIA	3,030,000.00	3,184,916.62	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,621,764.16	
	GOV OF MALAYSIA	1,190,000.00	1,255,048.01	
	GOV OF MALAYSIA	1,510,000.00	1,596,671.28	
	GOV OF MALAYSIA	700,000.00	735,766.99	
	GOV OF MALAYSIA	1,790,000.00	1,844,327.21	
	GOV OF MALAYSIA	1,890,000.00	1,991,432.14	
	GOV OF MALAYSIA	2,130,000.00	2,213,428.26	
	GOV OF MALAYSIA	2,460,000.00	2,576,924.78	
	GOV OF MALAYSIA	1,130,000.00	1,234,792.47	
	GOV OF MALAYSIA	1,850,000.00	1,749,896.31	
	GOV OF MALAYSIA	1,730,000.00	1,843,676.91	
	GOV OF MALAYSIA	1,410,000.00	1,424,967.29	
	GOV OF MALAYSIA	1,100,000.00	1,195,790.86	
	GOV OF MALAYSIA	2,100,000.00	2,112,189.02	
	GOV OF MALAYSIA	1,380,000.00	1,456,231.20	
	GOV OF MALAYSIA	1,290,000.00	1,421,831.29	
	GOV OF MALAYSIA	890,000.00	978,175.05	
	GOV OF MALAYSIA	2,730,000.00	2,637,907.81	
	GOV OF MALAYSIA	860,000.00	947,646.20	
	GOV OF MALAYSIA	1,180,000.00	1,262,215.90	
	GOV OF MALAYSIA	1,280,000.00	1,394,669.43	
	GOV OF MALAYSIA	1,870,000.00	1,832,577.56	
	マレーシアリングット 小計	47,280,000.00	49,135,283.78	(1,293,653,405)
イスラエルシュケル	GOV OF ISRAEL	1,720,000.00	1,762,484.00	
	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	1,898,533.00	
	GOV OF ISRAEL	2,370,000.00	2,628,685.50	
	GOV OF ISRAEL	3,390,000.00	3,423,561.00	
	GOV OF ISRAEL	1,840,000.00	1,941,292.00	
	GOV OF ISRAEL	860,000.00	869,288.00	
	GOV OF ISRAEL	1,970,000.00	2,654,082.50	
	GOV OF ISRAEL	2,100,000.00	2,284,905.00	
	GOV OF ISRAEL	2,190,000.00	2,456,304.00	
	GOV OF ISRAEL	2,770,000.00	2,775,263.00	
	GOV OF ISRAEL	2,130,000.00	2,055,450.00	
	GOV OF ISRAEL	2,210,000.00	3,608,598.50	
	GOV OF ISRAEL	2,870,000.00	3,765,583.50	
	イスラエルシュケル 小計	32,700,000.00	36,769,508.50	(1,255,652,976)
	合計		275,183,493,689	(275,183,493,689)

(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 246銘柄	100.0%	45.9%
カナダドル	国債証券 35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 345銘柄	100.0%	40.3%
英ポンド	国債証券 52銘柄	100.0%	6.3%
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 14銘柄	100.0%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 27銘柄	100.0%	1.8%
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%
イスラエルシュケル	国債証券 15銘柄	100.0%	0.5%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	839,531,841
株式	57,767,585,540
派生商品評価勘定	9,197,350
未収入金	7,325,086,952
未収配当金	22,229,717
差入委託証拠金	18,975,000
流動資産合計	65,982,606,400
資産合計	65,982,606,400
負債の部	
流動負債	
前受金	13,005,000
未払金	98,481,610
未払解約金	7,634,879,000
未払利息	2,277
流動負債合計	7,746,367,887
負債合計	7,746,367,887
純資産の部	
元本等	
元本	38,337,640,111
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,898,598,402
元本等合計	58,236,238,513
純資産合計	58,236,238,513
負債純資産合計	65,982,606,400

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	26,249,302,541円
期中追加設定元本額	51,700,502,240円
期中一部解約元本額	39,612,164,670円
期末元本額	38,337,640,111円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,706,249,588円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,534,993,235円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,087,063,868円
DCりそな グローバルバランス	30,958,842円
つみたてバランスファンド	3,559,602,135円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	343,788,988円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	187,408,408円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	120,287,303円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	34,711,347円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	22,280,849円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,023,499円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	16,888,731円
リスクコントロール・オープン	9,474,462円
FWりそな国内株式アクティブファンド	665,623,842円
FWりそな国内株式インデックスファンド	22,132,565,055円
Smart-i TOPIXインデックス	1,598,635,112円
Smart-i 8資産バランス 安定型	63,256,000円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	164,593,296円
Smart-i 8資産バランス 成長型	187,374,933円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	246,358,526円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	459,395,869円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	273,351,331円

りそな・リスクコントロールファンド2019-12	199,005,459円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	224,566,646円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	38,716,176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)	2,656,521円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,246,310,790円
りそなFT TOPIXインデックス(適格機関投資家専用)	810,886,716円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	494,386,987円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	864,045,129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)	40,292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)	48,470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)	91,706円
2. 計算日における受益権の総数	38,337,640,111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	1.5190円
(10,000口当たり純資産額)	(15,190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 9月15日現在

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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

金融商品の時価等に関する事項

2021年 9月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2.時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

デリバティブ取引

（その他の注記）の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

（関連当事者との取引に関する注記）

2021年 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		5,766,981,230
合計		5,766,981,230

(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 9月15日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 買建	469,777,650	-	478,975,000	9,197,350
	合計	469,777,650	-	478,975,000	9,197,350

(注) 時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	900	3,095.00	2,785,500	
日本水産	25,300	636.00	16,090,800	
マルハニチロ	4,300	2,664.00	11,455,200	
雪国まいたけ	2,200	1,658.00	3,647,600	
カネコ種苗	800	1,580.00	1,264,000	
サカタのタネ	3,300	3,595.00	11,863,500	
ホクト	2,300	1,992.00	4,581,600	
ホクリヨウ	400	768.00	307,200	
住石ホールディングス	4,800	140.00	672,000	
日鉄鉱業	600	6,930.00	4,158,000	
三井松島ホールディングス	1,100	1,425.00	1,567,500	
I N P E X	109,500	774.00	84,753,000	
石油資源開発	3,600	1,903.00	6,850,800	
K & O エナジーグループ	1,300	1,396.00	1,814,800	
ヒノキヤグループ	600	2,390.00	1,434,000	
ショーボンドホールディングス	3,900	5,110.00	19,929,000	
ミライト・ホールディングス	9,500	2,328.00	22,116,000	

タマホーム	1,700	2,871.00	4,880,700	
サンヨーホームズ	300	735.00	220,500	
日本アクア	1,100	608.00	668,800	
ファーストコーポレーション	800	816.00	652,800	
ベステラ	500	1,510.00	755,000	
Robot Home	4,500	258.00	1,161,000	
キャンディル	500	629.00	314,500	
スペースバリューホールディングス	3,300	843.00	2,781,900	
ダイセキ環境ソリューション	500	1,450.00	725,000	
第一カッター興業	700	1,359.00	951,300	
安藤・間	17,500	847.00	14,822,500	
東急建設	8,000	806.00	6,448,000	
コムシスホールディングス	9,700	3,065.00	29,730,500	
ピーアールホールディングス	3,700	521.00	1,927,700	
高松コンストラクショングループ	1,700	2,102.00	3,573,400	
東建コーポレーション	800	10,460.00	8,368,000	
ソネック	300	1,141.00	342,300	
ヤマウラ	1,200	953.00	1,143,600	
オリエンタル白石	9,200	269.00	2,474,800	
大成建設	19,600	3,685.00	72,226,000	
大林組	63,000	953.00	60,039,000	
清水建設	59,000	844.00	49,796,000	
飛島建設	1,800	1,143.00	2,057,400	
長谷工コーポレーション	20,600	1,571.00	32,362,600	
松井建設	2,500	828.00	2,070,000	
銭高組	300	4,445.00	1,333,500	
鹿島建設	46,200	1,508.00	69,669,600	
不動テトラ	1,500	1,825.00	2,737,500	
大末建設	800	1,009.00	807,200	
鉄建建設	1,300	1,844.00	2,397,200	
西松建設	4,500	3,640.00	16,380,000	
三井住友建設	15,200	497.00	7,554,400	
大豊建設	1,400	3,955.00	5,537,000	
前田建設工業	15,800	874.00	13,809,200	
佐田建設	1,500	483.00	724,500	
ナカノフドー建設	1,500	360.00	540,000	

奥村組	3,500	3,155.00	11,042,500	
東鉄工業	2,700	2,519.00	6,801,300	
イチケン	500	1,970.00	985,000	
富士ピー・エス	800	597.00	477,600	
浅沼組	800	4,690.00	3,752,000	
戸田建設	26,200	825.00	21,615,000	
熊谷組	2,900	2,808.00	8,143,200	
北野建設	400	2,193.00	877,200	
植木組	600	1,530.00	918,000	
矢作建設工業	2,800	825.00	2,310,000	
ピーエス三菱	2,100	667.00	1,400,700	
日本ハウスホールディングス	4,300	449.00	1,930,700	
大東建託	6,900	13,660.00	94,254,000	
新日本建設	2,700	921.00	2,486,700	
N I P P O	5,200	3,985.00	20,722,000	
東亜道路工業	400	4,695.00	1,878,000	
前田道路	3,900	1,993.00	7,772,700	
日本道路	600	8,560.00	5,136,000	
東亜建設工業	1,700	2,462.00	4,185,400	
日本国土開発	6,100	615.00	3,751,500	
若築建設	1,100	2,178.00	2,395,800	
東洋建設	7,100	576.00	4,089,600	
五洋建設	26,800	762.00	20,421,600	
世紀東急工業	3,000	889.00	2,667,000	
福田組	700	5,200.00	3,640,000	
住友林業	16,100	2,232.00	35,935,200	
日本基礎技術	1,900	622.00	1,181,800	
巴コーポレーション	2,800	496.00	1,388,800	
大和ハウス工業	58,200	3,836.00	223,255,200	
ライト工業	3,600	1,973.00	7,102,800	
積水ハウス	68,400	2,367.50	161,937,000	
日特建設	1,600	743.00	1,188,800	
北陸電気工事	1,100	1,348.00	1,482,800	
ユアテック	3,600	756.00	2,721,600	
日本リーテック	1,300	1,774.00	2,306,200	
四電工	300	3,615.00	1,084,500	

中電工	2,900	2,373.00	6,881,700
関電工	10,200	954.00	9,730,800
きんでん	12,800	1,942.00	24,857,600
東京エネシス	2,100	1,116.00	2,343,600
トーエネック	600	3,800.00	2,280,000
住友電設	1,800	2,422.00	4,359,600
日本電設工業	3,500	1,862.00	6,517,000
協和エクシオ	9,600	2,884.00	27,686,400
新日本空調	1,700	2,553.00	4,340,100
九電工	4,400	4,110.00	18,084,000
三機工業	4,500	1,566.00	7,047,000
日揮ホールディングス	21,000	991.00	20,811,000
中外炉工業	700	1,906.00	1,334,200
ヤマト	2,000	792.00	1,584,000
太平電業	1,400	2,962.00	4,146,800
高砂熱学工業	5,700	2,202.00	12,551,400
三晃金属工業	200	2,317.00	463,400
朝日工業社	500	3,570.00	1,785,000
明星工業	4,100	788.00	3,230,800
大気社	3,100	3,485.00	10,803,500
ダイダン	1,400	2,785.00	3,899,000
日比谷総合設備	2,000	1,975.00	3,950,000
フィル・カンパニー	400	3,135.00	1,254,000
テスホールディングス	1,100	2,548.00	2,802,800
東洋エンジニアリング	2,600	943.00	2,451,800
レイズネクスト	3,400	1,240.00	4,216,000
ニッポン	5,900	1,672.00	9,864,800
日清製粉グループ本社	22,800	1,922.00	43,821,600
日東富士製粉	100	6,880.00	688,000
昭和産業	1,700	2,836.00	4,821,200
鳥越製粉	1,800	797.00	1,434,600
中部飼料	2,500	1,150.00	2,875,000
フィード・ワン	2,700	783.00	2,114,100
東洋精糖	300	1,199.00	359,700
日本甜菜製糖	1,100	1,670.00	1,837,000
D M三井製糖ホールディングス	1,600	1,999.00	3,198,400

塩水港精糖	2,400	228.00	547,200
日新製糖	1,000	1,737.00	1,737,000
森永製菓	4,700	4,070.00	19,129,000
中村屋	500	3,940.00	1,970,000
江崎グリコ	5,600	4,365.00	24,444,000
名糖産業	900	1,817.00	1,635,300
井村屋グループ	1,100	2,430.00	2,673,000
不二家	1,100	2,446.00	2,690,600
山崎製パン	15,100	1,943.00	29,339,300
第一屋製パン	400	824.00	329,600
モロゾフ	300	5,590.00	1,677,000
亀田製菓	1,100	4,610.00	5,071,000
寿スピリッツ	1,900	7,220.00	13,718,000
カルビー	9,200	2,856.00	26,275,200
森永乳業	3,700	7,230.00	26,751,000
六甲バター	1,500	1,676.00	2,514,000
ヤクルト本社	13,900	5,730.00	79,647,000
明治ホールディングス	13,300	7,330.00	97,489,000
雪印メグミルク	4,900	2,331.00	11,421,900
プリマハム	2,800	3,080.00	8,624,000
日本ハム	7,700	4,490.00	34,573,000
林兼産業	700	618.00	432,600
丸大食品	2,000	1,818.00	3,636,000
S Foods	1,800	3,190.00	5,742,000
柿安本店	700	2,655.00	1,858,500
伊藤ハム米久ホールディングス	13,000	757.00	9,841,000
サッポロホールディングス	6,900	2,515.00	17,353,500
アサヒグループホールディングス	47,500	5,445.00	258,637,500
キリンホールディングス	74,100	2,063.50	152,905,350
宝ホールディングス	15,000	1,601.00	24,015,000
オエノンホールディングス	5,700	394.00	2,245,800
養命酒製造	600	1,904.00	1,142,400
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14,200	1,596.00	22,663,200
サントリー食品インターナショナル	13,500	4,755.00	64,192,500
ダイドーグループホールディングス	1,100	5,870.00	6,457,000

伊藤園	6,100	7,680.00	46,848,000
キーコーヒー	2,000	2,267.00	4,534,000
ユニカフェ	600	1,100.00	660,000
ジャパンフーズ	300	1,258.00	377,400
日清オイリオグループ	2,500	3,145.00	7,862,500
不二製油グループ本社	4,900	2,622.00	12,847,800
かどや製油	200	4,250.00	850,000
J-オイルミルズ	1,900	1,859.00	3,532,100
キッコーマン	14,500	9,290.00	134,705,000
味の素	48,000	3,542.00	170,016,000
ブルドックソース	900	2,248.00	2,023,200
キューピー	11,200	2,776.00	31,091,200
ハウス食品グループ本社	7,500	3,685.00	27,637,500
カゴメ	7,700	2,991.00	23,030,700
焼津水産化学工業	1,000	1,044.00	1,044,000
アリアケジャパン	1,800	6,690.00	12,042,000
ピエトロ	300	1,830.00	549,000
エバラ食品工業	400	2,623.00	1,049,200
やまみ	200	1,914.00	382,800
ニチレイ	9,600	2,951.00	28,329,600
東洋水産	10,400	5,090.00	52,936,000
イトアンドホールディングス	700	2,320.00	1,624,000
大冷	200	2,008.00	401,600
ヨシムラ・フード・ホールディングス	1,100	787.00	865,700
日清食品ホールディングス	7,900	9,040.00	71,416,000
永谷園ホールディングス	1,000	2,194.00	2,194,000
一正蒲鉾	800	946.00	756,800
フジッコ	2,200	1,942.00	4,272,400
ロック・フィールド	2,200	1,688.00	3,713,600
日本たばこ産業	108,200	2,177.50	235,605,500
ケンコーマヨネーズ	1,200	1,628.00	1,953,600
わらべや日洋ホールディングス	1,300	2,538.00	3,299,400
なとり	1,100	2,028.00	2,230,800
イフジ産業	300	960.00	288,000
ピクルスコーポレーション	1,000	2,156.00	2,156,000
ファーマフーズ	1,900	2,695.00	5,120,500

北の達人コーポレーション	7,000	496.00	3,472,000	
ユーグレナ	10,300	895.00	9,218,500	
紀文食品	1,200	1,341.00	1,609,200	
ミヨシ油脂	800	1,357.00	1,085,600	
理研ビタミン	1,900	1,925.00	3,657,500	
片倉工業	2,200	1,586.00	3,489,200	
ゲンゼ	1,400	4,490.00	6,286,000	
東洋紡	7,800	1,433.00	11,177,400	
ユニチカ	5,800	390.00	2,262,000	
富士紡ホールディングス	1,000	4,500.00	4,500,000	
倉敷紡績	1,700	2,067.00	3,513,900	
シキボウ	1,100	947.00	1,041,700	
日本毛織	5,900	1,048.00	6,183,200	
ダイトウボウ	3,200	101.00	323,200	
トーア紡コーポレーション	700	436.00	305,200	
グライダーリミテッド	2,600	172.00	447,200	
帝国繊維	2,200	2,144.00	4,716,800	
帝人	18,500	1,646.00	30,451,000	
東レ	142,500	739.70	105,407,250	
サカイオーベックス	500	3,795.00	1,897,500	
住江織物	400	1,899.00	759,600	
日本フェルト	1,100	468.00	514,800	
イチカワ	300	1,400.00	420,000	
日東製網	200	1,529.00	305,800	
アツギ	1,500	648.00	972,000	
ダイニック	700	789.00	552,300	
セーレン	4,800	2,118.00	10,166,400	
ソトー	800	840.00	672,000	
東海染工	200	1,130.00	226,000	
小松マテーレ	3,200	1,036.00	3,315,200	
ワコールホールディングス	4,900	2,380.00	11,662,000	
ホギメディカル	2,700	3,360.00	9,072,000	
クラウディアホールディングス	500	295.00	147,500	
T S Iホールディングス	6,000	341.00	2,046,000	
マツオカコーポレーション	600	1,488.00	892,800	
ワールド	2,600	1,481.00	3,850,600	

三陽商会	1,000	953.00	953,000
ナイガイ	700	355.00	248,500
オンワードホールディングス	11,800	329.00	3,882,200
ルックホールディングス	600	1,428.00	856,800
キムラタン	11,000	23.00	253,000
ゴールドウイン	3,300	7,350.00	24,255,000
デサント	3,400	4,315.00	14,671,000
キング	1,000	529.00	529,000
ヤマトインターナショナル	1,700	335.00	569,500
特種東海製紙	1,200	4,675.00	5,610,000
王子ホールディングス	88,600	592.00	52,451,200
日本製紙	8,700	1,238.00	10,770,600
三菱製紙	2,800	382.00	1,069,600
北越コーポレーション	14,100	674.00	9,503,400
中越パルプ工業	800	1,242.00	993,600
巴川製紙所	600	927.00	556,200
大王製紙	9,500	2,191.00	20,814,500
阿波製紙	500	407.00	203,500
レンゴー	20,300	922.00	18,716,600
トーモク	1,200	1,988.00	2,385,600
ザ・バック	1,500	3,130.00	4,695,000
クラレ	28,800	1,075.00	30,960,000
旭化成	130,500	1,253.50	163,581,750
共和レザー	1,100	709.00	779,900
昭和電工	17,100	2,736.00	46,785,600
住友化学	155,000	597.00	92,535,000
住友精化	1,000	3,765.00	3,765,000
日産化学	10,800	6,910.00	74,628,000
ラサ工業	600	2,057.00	1,234,200
クレハ	1,700	8,700.00	14,790,000
多木化学	800	7,050.00	5,640,000
テイカ	1,400	1,423.00	1,992,200
石原産業	3,500	1,340.00	4,690,000
片倉コープアグリ	500	1,238.00	619,000
日本曹達	2,800	3,720.00	10,416,000
東ソー	30,400	2,179.00	66,241,600

トクヤマ	5,800	2,274.00	13,189,200	
セントラル硝子	3,800	2,198.00	8,352,400	
東亜合成	11,200	1,365.00	15,288,000	
大阪ソーダ	2,000	2,887.00	5,774,000	
関東電化工業	4,700	1,133.00	5,325,100	
デンカ	7,200	4,185.00	30,132,000	
信越化学工業	36,400	21,140.00	769,496,000	
日本カーバイド工業	700	1,485.00	1,039,500	
堺化学工業	1,400	2,374.00	3,323,600	
第一稀元素化学工業	2,000	1,720.00	3,440,000	
エア・ウォーター	20,100	1,872.00	37,627,200	
日本酸素ホールディングス	16,200	3,020.00	48,924,000	
日本化学工業	600	3,540.00	2,124,000	
東邦アセチレン	300	1,399.00	419,700	
日本パーカラライジング	9,900	1,250.00	12,375,000	
高压ガス工業	3,100	781.00	2,421,100	
チタン工業	200	1,932.00	386,400	
四国化成工業	2,600	1,461.00	3,798,600	
戸田工業	400	3,620.00	1,448,000	
ステラ ケミファ	1,100	3,120.00	3,432,000	
保土谷化学工業	600	5,350.00	3,210,000	
日本触媒	3,600	6,090.00	21,924,000	
大日精化工業	1,600	2,764.00	4,422,400	
カネカ	5,100	4,935.00	25,168,500	
三菱瓦斯化学	19,700	2,477.00	48,796,900	
三井化学	17,000	3,985.00	67,745,000	
J S R	19,800	4,215.00	83,457,000	
東京応化工業	3,400	8,020.00	27,268,000	
大阪有機化学工業	1,700	4,225.00	7,182,500	
三菱ケミカルホールディングス	131,600	1,051.50	138,377,400	
K Hネオケム	3,200	3,230.00	10,336,000	
ダイセル	26,500	898.00	23,797,000	
住友ベークライト	3,100	5,650.00	17,515,000	
積水化学工業	41,200	2,042.00	84,130,400	
日本ゼオン	17,800	1,649.00	29,352,200	
アイカ工業	5,500	3,940.00	21,670,000	

宇部興産	9,900	2,339.00	23,156,100	
積水樹脂	3,000	2,305.00	6,915,000	
タキロンシーアイ	4,300	667.00	2,868,100	
旭有機材	1,100	1,550.00	1,705,000	
ニチバン	1,000	1,848.00	1,848,000	
リケンテクノス	4,800	606.00	2,908,800	
大倉工業	1,000	2,321.00	2,321,000	
積水化成成品工業	2,600	621.00	1,614,600	
群栄化学工業	400	3,170.00	1,268,000	
タイガースポリマー	1,000	451.00	451,000	
ミライアル	600	1,804.00	1,082,400	
ダイキアクシス	800	962.00	769,600	
ダイキョーニシカワ	4,200	691.00	2,902,200	
竹本容器	700	950.00	665,000	
森六ホールディングス	1,100	2,218.00	2,439,800	
恵和	500	4,765.00	2,382,500	
日本化薬	12,200	1,286.00	15,689,200	
カーリットホールディングス	2,000	964.00	1,928,000	
日本精化	1,400	2,443.00	3,420,200	
扶桑化学工業	1,600	5,170.00	8,272,000	
トリケミカル研究所	1,800	3,755.00	6,759,000	
A D E K A	9,100	2,726.00	24,806,600	
日油	7,400	6,720.00	49,728,000	
新日本理化	3,300	356.00	1,174,800	
ハリマ化成グループ	1,500	939.00	1,408,500	
花王	44,500	6,789.00	302,110,500	
第一工業製薬	700	3,435.00	2,404,500	
石原ケミカル	500	2,972.00	1,486,000	
日華化学	700	1,134.00	793,800	
ニイタカ	400	2,408.00	963,200	
三洋化成工業	1,200	6,120.00	7,344,000	
有機合成薬品工業	1,500	337.00	505,500	
大日本塗料	2,200	901.00	1,982,200	
日本ペイントホールディングス	74,000	1,468.00	108,632,000	
関西ペイント	22,100	3,025.00	66,852,500	
神東塗料	1,500	199.00	298,500	

中国塗料	4,700	940.00	4,418,000	
日本特殊塗料	1,500	1,098.00	1,647,000	
藤倉化成	2,700	563.00	1,520,100	
太陽ホールディングス	1,400	6,180.00	8,652,000	
D I C	8,300	3,310.00	27,473,000	
サカティンクス	3,900	1,219.00	4,754,100	
東洋インキ S C ホールディングス	4,200	2,162.00	9,080,400	
T & K T O K A	1,400	890.00	1,246,000	
富士フイルムホールディングス	35,300	10,015.00	353,529,500	
資生堂	37,400	8,109.00	303,276,600	
ライオン	24,300	1,856.00	45,100,800	
高砂香料工業	1,300	3,080.00	4,004,000	
マンダム	4,200	1,626.00	6,829,200	
ミルボン	2,500	6,880.00	17,200,000	
ファンケル	7,300	3,815.00	27,849,500	
コーセー	3,800	13,300.00	50,540,000	
コタ	1,300	1,683.00	2,187,900	
シーボン	300	1,915.00	574,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	8,600	2,636.00	22,669,600	
ノエビアホールディングス	1,700	6,020.00	10,234,000	
アジュバンコスメジャパン	400	1,065.00	426,000	
新日本製薬	500	2,008.00	1,004,000	
エステー	1,300	1,845.00	2,398,500	
アグロ カネショウ	700	1,631.00	1,141,700	
コニシ	3,300	1,848.00	6,098,400	
長谷川香料	3,500	3,035.00	10,622,500	
星光 P M C	1,200	882.00	1,058,400	
小林製薬	5,600	8,860.00	49,616,000	
荒川化学工業	1,700	1,320.00	2,244,000	
メック	1,500	3,825.00	5,737,500	
日本高純度化学	600	3,085.00	1,851,000	
タカラバイオ	5,300	3,255.00	17,251,500	
J C U	2,300	4,690.00	10,787,000	
新田ゼラチン	1,300	666.00	865,800	
O A T アグリオ	400	1,949.00	779,600	
デクセリアルズ	5,600	2,410.00	13,496,000	

アース製薬	1,700	6,950.00	11,815,000	
北興化学工業	1,900	1,233.00	2,342,700	
大成ラミック	600	2,966.00	1,779,600	
クミアイ化学工業	7,500	924.00	6,930,000	
日本農薬	3,600	571.00	2,055,600	
アキレス	1,400	1,382.00	1,934,800	
有沢製作所	2,800	929.00	2,601,200	
日東電工	12,100	8,740.00	105,754,000	
レック	2,400	1,134.00	2,721,600	
三光合成	2,100	479.00	1,005,900	
きもと	3,100	258.00	799,800	
藤森工業	1,800	5,010.00	9,018,000	
前澤化成工業	1,300	1,300.00	1,690,000	
未来工業	700	1,700.00	1,190,000	
ウェーブロックホールディングス	700	713.00	499,100	
J S P	1,200	1,687.00	2,024,400	
エフピコ	3,700	4,380.00	16,206,000	
天馬	1,500	3,070.00	4,605,000	
信越ポリマー	3,100	1,080.00	3,348,000	
東リ	5,000	243.00	1,215,000	
ニフコ	7,400	3,650.00	27,010,000	
バルカー	1,600	2,290.00	3,664,000	
ユニ・チャーム	38,700	4,940.00	191,178,000	
ショーエイコーポレーション	400	876.00	350,400	
協和キリン	23,600	4,080.00	96,288,000	
武田薬品工業	167,200	3,723.00	622,485,600	
アステラス製薬	174,300	1,860.00	324,198,000	
大日本住友製薬	14,900	2,053.00	30,589,700	
塩野義製薬	25,300	7,500.00	189,750,000	
わかもと製薬	2,400	351.00	842,400	
日本新薬	5,700	9,440.00	53,808,000	
中外製薬	62,900	4,168.00	262,167,200	
科研製薬	3,400	4,885.00	16,609,000	
エーザイ	22,200	8,336.00	185,059,200	
ロート製薬	9,600	3,495.00	33,552,000	
小野薬品工業	46,200	2,640.00	121,968,000	

久光製薬	5,800	4,400.00	25,520,000	
持田製薬	2,800	3,565.00	9,982,000	
参天製薬	35,000	1,661.00	58,135,000	
扶桑薬品工業	600	2,598.00	1,558,800	
日本ケミファ	200	2,336.00	467,200	
ツムラ	6,700	3,880.00	25,996,000	
日医工	5,700	918.00	5,232,600	
キッセイ薬品工業	3,600	2,568.00	9,244,800	
生化学工業	3,500	1,135.00	3,972,500	
栄研化学	3,500	2,281.00	7,983,500	
日水製薬	700	1,034.00	723,800	
鳥居薬品	1,100	3,035.00	3,338,500	
JCRファーマ	5,700	2,973.00	16,946,100	
東和薬品	2,900	3,385.00	9,816,500	
富士製薬工業	1,200	1,223.00	1,467,600	
ゼリア新薬工業	3,600	2,182.00	7,855,200	
第一三共	158,000	2,723.50	430,313,000	
キョーリン製薬ホールディングス	4,400	1,884.00	8,289,600	
大幸薬品	3,000	952.00	2,856,000	
ダイト	1,300	3,505.00	4,556,500	
大塚ホールディングス	41,800	4,867.00	203,440,600	
大正製薬ホールディングス	5,000	6,580.00	32,900,000	
ペプチドリーム	10,500	3,880.00	40,740,000	
あすか製薬ホールディングス	2,300	1,114.00	2,562,200	
サワイグループホールディングス	4,400	5,220.00	22,968,000	
日本コークス工業	16,900	132.00	2,230,800	
ニチレキ	2,400	1,355.00	3,252,000	
ユシロ化学工業	1,100	1,253.00	1,378,300	
ビーピー・カストロール	700	1,394.00	975,800	
富士石油	4,900	258.00	1,264,200	
MORESCO	700	1,238.00	866,600	
出光興産	22,300	2,790.00	62,217,000	
ENEOSホールディングス	302,400	457.20	138,257,280	
コスモエネルギーホールディングス	6,300	2,400.00	15,120,000	
横浜ゴム	11,600	1,995.00	23,142,000	
TOYO TIRE	10,600	1,995.00	21,147,000	

ブリヂストン	57,900	5,273.00	305,306,700	
住友ゴム工業	18,100	1,399.00	25,321,900	
藤倉コンポジット	1,800	804.00	1,447,200	
オカモト	1,200	4,515.00	5,418,000	
フコク	900	1,067.00	960,300	
ニッタ	2,100	2,882.00	6,052,200	
住友理工	3,900	749.00	2,921,100	
三ツ星ベルト	2,400	2,100.00	5,040,000	
バンドー化学	3,500	979.00	3,426,500	
日東紡績	3,000	3,795.00	11,385,000	
A G C	18,500	5,810.00	107,485,000	
日本板硝子	10,200	591.00	6,028,200	
石塚硝子	300	2,167.00	650,100	
日本山村硝子	800	930.00	744,000	
日本電気硝子	8,100	2,461.00	19,934,100	
オハラ	800	1,589.00	1,271,200	
住友大阪セメント	3,600	3,115.00	11,214,000	
太平洋セメント	11,400	2,491.00	28,397,400	
日本ヒューム	1,800	764.00	1,375,200	
日本コンクリート工業	4,300	319.00	1,371,700	
三谷セキサン	900	6,850.00	6,165,000	
アジアパイルホールディングス	3,100	512.00	1,587,200	
東海カーボン	16,800	1,607.00	26,997,600	
日本カーボン	1,000	4,410.00	4,410,000	
東洋炭素	1,300	3,250.00	4,225,000	
ノリタケカンパニーリミテド	1,100	4,610.00	5,071,000	
T O T O	14,400	6,550.00	94,320,000	
日本碍子	22,100	1,942.00	42,918,200	
日本特殊陶業	15,300	1,792.00	27,417,600	
ダントーホールディングス	1,300	281.00	365,300	
M A R U W A	700	11,860.00	8,302,000	
品川リフラクトリーズ	500	4,100.00	2,050,000	
黒崎播磨	300	5,220.00	1,566,000	
ヨータイ	1,400	1,412.00	1,976,800	
イソライト工業	900	723.00	650,700	
東京窯業	2,500	346.00	865,000	

ニッカトー	900	724.00	651,600	
フジインコーポレーテッド	1,600	6,760.00	10,816,000	
クニミネ工業	600	1,161.00	696,600	
エーアンドエーマテリアル	400	1,022.00	408,800	
ニチアス	5,100	2,989.00	15,243,900	
ニチハ	2,800	3,480.00	9,744,000	
日本製鉄	94,900	2,307.00	218,934,300	
神戸製鋼所	36,400	750.00	27,300,000	
中山製鋼所	2,800	452.00	1,265,600	
合同製鐵	1,100	1,592.00	1,751,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	57,500	1,902.00	109,365,000	
東京製鐵	7,700	1,292.00	9,948,400	
共英製鋼	2,200	1,503.00	3,306,600	
大和工業	4,200	4,010.00	16,842,000	
東京鐵鋼	800	1,656.00	1,324,800	
大阪製鐵	1,100	1,226.00	1,348,600	
淀川製鋼所	2,600	2,563.00	6,663,800	
丸一鋼管	6,500	2,869.00	18,648,500	
モリ工業	600	2,526.00	1,515,600	
大同特殊鋼	3,300	5,180.00	17,094,000	
日本高周波鋼業	700	409.00	286,300	
日本冶金工業	1,500	2,851.00	4,276,500	
山陽特殊製鋼	2,400	1,922.00	4,612,800	
愛知製鋼	1,100	2,843.00	3,127,300	
日立金属	18,700	2,149.00	40,186,300	
日本金属	500	1,114.00	557,000	
大平洋金属	1,300	1,997.00	2,596,100	
新日本電工	12,800	345.00	4,416,000	
栗本鐵工所	900	1,702.00	1,531,800	
虹技	300	1,163.00	348,900	
日本鑄鉄管	200	1,231.00	246,200	
三菱製鋼	1,500	1,427.00	2,140,500	
日亜鋼業	2,900	304.00	881,600	
日本精線	300	5,240.00	1,572,000	
エンビプロ・ホールディングス	800	1,732.00	1,385,600	
シンニッタン	2,400	253.00	607,200	

新家工業	500	1,570.00	785,000	
大紀アルミニウム工業所	3,000	1,812.00	5,436,000	
日本軽金属ホールディングス	5,400	2,106.00	11,372,400	
三井金属鉱業	5,400	3,470.00	18,738,000	
東邦亜鉛	1,100	2,903.00	3,193,300	
三菱マテリアル	13,100	2,343.00	30,693,300	
住友金属鉱山	25,400	4,365.00	110,871,000	
D O W Aホールディングス	5,000	4,945.00	24,725,000	
古河機械金属	3,300	1,311.00	4,326,300	
エス・サイエンス	9,600	35.00	336,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,100	820.00	1,722,000	
東邦チタニウム	3,600	1,230.00	4,428,000	
U A C J	3,000	3,005.00	9,015,000	
C Kサンエツ	400	3,480.00	1,392,000	
古河電気工業	6,200	2,433.00	15,084,600	
住友電気工業	69,400	1,527.00	105,973,800	
フジクラ	24,000	684.00	16,416,000	
昭和電線ホールディングス	1,900	2,367.00	4,497,300	
東京特殊電線	300	2,942.00	882,600	
タツタ電線	3,500	561.00	1,963,500	
カナレ電気	300	1,769.00	530,700	
平河ヒューテック	1,100	1,284.00	1,412,400	
リョービ	2,400	1,357.00	3,256,800	
アーレスティ	2,400	457.00	1,096,800	
アサヒホールディングス	7,500	2,231.00	16,732,500	
稲葉製作所	1,100	1,434.00	1,577,400	
宮地エンジニアリンググループ	600	2,688.00	1,612,800	
トーカロ	5,100	1,479.00	7,542,900	
アルファC o	700	1,300.00	910,000	
S U M C O	25,400	2,538.00	64,465,200	
川田テクノロジーズ	400	3,845.00	1,538,000	
R S Technologies	600	6,420.00	3,852,000	
ジェイテックコーポレーション	200	2,451.00	490,200	
信和	1,100	736.00	809,600	
東洋製罐グループホールディングス	12,700	1,384.00	17,576,800	
ホッカンホールディングス	1,000	1,515.00	1,515,000	

コロナ	1,100	921.00	1,013,100	
横河ブリッジホールディングス	3,400	2,427.00	8,251,800	
駒井ハルテック	400	1,814.00	725,600	
高田機工	200	2,940.00	588,000	
三和ホールディングス	18,700	1,551.00	29,003,700	
文化シャッター	5,900	1,169.00	6,897,100	
三協立山	2,600	807.00	2,098,200	
アルインコ	1,300	1,071.00	1,392,300	
東洋シャッター	400	669.00	267,600	
L I X I L	27,400	3,280.00	89,872,000	
日本ファイルコン	1,400	535.00	749,000	
ノーリツ	3,800	1,960.00	7,448,000	
長府製作所	2,000	2,184.00	4,368,000	
リンナイ	3,900	13,390.00	52,221,000	
ダイニチ工業	1,000	803.00	803,000	
日東精工	2,500	717.00	1,792,500	
三洋工業	200	1,915.00	383,000	
岡部	4,000	709.00	2,836,000	
ジーテクト	2,500	1,557.00	3,892,500	
東プレ	3,700	1,412.00	5,224,400	
高周波熱錬	3,800	690.00	2,622,000	
東京製綱	1,400	1,027.00	1,437,800	
サンコール	1,700	496.00	843,200	
モリテック スチール	1,500	477.00	715,500	
パイオラックス	2,900	1,607.00	4,660,300	
エイチワン	1,900	754.00	1,432,600	
日本発條	19,800	830.00	16,434,000	
中央発條	1,000	1,129.00	1,129,000	
アドバネクス	300	1,362.00	408,600	
立川ブラインド工業	900	1,345.00	1,210,500	
三益半導体工業	1,600	2,677.00	4,283,200	
日本ドライケミカル	500	2,265.00	1,132,500	
日本製鋼所	6,000	3,050.00	18,300,000	
三浦工業	8,600	5,170.00	44,462,000	
タクマ	6,700	1,710.00	11,457,000	
ツガミ	4,100	2,010.00	8,241,000	

オークマ	2,300	5,830.00	13,409,000	
芝浦機械	2,100	2,808.00	5,896,800	
アマダ	29,100	1,246.00	36,258,600	
アイダエンジニアリング	5,200	1,170.00	6,084,000	
滝澤鉄工所	600	1,146.00	687,600	
F U J I	7,900	3,140.00	24,806,000	
牧野フライス製作所	2,300	4,640.00	10,672,000	
オーエスジー	9,200	2,136.00	19,651,200	
ダイジェット工業	200	1,239.00	247,800	
旭ダイヤモンド工業	5,200	551.00	2,865,200	
D M G 森精機	11,800	2,228.00	26,290,400	
ソディック	4,400	975.00	4,290,000	
ディスコ	2,700	36,200.00	97,740,000	
日東工器	1,000	2,100.00	2,100,000	
日進工具	1,600	1,479.00	2,366,400	
パンチ工業	1,700	628.00	1,067,600	
富士ダイス	1,000	695.00	695,000	
豊和工業	1,100	873.00	960,300	
O K K	800	413.00	330,400	
石川製作所	500	1,725.00	862,500	
東洋機械金属	1,400	521.00	729,400	
津田駒工業	400	872.00	348,800	
エンシュウ	500	833.00	416,500	
島精機製作所	2,900	2,443.00	7,084,700	
オプトラン	2,500	2,354.00	5,885,000	
N C ホールディングス	600	1,432.00	859,200	
イワキポンプ	1,300	1,037.00	1,348,100	
フリーー	1,900	1,764.00	3,351,600	
ヤマシンフィルタ	4,000	689.00	2,756,000	
日阪製作所	2,500	924.00	2,310,000	
やまびこ	3,900	1,333.00	5,198,700	
野村マイクロ・サイエンス	400	5,550.00	2,220,000	
平田機工	900	7,320.00	6,588,000	
ペガサスミシン製造	2,000	449.00	898,000	
マルマエ	800	2,288.00	1,830,400	
タツモ	900	1,730.00	1,557,000	

ナブテスコ	11,300	4,860.00	54,918,000	
三井海洋開発	2,100	1,753.00	3,681,300	
レオン自動機	1,900	1,585.00	3,011,500	
S M C	5,900	78,800.00	464,920,000	
ホソカワミクロン	700	7,370.00	5,159,000	
ユニオンツール	700	4,110.00	2,877,000	
オイレス工業	2,800	1,756.00	4,916,800	
日精エー・エス・ビー機械	700	4,395.00	3,076,500	
サトーホールディングス	2,600	2,868.00	7,456,800	
技研製作所	1,800	4,905.00	8,829,000	
日本エアージェット	900	1,328.00	1,195,200	
カワタ	500	1,000.00	500,000	
日精樹脂工業	1,500	1,223.00	1,834,500	
オカダアイヨン	600	1,395.00	837,000	
ワイエイシイホールディングス	800	972.00	777,600	
小松製作所	91,100	2,821.50	257,038,650	
住友重機械工業	11,500	3,175.00	36,512,500	
日立建機	9,400	3,375.00	31,725,000	
日工	3,000	695.00	2,085,000	
巴工業	800	2,464.00	1,971,200	
井関農機	1,900	1,811.00	3,440,900	
T O W A	1,900	2,971.00	5,644,900	
丸山製作所	400	1,693.00	677,200	
北川鉄工所	900	1,683.00	1,514,700	
ローツェ	900	9,260.00	8,334,000	
タカキタ	700	704.00	492,800	
クボタ	98,000	2,511.50	246,127,000	
荏原実業	900	2,885.00	2,596,500	
三菱化工機	600	2,573.00	1,543,800	
月島機械	3,700	1,225.00	4,532,500	
帝国電機製作所	1,400	1,408.00	1,971,200	
東京機械製作所	800	1,635.00	1,308,000	
新東工業	4,800	822.00	3,945,600	
澁谷工業	1,800	3,270.00	5,886,000	
アイチ コーポレーション	3,400	783.00	2,662,200	
小森コーポレーション	5,100	910.00	4,641,000	

鶴見製作所	1,500	1,859.00	2,788,500	
住友精密工業	300	2,600.00	780,000	
日本ギア工業	800	327.00	261,600	
酒井重工業	400	2,656.00	1,062,400	
荏原製作所	8,300	6,150.00	51,045,000	
石井鐵工所	300	3,120.00	936,000	
西島製作所	2,000	959.00	1,918,000	
北越工業	2,100	1,028.00	2,158,800	
ダイキン工業	25,600	29,055.00	743,808,000	
オルガノ	700	7,220.00	5,054,000	
トーヨーカネツ	800	2,698.00	2,158,400	
栗田工業	10,900	5,950.00	64,855,000	
樫本チエイン	2,900	3,670.00	10,643,000	
大同工業	1,000	1,150.00	1,150,000	
木村化工機	1,700	796.00	1,353,200	
アネスト岩田	3,400	1,021.00	3,471,400	
ダイフク	11,100	11,360.00	126,096,000	
サムコ	500	3,055.00	1,527,500	
加藤製作所	1,100	920.00	1,012,000	
油研工業	300	1,785.00	535,500	
タダノ	9,700	1,239.00	12,018,300	
フジテック	6,900	2,934.00	20,244,600	
C K D	4,700	2,536.00	11,919,200	
キトー	1,700	1,883.00	3,201,100	
平和	5,600	2,057.00	11,519,200	
理想科学工業	1,500	2,521.00	3,781,500	
S A N K Y O	4,800	2,830.00	13,584,000	
日本金銭機械	2,200	598.00	1,315,600	
マースグループホールディングス	1,300	1,695.00	2,203,500	
フクシマガリレイ	1,400	5,160.00	7,224,000	
オーイズミ	800	392.00	313,600	
ダイコク電機	900	1,270.00	1,143,000	
竹内製作所	3,400	2,651.00	9,013,400	
アマノ	5,300	2,969.00	15,735,700	
J U K I	2,800	854.00	2,391,200	
サンデンホールディングス	2,800	318.00	890,400	

蛇の目マシン工業	1,800	756.00	1,360,800
マックス	2,700	1,997.00	5,391,900
グローリー	5,200	2,437.00	12,672,400
新晃工業	1,900	2,342.00	4,449,800
大和冷機工業	2,900	1,310.00	3,799,000
セガサミーホールディングス	18,300	1,592.00	29,133,600
日本ピストンリング	700	1,521.00	1,064,700
リケン	900	2,940.00	2,646,000
T P R	2,700	1,555.00	4,198,500
ツバキ・ナカシマ	4,400	1,600.00	7,040,000
ホシザキ	5,900	10,840.00	63,956,000
大豊工業	1,600	888.00	1,420,800
日本精工	41,300	777.00	32,090,100
N T N	46,500	259.00	12,043,500
ジェイテクト	19,300	992.00	19,145,600
不二越	1,700	4,745.00	8,066,500
日本トムソン	5,500	582.00	3,201,000
T H K	11,700	2,737.00	32,022,900
ユーシン精機	1,300	858.00	1,115,400
前澤給装工業	1,400	1,072.00	1,500,800
イーグル工業	2,500	1,306.00	3,265,000
前澤工業	1,200	817.00	980,400
日本ピラー工業	2,000	3,070.00	6,140,000
キッツ	6,800	867.00	5,895,600
マキタ	26,200	6,830.00	178,946,000
日立造船	15,900	1,002.00	15,931,800
三菱重工業	31,600	3,055.00	96,538,000
I H I	13,500	2,697.00	36,409,500
スター精密	3,100	1,584.00	4,910,400
日清紡ホールディングス	12,300	842.00	10,356,600
イビデン	9,700	6,780.00	65,766,000
コニカミノルタ	40,800	598.00	24,398,400
ブラザー工業	24,500	2,575.00	63,087,500
ミネベアミツミ	34,600	3,020.00	104,492,000
日立製作所	96,600	6,589.00	636,497,400
東芝	39,800	4,700.00	187,060,000

三菱電機	201,000	1,584.50	318,484,500
富士電機	12,100	5,250.00	63,525,000
東洋電機製造	800	1,116.00	892,800
安川電機	21,600	6,100.00	131,760,000
シンフォニアテクノロジー	2,600	1,261.00	3,278,600
明電舎	3,400	2,568.00	8,731,200
オリジン	500	1,313.00	656,500
山洋電気	1,000	7,680.00	7,680,000
デンヨー	1,700	2,274.00	3,865,800
東芝テック	2,200	4,860.00	10,692,000
芝浦メカトロニクス	400	7,750.00	3,100,000
マブチモーター	4,700	3,995.00	18,776,500
日本電産	48,400	13,865.00	671,066,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1,000	819.00	819,000
トレックス・セミコンダクター	1,100	2,823.00	3,105,300
東光高岳	1,000	1,526.00	1,526,000
ダブル・スコープ	5,800	990.00	5,742,000
宮越ホールディングス	700	1,636.00	1,145,200
ダイヘン	2,200	5,120.00	11,264,000
ヤーマン	3,300	1,422.00	4,692,600
JVCケンウッド	17,400	214.00	3,723,600
ミマキエンジニアリング	1,800	948.00	1,706,400
I - P E X	900	2,175.00	1,957,500
日新電機	4,700	1,456.00	6,843,200
大崎電気工業	4,000	573.00	2,292,000
オムロン	16,700	11,720.00	195,724,000
日東工業	3,000	1,806.00	5,418,000
I D E C	2,700	2,340.00	6,318,000
正興電機製作所	600	1,511.00	906,600
不二電機工業	300	1,279.00	383,700
ジーエス・ユアサ コーポレーション	7,200	2,651.00	19,087,200
サクサホールディングス	500	1,400.00	700,000
メルコホールディングス	700	5,270.00	3,689,000
テクノメディカ	500	1,716.00	858,000
ダイヤモンドエレクトリックホールディングス	600	2,552.00	1,531,200

日本電気	25,500	6,220.00	158,610,000	
富士通	18,100	21,855.00	395,575,500	
沖電気工業	8,200	991.00	8,126,200	
岩崎通信機	900	909.00	818,100	
電気興業	1,000	2,341.00	2,341,000	
サンケン電気	2,300	6,430.00	14,789,000	
ナカヨ	400	1,448.00	579,200	
アイホン	1,100	2,464.00	2,710,400	
ルネサスエレクトロニクス	108,600	1,420.00	154,212,000	
セイコーエプソン	24,900	2,321.00	57,792,900	
ワコム	14,600	758.00	11,066,800	
アルバック	3,700	6,660.00	24,642,000	
アクセル	800	787.00	629,600	
E I Z O	1,700	4,375.00	7,437,500	
ジャパンディスプレイ	68,500	38.00	2,603,000	
日本信号	4,700	981.00	4,610,700	
京三製作所	4,300	497.00	2,137,100	
能美防災	2,700	2,143.00	5,786,100	
ホーチキ	1,500	1,226.00	1,839,000	
星和電機	900	538.00	484,200	
エレコム	4,600	1,882.00	8,657,200	
パナソニック	214,400	1,442.00	309,164,800	
シャープ	26,700	1,452.00	38,768,400	
アンリツ	12,100	2,048.00	24,780,800	
富士通ゼネラル	6,100	2,966.00	18,092,600	
ソニーグループ	125,900	12,170.00	1,532,203,000	
T D K	9,700	12,910.00	125,227,000	
帝国通信工業	900	1,656.00	1,490,400	
タムラ製作所	7,200	764.00	5,500,800	
アルプスアルパイン	16,400	1,251.00	20,516,400	
池上通信機	600	860.00	516,000	
日本電波工業	1,900	945.00	1,795,500	
鈴木	900	904.00	813,600	
メイコー	1,500	3,200.00	4,800,000	
日本トリム	400	3,900.00	1,560,000	
ローランド ディー . ジー .	1,200	3,270.00	3,924,000	

フォスター電機	2,000	948.00	1,896,000	
S M K	500	2,459.00	1,229,500	
ヨコオ	1,600	2,659.00	4,254,400	
ティアック	1,300	122.00	158,600	
ホシデン	5,200	958.00	4,981,600	
ヒロセ電機	3,100	19,790.00	61,349,000	
日本航空電子工業	4,600	1,755.00	8,073,000	
T O A	2,400	865.00	2,076,000	
マクセルホールディングス	4,000	1,340.00	5,360,000	
古野電気	2,600	1,160.00	3,016,000	
ユニデンホールディングス	500	2,835.00	1,417,500	
スミダコーポレーション	1,900	1,347.00	2,559,300	
アイコム	800	2,472.00	1,977,600	
リオン	800	2,793.00	2,234,400	
本多通信工業	1,600	485.00	776,000	
横河電機	20,100	2,015.00	40,501,500	
新電元工業	800	4,375.00	3,500,000	
アズビル	13,600	5,240.00	71,264,000	
東亜ディーケーケー	1,000	987.00	987,000	
日本光電工業	8,300	3,970.00	32,951,000	
チノー	600	1,533.00	919,800	
共和電業	1,900	403.00	765,700	
日本電子材料	800	2,012.00	1,609,600	
堀場製作所	3,700	8,290.00	30,673,000	
アドバンテスト	14,900	11,450.00	170,605,000	
小野測器	800	563.00	450,400	
エスベック	1,800	2,409.00	4,336,200	
キーエンス	19,700	75,510.00	1,487,547,000	
日置電機	1,000	9,800.00	9,800,000	
シスメックス	15,700	14,205.00	223,018,500	
日本マイクロニクス	3,500	1,572.00	5,502,000	
メガチップス	2,000	3,620.00	7,240,000	
O B A R A G R O U P	900	4,155.00	3,739,500	
澤藤電機	200	2,134.00	426,800	
原田工業	800	970.00	776,000	
コーセル	2,500	1,137.00	2,842,500	

イリソ電子工業	1,700	5,060.00	8,602,000	
オブテックスグループ	3,300	1,612.00	5,319,600	
千代田インテグレ	800	2,129.00	1,703,200	
アイ・オー・データ機器	700	943.00	660,100	
レーザーテック	8,800	28,940.00	254,672,000	
スタンレー電気	14,100	2,974.00	41,933,400	
岩崎電気	700	2,059.00	1,441,300	
ウシオ電機	10,300	2,181.00	22,464,300	
岡谷電機産業	1,400	367.00	513,800	
ハリオス テクノ ホールディング	1,800	345.00	621,000	
エノモト	600	1,901.00	1,140,600	
日本セラミック	1,900	3,145.00	5,975,500	
遠藤照明	1,000	1,080.00	1,080,000	
古河電池	1,400	1,620.00	2,268,000	
双信電機	1,000	899.00	899,000	
山一電機	1,300	1,787.00	2,323,100	
図研	1,300	4,215.00	5,479,500	
日本電子	3,800	9,100.00	34,580,000	
カシオ計算機	16,200	1,869.00	30,277,800	
ファナック	17,600	26,880.00	473,088,000	
日本シイエムケイ	4,300	428.00	1,840,400	
エンプラス	900	3,430.00	3,087,000	
大真空	700	4,295.00	3,006,500	
ローム	8,400	11,490.00	96,516,000	
浜松ホトニクス	14,400	7,100.00	102,240,000	
三井ハイテック	2,000	8,580.00	17,160,000	
新光電気工業	6,700	4,130.00	27,671,000	
京セラ	30,600	7,284.00	222,890,400	
太陽誘電	8,900	7,600.00	67,640,000	
村田製作所	59,000	10,235.00	603,865,000	
双葉電子工業	3,400	827.00	2,811,800	
北陸電気工業	800	1,071.00	856,800	
ニチコン	6,300	1,144.00	7,207,200	
日本ケミコン	2,000	2,303.00	4,606,000	
K O A	2,800	1,873.00	5,244,400	
市光工業	2,400	654.00	1,569,600	

小糸製作所	12,000	7,090.00	85,080,000
ミツバ	3,700	690.00	2,553,000
S C R E E Nホールディングス	3,500	10,770.00	37,695,000
キャノン電子	1,800	1,677.00	3,018,600
キャノン	99,900	2,710.00	270,729,000
リコー	51,100	1,116.00	57,027,600
象印マホービン	5,400	1,884.00	10,173,600
M U T O Hホールディングス	300	1,640.00	492,000
東京エレクトロン	11,800	56,470.00	666,346,000
トヨタ紡織	5,900	2,045.00	12,065,500
芦森工業	400	1,083.00	433,200
ユニプレス	3,300	935.00	3,085,500
豊田自動織機	16,300	9,790.00	159,577,000
モリタホールディングス	3,200	1,644.00	5,260,800
三櫻工業	2,800	1,116.00	3,124,800
デンソー	44,300	7,869.00	348,596,700
東海理化電機製作所	5,300	1,663.00	8,813,900
三井E & Sホールディングス	7,800	509.00	3,970,200
川崎重工業	15,700	2,558.00	40,160,600
名村造船所	6,000	259.00	1,554,000
サノヤスホールディングス	2,500	145.00	362,500
日本車輛製造	700	2,158.00	1,510,600
三菱ロジスネクスト	2,700	1,134.00	3,061,800
近畿車輛	300	1,167.00	350,100
日産自動車	237,100	572.40	135,716,040
いすゞ自動車	53,400	1,461.00	78,017,400
トヨタ自動車	203,600	9,876.00	2,010,753,600
日野自動車	25,100	1,014.00	25,451,400
三菱自動車工業	74,400	285.00	21,204,000
エフテック	1,400	656.00	918,400
レシップホールディングス	800	603.00	482,400
G M B	400	920.00	368,000
ファルテック	400	757.00	302,800
武蔵精密工業	4,500	2,023.00	9,103,500
日産車体	2,900	778.00	2,256,200
新明和工業	5,700	965.00	5,500,500

極東開発工業	3,500	1,739.00	6,086,500
トピー工業	1,700	1,266.00	2,152,200
ティラド	600	3,390.00	2,034,000
曙ブレーキ工業	11,000	197.00	2,167,000
タチエス	3,100	1,360.00	4,216,000
N O K	9,700	1,383.00	13,415,100
フタバ産業	5,000	490.00	2,450,000
K Y B	2,200	3,140.00	6,908,000
大同メタル工業	4,200	623.00	2,616,600
プレス工業	10,000	352.00	3,520,000
ミクニ	2,500	332.00	830,000
太平洋工業	4,200	1,261.00	5,296,200
河西工業	2,700	399.00	1,077,300
アイシン	14,700	4,270.00	62,769,000
マツダ	63,100	960.00	60,576,000
今仙電機製作所	1,800	726.00	1,306,800
本田技研工業	158,300	3,382.00	535,370,600
スズキ	39,800	5,097.00	202,860,600
S U B A R U	57,600	2,093.00	120,556,800
安永	1,000	1,245.00	1,245,000
ヤマハ発動機	26,200	3,175.00	83,185,000
T B K	2,400	421.00	1,010,400
エクセディ	2,700	1,764.00	4,762,800
豊田合成	6,500	2,342.00	15,223,000
愛三工業	3,100	868.00	2,690,800
盟和産業	300	1,055.00	316,500
日本プラスト	1,700	686.00	1,166,200
ヨロズ	1,700	1,285.00	2,184,500
エフ・シー・シー	3,300	1,596.00	5,266,800
シマノ	8,100	34,790.00	281,799,000
テイ・エス テック	9,300	1,504.00	13,987,200
ジャムコ	1,200	1,020.00	1,224,000
テルモ	61,600	5,331.00	328,389,600
クリエートメディック	600	999.00	599,400
日機装	6,000	975.00	5,850,000
日本エム・ディ・エム	1,200	2,333.00	2,799,600

島津製作所	25,900	5,420.00	140,378,000
JMS	1,700	863.00	1,467,100
クボテック	500	316.00	158,000
長野計器	1,500	1,197.00	1,795,500
ブイ・テクノロジー	900	4,870.00	4,383,000
東京計器	1,300	1,069.00	1,389,700
愛知時計電機	300	4,825.00	1,447,500
インターアクション	1,000	2,891.00	2,891,000
オーバル	1,800	279.00	502,200
東京精密	3,400	5,120.00	17,408,000
マニー	8,000	2,273.00	18,184,000
ニコン	30,700	1,355.00	41,598,500
トプコン	10,100	2,020.00	20,402,000
オリンパス	105,400	2,395.50	252,485,700
理研計器	1,800	3,135.00	5,643,000
タムロン	1,600	2,791.00	4,465,600
HOYA	39,200	18,815.00	737,548,000
シード	800	714.00	571,200
ノーリツ鋼機	1,800	2,698.00	4,856,400
エー・アンド・デイ	1,700	1,112.00	1,890,400
朝日インテック	22,000	3,290.00	72,380,000
シチズン時計	25,500	542.00	13,821,000
リズム	600	1,547.00	928,200
大研医器	1,600	616.00	985,600
メニコン	3,100	9,440.00	29,264,000
シンシア	200	711.00	142,200
松風	900	2,198.00	1,978,200
セイコーホールディングス	2,800	2,249.00	6,297,200
ニプロ	15,000	1,202.00	18,030,000
中本パックス	500	1,929.00	964,500
スノーピーク	1,300	6,070.00	7,891,000
パラマウントベッドホールディングス	3,900	2,267.00	8,841,300
トランザクション	1,100	1,236.00	1,359,600
粧美堂	600	428.00	256,800
ニホンフラッシュ	1,700	1,279.00	2,174,300
前田工織	2,200	3,540.00	7,788,000

永大産業	2,600	314.00	816,400
アートネイチャー	1,900	743.00	1,411,700
バンダイナムコホールディングス	16,600	8,740.00	145,084,000
アイフィスジャパン	500	737.00	368,500
共立印刷	3,400	179.00	608,600
S H O E I	1,900	5,350.00	10,165,000
フランスベッドホールディングス	2,600	966.00	2,511,600
パイロットコーポレーション	3,400	4,415.00	15,011,000
萩原工業	1,300	1,585.00	2,060,500
トッパン・フォームズ	3,600	1,044.00	3,758,400
フジシールインターナショナル	4,100	2,659.00	10,901,900
タカラトミー	9,000	1,167.00	10,503,000
廣済堂	1,400	1,496.00	2,094,400
エステールホールディングス	500	660.00	330,000
タカノ	700	829.00	580,300
プロネクサス	1,600	1,131.00	1,809,600
ホクシン	1,300	170.00	221,000
ウッドワン	700	1,182.00	827,400
大建工業	1,400	2,471.00	3,459,400
凸版印刷	30,600	2,042.00	62,485,200
大日本印刷	23,800	2,810.00	66,878,000
共同印刷	600	2,765.00	1,659,000
N I S S H A	4,100	1,906.00	7,814,600
光村印刷	200	1,700.00	340,000
T A K A R A & C O M P A N Y	1,000	1,823.00	1,823,000
アシックス	17,800	2,754.00	49,021,200
ツツミ	500	2,368.00	1,184,000
ローランド	1,400	5,570.00	7,798,000
小松ウオール工業	600	2,020.00	1,212,000
ヤマハ	12,000	7,350.00	88,200,000
河合楽器製作所	600	4,030.00	2,418,000
クリナップ	1,900	590.00	1,121,000
ビジョン	12,100	3,000.00	36,300,000
兼松サステック	100	1,819.00	181,900
キングジム	1,600	904.00	1,446,400
リンテック	4,300	2,706.00	11,635,800

イトーキ	3,700	381.00	1,409,700	
任天堂	11,500	53,890.00	619,735,000	
三菱鉛筆	3,300	1,538.00	5,075,400	
タカラスタANDARD	4,200	1,692.00	7,106,400	
コクヨ	9,600	1,996.00	19,161,600	
ナカバヤシ	2,000	613.00	1,226,000	
グローブライド	1,000	9,300.00	9,300,000	
オカムラ	6,900	1,741.00	12,012,900	
美津濃	2,000	2,709.00	5,418,000	
東京電力ホールディングス	170,500	301.00	51,320,500	
中部電力	61,500	1,347.00	82,840,500	
関西電力	76,200	1,115.00	84,963,000	
中国電力	29,000	1,046.00	30,334,000	
北陸電力	18,400	595.00	10,948,000	
東北電力	47,100	855.00	40,270,500	
四国電力	16,700	801.00	13,376,700	
九州電力	44,400	859.00	38,139,600	
北海道電力	18,800	528.00	9,926,400	
沖縄電力	3,900	1,472.00	5,740,800	
電源開発	16,000	1,666.00	26,656,000	
エフオン	1,200	987.00	1,184,400	
イーレックス	3,000	2,999.00	8,997,000	
レノバ	3,400	5,970.00	20,298,000	
東京瓦斯	38,700	2,158.00	83,514,600	
大阪瓦斯	36,400	2,140.00	77,896,000	
東邦瓦斯	9,900	5,290.00	52,371,000	
北海道瓦斯	1,100	1,616.00	1,777,600	
広島ガス	4,100	407.00	1,668,700	
西部ガスホールディングス	2,300	2,510.00	5,773,000	
静岡ガス	5,200	1,326.00	6,895,200	
メタウォーター	2,300	1,986.00	4,567,800	
SBSホールディングス	1,500	4,195.00	6,292,500	
東武鉄道	20,900	2,873.00	60,045,700	
相鉄ホールディングス	6,900	2,148.00	14,821,200	
東急	50,700	1,529.00	77,520,300	
京浜急行電鉄	25,800	1,290.00	33,282,000	

小田急電鉄	32,200	2,485.00	80,017,000	
京王電鉄	11,200	5,780.00	64,736,000	
京成電鉄	15,100	3,465.00	52,321,500	
富士急行	2,700	4,460.00	12,042,000	
新京成電鉄	500	2,165.00	1,082,500	
東日本旅客鉄道	35,400	6,876.00	243,410,400	
西日本旅客鉄道	17,900	5,045.00	90,305,500	
東海旅客鉄道	16,700	15,695.00	262,106,500	
西武ホールディングス	24,200	1,305.00	31,581,000	
鴻池運輸	3,200	1,432.00	4,582,400	
西日本鉄道	5,600	2,764.00	15,478,400	
ハマキョウレックス	1,500	3,485.00	5,227,500	
サカイ引越センター	900	4,990.00	4,491,000	
近鉄グループホールディングス	19,000	3,575.00	67,925,000	
阪急阪神ホールディングス	25,400	3,415.00	86,741,000	
南海電気鉄道	9,000	2,328.00	20,952,000	
京阪ホールディングス	8,500	3,050.00	25,925,000	
神戸電鉄	500	3,630.00	1,815,000	
名古屋鉄道	15,700	1,955.00	30,693,500	
山陽電気鉄道	1,400	2,078.00	2,909,200	
アルプス物流	1,300	1,052.00	1,367,600	
日本通運	6,600	8,060.00	53,196,000	
ヤマトホールディングス	26,700	2,947.00	78,684,900	
山九	4,900	5,410.00	26,509,000	
丸運	1,100	281.00	309,100	
丸全昭和運輸	1,500	3,730.00	5,595,000	
センコーグループホールディングス	10,500	1,043.00	10,951,500	
トナミホールディングス	500	5,120.00	2,560,000	
ニッコンホールディングス	6,400	2,439.00	15,609,600	
日本石油輸送	200	2,720.00	544,000	
福山通運	2,400	4,905.00	11,772,000	
セイノーホールディングス	14,300	1,395.00	19,948,500	
エスライン	500	953.00	476,500	
神奈川中央交通	500	3,635.00	1,817,500	
日立物流	3,900	4,750.00	18,525,000	
丸和運輸機関	4,000	1,690.00	6,760,000	

C & F ロジホールディングス	1,900	1,926.00	3,659,400	
九州旅客鉄道	14,700	2,453.00	36,059,100	
S Gホールディングス	36,000	3,275.00	117,900,000	
日本郵船	15,900	10,350.00	164,565,000	
商船三井	11,300	9,400.00	106,220,000	
川崎汽船	5,900	7,210.00	42,539,000	
N S ユナイテッド海運	900	4,770.00	4,293,000	
明治海運	2,000	810.00	1,620,000	
飯野海運	8,800	565.00	4,972,000	
共栄タンカー	300	1,010.00	303,000	
乾汽船	1,300	2,500.00	3,250,000	
日本航空	46,400	2,403.00	111,499,200	
A N A ホールディングス	51,400	2,612.00	134,256,800	
パスコ	400	1,479.00	591,600	
トランコム	600	8,990.00	5,394,000	
日新	1,500	1,723.00	2,584,500	
三菱倉庫	6,600	3,305.00	21,813,000	
三井倉庫ホールディングス	2,000	2,763.00	5,526,000	
住友倉庫	6,700	1,965.00	13,165,500	
澁澤倉庫	1,000	2,496.00	2,496,000	
東陽倉庫	3,200	355.00	1,136,000	
日本トランスシティ	4,200	679.00	2,851,800	
ケイヒン	400	1,448.00	579,200	
中央倉庫	1,200	1,055.00	1,266,000	
川西倉庫	300	1,470.00	441,000	
安田倉庫	1,600	1,020.00	1,632,000	
ファイズホールディングス	300	782.00	234,600	
東洋埠頭	600	1,570.00	942,000	
宇徳	1,400	577.00	807,800	
上組	10,500	2,444.00	25,662,000	
サンリツ	500	819.00	409,500	
キムラユニティー	500	1,546.00	773,000	
キューソー流通システム	500	1,860.00	930,000	
近鉄エクスプレス	3,600	3,015.00	10,854,000	
東海運	1,100	345.00	379,500	
エーアイティー	1,200	1,180.00	1,416,000	

内外トランスライン	700	2,490.00	1,743,000	
日本コンセプト	600	2,081.00	1,248,600	
NEC ネットズエスアイ	6,500	2,277.00	14,800,500	
クロスキャット	500	1,127.00	563,500	
システナ	7,000	2,428.00	16,996,000	
デジタルアーツ	1,100	9,220.00	10,142,000	
日鉄ソリューションズ	2,900	4,025.00	11,672,500	
キューブシステム	1,000	1,147.00	1,147,000	
WOW WORLD	300	1,885.00	565,500	
コア	800	1,574.00	1,259,200	
ラクーンホールディングス	1,400	1,618.00	2,265,200	
ソリトンシステムズ	1,000	1,586.00	1,586,000	
ソフトクリエイティブホールディングス	800	3,505.00	2,804,000	
T I S	19,700	3,210.00	63,237,000	
J N S ホールディングス	1,000	539.00	539,000	
グリー	12,100	677.00	8,191,700	
G M O ペパボ	200	3,390.00	678,000	
コーエーテクモホールディングス	5,200	5,890.00	30,628,000	
三菱総合研究所	800	4,550.00	3,640,000	
ボルテージ	500	459.00	229,500	
電算	200	2,485.00	497,000	
A G S	1,000	957.00	957,000	
ファインデックス	1,700	1,109.00	1,885,300	
ブレインパッド	500	6,240.00	3,120,000	
K L a b	3,600	636.00	2,289,600	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	2,600	1,054.00	2,740,400	
イーブックイニシアティブジャパン	300	4,020.00	1,206,000	
ネクソン	44,400	1,965.00	87,246,000	
アイスタイル	6,000	453.00	2,718,000	
エムアップホールディングス	500	3,320.00	1,660,000	
エイチーム	1,400	1,575.00	2,205,000	
エニグモ	1,900	1,334.00	2,534,600	
テクノスジャパン	1,500	636.00	954,000	
e n i s h	1,200	477.00	572,400	
コロプラ	6,500	856.00	5,564,000	

オルトプラス	1,500	447.00	670,500
ブロードリーフ	9,800	547.00	5,360,600
クロス・マーケティンググループ	700	915.00	640,500
デジタルハーツホールディングス	900	2,261.00	2,034,900
システム情報	1,500	1,071.00	1,606,500
メディアドゥ	800	5,430.00	4,344,000
じげん	4,900	434.00	2,126,600
ブイキューブ	2,000	1,719.00	3,438,000
エンカレッジ・テクノロジー	300	624.00	187,200
サイバーリンクス	700	1,551.00	1,085,700
ディー・エル・イー	1,600	314.00	502,400
フィックスターズ	2,100	816.00	1,713,600
CARTA HOLDINGS	800	2,600.00	2,080,000
オブティム	1,400	2,013.00	2,818,200
セレス	700	2,976.00	2,083,200
SHIFT	1,000	28,010.00	28,010,000
ティーガイア	2,100	2,047.00	4,298,700
セック	300	2,540.00	762,000
テクマトリックス	3,100	2,059.00	6,382,900
プロシップ	600	1,668.00	1,000,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	5,300	2,251.00	11,930,300
GMOペイメントゲートウェイ	3,800	15,950.00	60,610,000
ザッパラス	800	552.00	441,600
システムリサーチ	600	2,151.00	1,290,600
インターネットイニシアティブ	5,300	4,110.00	21,783,000
さくらインターネット	2,100	649.00	1,362,900
ヴィンクス	600	1,001.00	600,600
GMOグローバルサイン・ホールディングス	400	5,110.00	2,044,000
SRAホールディングス	1,000	2,976.00	2,976,000
システムインテグレータ	600	643.00	385,800
朝日ネット	1,600	785.00	1,256,000
eBASE	2,400	846.00	2,030,400
アバント	2,100	1,653.00	3,471,300
アドソル日進	700	2,336.00	1,635,200
ODKソリューションズ	400	785.00	314,000
フリービット	1,200	1,084.00	1,300,800

コムチュア	1,800	3,240.00	5,832,000	
サイバーコム	300	1,361.00	408,300	
アステリア	1,400	725.00	1,015,000	
アイル	1,100	1,979.00	2,176,900	
マークラインズ	1,000	3,175.00	3,175,000	
メディカル・データ・ビジョン	2,500	1,678.00	4,195,000	
g u m i	2,700	884.00	2,386,800	
ショーケース	400	680.00	272,000	
モバイルファクトリー	400	1,073.00	429,200	
テラスカイ	600	2,242.00	1,345,200	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	900	2,189.00	1,970,100	
P C Iホールディングス	900	1,148.00	1,033,200	
パイプドHD	400	2,634.00	1,053,600	
アイビーシー	300	886.00	265,800	
ネオジャパン	400	1,700.00	680,000	
P R T I M E S	400	3,190.00	1,276,000	
ラクス	5,900	4,685.00	27,641,500	
ランドコンピュータ	300	1,315.00	394,500	
ダブルスタンダード	300	7,880.00	2,364,000	
オーブンドア	1,200	2,264.00	2,716,800	
マイネット	700	675.00	472,500	
アカツキ	800	3,275.00	2,620,000	
ベネフィットジャパン	100	2,443.00	244,300	
U b i c o mホールディングス	500	3,050.00	1,525,000	
カナミックネットワーク	2,100	648.00	1,360,800	
ノムラシステムコーポレーション	1,000	304.00	304,000	
チェンジ	3,600	2,373.00	8,542,800	
シンクロ・フード	1,200	427.00	512,400	
オークネット	1,000	2,223.00	2,223,000	
キャピタル・アセット・プランニング	400	1,083.00	433,200	
セグエグループ	500	843.00	421,500	
エイトレッド	400	2,548.00	1,019,200	
マクロミル	4,000	817.00	3,268,000	
ビーグリー	500	1,443.00	721,500	
オロ	600	3,780.00	2,268,000	

ユーザーローカル	600	2,137.00	1,282,200	
テモナ	400	841.00	336,400	
ニーズウェル	400	750.00	300,000	
マネーフォワード	3,000	8,970.00	26,910,000	
サインポスト	500	1,570.00	785,000	
電算システムホールディングス	800	2,930.00	2,344,000	
ソルクシーズ	800	1,142.00	913,600	
フェイス	600	719.00	431,400	
プロトコーポレーション	2,400	1,667.00	4,000,800	
ハイマックス	600	1,113.00	667,800	
野村総合研究所	34,300	4,450.00	152,635,000	
サイバネットシステム	1,400	700.00	980,000	
C Eホールディングス	1,000	605.00	605,000	
日本システム技術	400	1,847.00	738,800	
インテージホールディングス	2,500	1,655.00	4,137,500	
東邦システムサイエンス	500	1,021.00	510,500	
ソースネクスト	9,300	246.00	2,287,800	
インフォコム	1,800	2,611.00	4,699,800	
HEROZ	600	2,011.00	1,206,600	
ラクスル	2,200	6,640.00	14,608,000	
I P S	500	2,208.00	1,104,000	
F I G	2,100	294.00	617,400	
システムサポート	600	1,367.00	820,200	
イーソル	1,200	1,142.00	1,370,400	
アルテリア・ネットワークス	2,200	1,750.00	3,850,000	
E d u L a b	200	2,800.00	560,000	
東海ソフト	300	1,401.00	420,300	
ウイングアーク1 s t	1,100	2,390.00	2,629,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	400	1,977.00	790,800	
サーバーワークス	200	4,130.00	826,000	
東名	200	1,195.00	239,000	
ヴィッツ	200	1,787.00	357,400	
トピラシステムズ	400	1,387.00	554,800	
S a n s a n	1,800	12,800.00	23,040,000	
L i n k - U	400	1,314.00	525,600	

ギフトィ	1,700	3,765.00	6,400,500
ベース	300	5,130.00	1,539,000
フォーカスシステムズ	1,300	1,059.00	1,376,700
クレスコ	1,300	2,052.00	2,667,600
フジ・メディア・ホールディングス	20,500	1,193.00	24,456,500
オービック	6,200	23,640.00	146,568,000
ジャストシステム	2,800	7,180.00	20,104,000
TDCソフト	1,700	1,458.00	2,478,600
Zホールディングス	271,000	739.50	200,404,500
トレンドマイクロ	10,500	6,430.00	67,515,000
IDホールディングス	1,100	975.00	1,072,500
日本オラクル	4,000	9,690.00	38,760,000
アルファシステムズ	500	4,150.00	2,075,000
フューチャー	2,100	2,830.00	5,943,000
CAC Holdings	1,200	1,799.00	2,158,800
S Bテクノロジー	700	3,120.00	2,184,000
トーセ	500	794.00	397,000
オービックビジネスコンサルタント	1,900	5,820.00	11,058,000
伊藤忠テクノソリューションズ	9,000	3,830.00	34,470,000
アイティフォー	2,600	879.00	2,285,400
東計電算	200	4,870.00	974,000
エクスネット	300	1,078.00	323,400
大塚商会	10,700	6,190.00	66,233,000
サイボウズ	2,600	2,554.00	6,640,400
電通国際情報サービス	2,800	4,690.00	13,132,000
ACCESS	2,500	1,098.00	2,745,000
デジタルガレージ	3,300	5,290.00	17,457,000
EMシステムズ	3,300	850.00	2,805,000
ウェザーニューズ	600	6,680.00	4,008,000
CIJ	1,300	884.00	1,149,200
ビジネスエンジニアリング	200	3,715.00	743,000
日本エンタープライズ	2,000	218.00	436,000
WOWOW	900	2,513.00	2,261,700
スカラ	1,800	778.00	1,400,400
インテリジェント ウェイブ	1,200	640.00	768,000
IMAGICA GROUP	1,700	562.00	955,400

ネットワンシステムズ	8,100	4,010.00	32,481,000	
システムソフト	4,100	181.00	742,100	
アルゴグラフィックス	1,500	3,510.00	5,265,000	
マーベラス	3,100	711.00	2,204,100	
エイベックス	3,400	1,507.00	5,123,800	
日本ユニシス	6,800	3,085.00	20,978,000	
兼松エレクトロニクス	1,100	4,020.00	4,422,000	
都築電気	900	1,890.00	1,701,000	
TBSホールディングス	13,100	1,716.00	22,479,600	
日本テレビホールディングス	16,500	1,241.00	20,476,500	
朝日放送グループホールディングス	2,000	753.00	1,506,000	
テレビ朝日ホールディングス	6,100	1,745.00	10,644,500	
スカパーJSATホールディングス	13,000	437.00	5,681,000	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,183.00	3,056,200	
日本BS放送	700	1,150.00	805,000	
ビジョン	3,400	1,419.00	4,824,600	
スマートバリュー	500	701.00	350,500	
USEN-NEXT HOLDINGS	1,900	3,795.00	7,210,500	
ワイヤレスゲート	800	418.00	334,400	
コネクシオ	1,100	1,613.00	1,774,300	
日本通信	17,400	243.00	4,228,200	
クロップス	400	996.00	398,400	
日本電信電話	230,700	3,237.00	746,775,900	
KDDI	158,200	3,897.00	616,505,400	
ソフトバンク	179,200	1,582.00	283,494,400	
光通信	2,300	20,610.00	47,403,000	
エムティーアイ	1,900	743.00	1,411,700	
GMOインターネット	7,000	3,120.00	21,840,000	
ファイバーゲート	600	1,524.00	914,400	
アйдママーケティングコミュニケーション	500	397.00	198,500	
KADOKAWA	5,100	5,620.00	28,662,000	
学研ホールディングス	2,800	1,237.00	3,463,600	
ゼンリン	3,600	1,104.00	3,974,400	
昭文社ホールディングス	800	523.00	418,400	
インプレスホールディングス	1,600	282.00	451,200	
アイネット	1,000	1,440.00	1,440,000	

松竹	1,300	12,770.00	16,601,000	
東宝	11,600	5,260.00	61,016,000	
東映	600	21,850.00	13,110,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	52,500	2,225.00	116,812,500	
ピー・シー・エー	300	5,940.00	1,782,000	
ビジネスブレイン太田昭和	700	1,737.00	1,215,900	
D T S	4,100	2,727.00	11,180,700	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	8,400	6,680.00	56,112,000	
シーイーシー	2,100	1,405.00	2,950,500	
カプコン	16,900	3,460.00	58,474,000	
アイ・エス・ピー	900	1,319.00	1,187,100	
ジャステック	1,100	1,274.00	1,401,400	
S C S K	4,600	7,720.00	35,512,000	
日本システムウエア	700	2,519.00	1,763,300	
アイネス	1,900	1,619.00	3,076,100	
T K C	3,300	3,790.00	12,507,000	
富士ソフト	2,100	5,790.00	12,159,000	
N S D	6,300	2,138.00	13,469,400	
コナミホールディングス	7,200	6,990.00	50,328,000	
福井コンピュータホールディングス	900	4,445.00	4,000,500	
J B C Cホールディングス	1,300	1,681.00	2,185,300	
ミロク情報サービス	2,000	1,682.00	3,364,000	
ソフトバンクグループ	156,500	6,634.00	1,038,221,000	
ハウスイ	200	970.00	194,000	
高千穂交易	800	1,249.00	999,200	
オルパヘルスケアホールディングス	300	1,615.00	484,500	
伊藤忠食品	500	5,410.00	2,705,000	
エレマテック	1,600	1,220.00	1,952,000	
J A L U X	600	1,793.00	1,075,800	
あらた	1,600	4,560.00	7,296,000	
トーメンデバイス	300	5,540.00	1,662,000	
東京エレクトロン デバイス	700	8,580.00	6,006,000	
フィールズ	1,700	541.00	919,700	
双日	109,300	360.00	39,348,000	
アルフレッサ ホールディングス	20,500	1,744.00	35,752,000	
横浜冷凍	5,500	921.00	5,065,500	

神栄	300	1,094.00	328,200
ラサ商事	1,000	959.00	959,000
アルコニックス	2,100	1,788.00	3,754,800
神戸物産	15,400	4,135.00	63,679,000
ハイパー	500	554.00	277,000
あい ホールディングス	2,800	2,452.00	6,865,600
ディーブイエックス	600	1,149.00	689,400
ダイワボウホールディングス	9,000	2,100.00	18,900,000
マクニカ・富士エレホールディングス	4,700	2,899.00	13,625,300
ラクト・ジャパン	700	2,899.00	2,029,300
グリムス	600	3,155.00	1,893,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,400	833.00	2,832,200
八洲電機	1,500	1,085.00	1,627,500
メディアスホールディングス	1,100	946.00	1,040,600
レスターホールディングス	2,100	1,991.00	4,181,100
ジューテックホールディングス	500	1,107.00	553,500
大光	800	705.00	564,000
OCHIホールディングス	600	1,304.00	782,400
TOKAIホールディングス	9,600	921.00	8,841,600
黒谷	500	869.00	434,500
C o m i n i x	300	737.00	221,100
三洋貿易	2,000	1,246.00	2,492,000
ビューティガレージ	300	3,810.00	1,143,000
ウイン・パートナーズ	1,400	997.00	1,395,800
ミタチ産業	500	843.00	421,500
シップヘルスケアホールディングス	7,000	2,975.00	20,825,000
明治電機工業	700	1,386.00	970,200
デリカフーズホールディングス	800	677.00	541,600
スターティアホールディングス	400	1,899.00	759,600
コメダホールディングス	4,300	2,144.00	9,219,200
ピーバンドットコム	300	746.00	223,800
アセンテック	500	1,222.00	611,000
富士興産	600	1,055.00	633,000
協栄産業	200	1,485.00	297,000
小野建	1,800	1,774.00	3,193,200
南陽	400	2,034.00	813,600

佐島電機	1,200	931.00	1,117,200
エコートレーディング	400	674.00	269,600
伯東	1,200	1,985.00	2,382,000
コンドーテック	1,500	1,051.00	1,576,500
中山福	1,100	424.00	466,400
ナガイレーベン	2,600	2,750.00	7,150,000
三菱食品	2,200	3,010.00	6,622,000
松田産業	1,400	3,145.00	4,403,000
第一興商	3,800	3,835.00	14,573,000
メディパルホールディングス	19,800	2,208.00	43,718,400
S P K	800	1,421.00	1,136,800
萩原電気ホールディングス	700	2,352.00	1,646,400
アズワン	1,400	17,780.00	24,892,000
スズデン	700	1,634.00	1,143,800
尾家産業	600	1,144.00	686,400
シモジマ	1,200	1,282.00	1,538,400
ドウシシャ	1,900	1,812.00	3,442,800
小津産業	400	1,998.00	799,200
高速	1,000	1,640.00	1,640,000
たけびし	700	1,713.00	1,199,100
リックス	400	1,531.00	612,400
丸文	1,800	798.00	1,436,400
ハピネット	1,700	1,519.00	2,582,300
橋本総業ホールディングス	400	2,308.00	923,200
日本ライフライン	6,400	1,391.00	8,902,400
タカショー	1,300	974.00	1,266,200
マルカ	700	3,025.00	2,117,500
I D O M	6,700	1,016.00	6,807,200
進和	1,200	2,435.00	2,922,000
エスケイジャパン	500	508.00	254,000
ダイトロン	800	2,452.00	1,961,600
シークス	2,800	1,256.00	3,516,800
田中商事	600	670.00	402,000
オーハシテクニカ	1,000	1,575.00	1,575,000
白銅	700	3,575.00	2,502,500
ダイコー通産	200	1,277.00	255,400

伊藤忠商事	138,500	3,560.00	493,060,000
丸紅	195,200	959.60	187,313,920
高島	300	1,880.00	564,000
長瀬産業	10,900	1,971.00	21,483,900
蝶理	1,300	1,989.00	2,585,700
豊田通商	19,900	4,900.00	97,510,000
三共生興	3,000	550.00	1,650,000
兼松	7,900	1,470.00	11,613,000
ツカモトコーポレーション	300	1,436.00	430,800
三井物産	157,900	2,557.00	403,750,300
日本紙パルプ商事	1,000	3,930.00	3,930,000
カメイ	2,600	1,246.00	3,239,600
東都水産	200	7,110.00	1,422,000
OUGホールディングス	300	2,856.00	856,800
スターゼン	1,500	2,309.00	3,463,500
山善	7,700	1,145.00	8,816,500
椿本興業	400	3,940.00	1,576,000
住友商事	124,900	1,623.50	202,775,150
内田洋行	800	5,630.00	4,504,000
三菱商事	120,500	3,595.00	433,197,500
第一実業	900	4,975.00	4,477,500
キヤノンマーケティングジャパン	4,900	2,592.00	12,700,800
西華産業	1,000	1,715.00	1,715,000
佐藤商事	1,600	1,201.00	1,921,600
菱洋エレクトロ	1,500	2,439.00	3,658,500
東京産業	1,800	770.00	1,386,000
ユアサ商事	2,000	3,150.00	6,300,000
神鋼商事	400	3,470.00	1,388,000
トルク	1,000	238.00	238,000
阪和興業	4,000	3,720.00	14,880,000
正栄食品工業	1,300	4,360.00	5,668,000
カナデン	1,600	1,072.00	1,715,200
菱電商事	1,400	1,877.00	2,627,800
フルサト工業	1,000	2,339.00	2,339,000
岩谷産業	4,800	6,660.00	31,968,000
ナイス	800	1,979.00	1,583,200

ニチモウ	300	2,105.00	631,500	
極東貿易	600	2,777.00	1,666,200	
アステナホールディングス	2,800	651.00	1,822,800	
三愛石油	4,900	1,529.00	7,492,100	
稲畑産業	4,800	1,825.00	8,760,000	
G S I クレオス	1,000	1,070.00	1,070,000	
明和産業	1,800	1,165.00	2,097,000	
クワザワホールディングス	700	653.00	457,100	
ヤマエ久野	1,400	1,237.00	1,731,800	
ワキタ	3,900	1,069.00	4,169,100	
東邦ホールディングス	6,300	1,892.00	11,919,600	
サンゲツ	5,300	1,655.00	8,771,500	
ミツウロコグループホールディングス	2,900	1,422.00	4,123,800	
シナネンホールディングス	700	3,755.00	2,628,500	
伊藤忠エネクス	4,400	1,050.00	4,620,000	
サンリオ	5,600	2,462.00	13,787,200	
サンワテクノス	1,300	1,533.00	1,992,900	
リョーサン	2,200	2,314.00	5,090,800	
新光商事	2,700	905.00	2,443,500	
トーホー	900	1,714.00	1,542,600	
三信電気	1,100	1,743.00	1,917,300	
東陽テクニカ	2,000	1,295.00	2,590,000	
モスフードサービス	2,800	3,315.00	9,282,000	
加賀電子	1,800	3,295.00	5,931,000	
ソーダニッカ	1,900	624.00	1,185,600	
立花エレテック	1,500	1,588.00	2,382,000	
フォーバル	700	1,127.00	788,900	
P A L T A C	3,200	4,965.00	15,888,000	
三谷産業	2,600	391.00	1,016,600	
太平洋興発	800	677.00	541,600	
西本W i s m e t t a cホールディングス	400	3,665.00	1,466,000	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	200	1,889.00	377,800	
コア商事ホールディングス	1,500	705.00	1,057,500	
国際紙バルブ商事	4,200	364.00	1,528,800	
ヤマタネ	800	1,662.00	1,329,600	
丸紅建材リース	200	1,898.00	379,600	

日鉄物産	1,400	5,480.00	7,672,000	
泉州電業	600	5,070.00	3,042,000	
トラスコ中山	4,100	3,070.00	12,587,000	
オートバックスセブン	7,200	1,549.00	11,152,800	
モリト	1,400	704.00	985,600	
加藤産業	2,900	3,490.00	10,121,000	
北恵	500	1,047.00	523,500	
イノテック	1,100	1,491.00	1,640,100	
イエローハット	3,700	1,991.00	7,366,700	
J Kホールディングス	1,800	845.00	1,521,000	
日伝	1,600	2,558.00	4,092,800	
北沢産業	1,300	264.00	343,200	
杉本商事	1,000	2,915.00	2,915,000	
因幡電機産業	5,300	2,868.00	15,200,400	
東テク	700	2,855.00	1,998,500	
ミスミグループ本社	24,800	4,855.00	120,404,000	
アルテック	1,300	333.00	432,900	
タキヒヨー	700	1,882.00	1,317,400	
蔵王産業	400	1,739.00	695,600	
スズケン	8,400	3,275.00	27,510,000	
ジェコス	1,400	915.00	1,281,000	
グローセル	2,100	434.00	911,400	
ローソン	5,000	5,790.00	28,950,000	
サンエー	1,500	4,130.00	6,195,000	
カワチ薬品	1,400	2,343.00	3,280,200	
エービーシー・マート	3,100	5,850.00	18,135,000	
ハードオフコーポレーション	900	790.00	711,000	
アスクル	3,200	1,757.00	5,622,400	
ゲオホールディングス	2,600	1,237.00	3,216,200	
アダストリア	2,700	1,964.00	5,302,800	
ジーフット	1,200	411.00	493,200	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	300	422.00	126,600	
くら寿司	2,100	4,010.00	8,421,000	
キャンドウ	900	1,904.00	1,713,600	
アイケイ	600	622.00	373,200	
パルグループホールディングス	1,700	1,782.00	3,029,400	

エディオン	8,400	1,076.00	9,038,400
サーラコーポレーション	4,000	645.00	2,580,000
ワッツ	1,000	877.00	877,000
ハローズ	800	3,085.00	2,468,000
フジオフードグループ本社	1,700	1,380.00	2,346,000
あみやき亭	400	2,939.00	1,175,600
ひらまつ	3,600	220.00	792,000
大黒天物産	600	7,130.00	4,278,000
ハニーズホールディングス	1,600	1,150.00	1,840,000
ファーマライズホールディングス	500	798.00	399,000
アルペン	1,500	3,520.00	5,280,000
ハブ	600	740.00	444,000
クオールホールディングス	2,700	1,629.00	4,398,300
ジンスホールディングス	1,300	8,080.00	10,504,000
ビックカメラ	11,700	1,085.00	12,694,500
D C Mホールディングス	12,200	1,119.00	13,651,800
ペッパーフードサービス	2,700	388.00	1,047,600
Monotaro	25,000	2,588.00	64,700,000
東京一番フーズ	500	600.00	300,000
D Dホールディングス	1,000	505.00	505,000
きちりホールディングス	500	646.00	323,000
アークランドサービスホールディングス	1,400	2,374.00	3,323,600
J . フロント リテイリング	23,600	1,011.00	23,859,600
ドトール・日レスホールディングス	3,100	1,707.00	5,291,700
マツモトキヨシホールディングス	8,200	5,310.00	43,542,000
ブロンコピリー	1,100	2,548.00	2,802,800
Z O Z O	11,700	4,290.00	50,193,000
トレジャー・ファクトリー	600	956.00	573,600
物語コーポレーション	1,100	7,570.00	8,327,000
ココカラファイン	1,800	9,010.00	16,218,000
三越伊勢丹ホールディングス	34,600	808.00	27,956,800
H a m e e	500	1,390.00	695,000
マーケットエンタープライズ	100	880.00	88,000
ウエルシアホールディングス	10,500	4,030.00	42,315,000
クリエイティブSDホールディングス	2,900	3,880.00	11,252,000
丸善C H Iホールディングス	2,300	389.00	894,700

ミサワ	400	680.00	272,000	
ティーライフ	300	1,545.00	463,500	
エー・ピーホールディングス	400	477.00	190,800	
チムニー	600	1,544.00	926,400	
シュッピン	1,300	1,295.00	1,683,500	
オイシックス・ラ・大地	2,600	4,560.00	11,856,000	
ネクステージ	4,000	2,337.00	9,348,000	
ジョイフル本田	5,800	1,530.00	8,874,000	
鳥貴族ホールディングス	700	2,171.00	1,519,700	
ホットランド	1,500	1,361.00	2,041,500	
すかいらくホールディングス	25,600	1,589.00	40,678,400	
SFPホールディングス	1,000	1,475.00	1,475,000	
綿半ホールディングス	1,500	1,327.00	1,990,500	
ヨシックスホールディングス	400	2,316.00	926,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,800	1,149.00	6,664,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	1,000	1,521.00	1,521,000	
B E E N O S	1,000	3,055.00	3,055,000	
あさひ	1,500	1,404.00	2,106,000	
日本調剤	1,200	1,774.00	2,128,800	
コスモス薬品	2,000	19,820.00	39,640,000	
トーエル	1,000	912.00	912,000	
オンリー	300	764.00	229,200	
セブン&アイ・ホールディングス	77,400	5,158.00	399,229,200	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	10,600	922.00	9,773,200	
ツルハホールディングス	4,300	14,120.00	60,716,000	
サンマルクホールディングス	1,600	1,589.00	2,542,400	
フェリシモ	400	1,609.00	643,600	
トリドールホールディングス	4,900	2,635.00	12,911,500	
T O K Y O B A S E	1,800	641.00	1,153,800	
ウイルプラスホールディングス	300	1,141.00	342,300	
J Mホールディングス	1,300	2,347.00	3,051,100	
サツドラホールディングス	300	2,175.00	652,500	
アレンザホールディングス	1,500	1,463.00	2,194,500	
串カツ田中ホールディングス	500	2,268.00	1,134,000	
パロックジャパンリミテッド	1,400	887.00	1,241,800	

クスリのアオキホールディングス	2,000	8,280.00	16,560,000	
力の源ホールディングス	900	621.00	558,900	
FOOD & LIFE COMPANIES	11,600	5,060.00	58,696,000	
メディカルシステムネットワーク	1,700	789.00	1,341,300	
はるやまホールディングス	900	584.00	525,600	
ノジマ	3,500	2,941.00	10,293,500	
カッパ・クリエイト	2,800	1,418.00	3,970,400	
ライトオン	1,500	731.00	1,096,500	
良品計画	22,800	2,584.00	58,915,200	
三城ホールディングス	2,400	268.00	643,200	
アドヴァングループ	2,000	972.00	1,944,000	
アルビス	600	2,523.00	1,513,800	
コナカ	2,300	376.00	864,800	
ハウス オブ ローゼ	200	1,673.00	334,600	
G - 7ホールディングス	1,000	4,345.00	4,345,000	
イオン北海道	2,600	1,270.00	3,302,000	
コジマ	3,400	688.00	2,339,200	
ヒマラヤ	700	1,395.00	976,500	
コーナン商事	2,800	3,765.00	10,542,000	
エコス	700	1,999.00	1,399,300	
ワタミ	2,600	1,034.00	2,688,400	
マルシェ	500	491.00	245,500	
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	39,600	2,044.00	80,942,400	
西松屋チェーン	4,300	1,447.00	6,222,100	
ゼンショーホールディングス	10,600	2,830.00	29,998,000	
幸楽苑ホールディングス	1,300	1,507.00	1,959,100	
ハークスレイ	400	1,028.00	411,200	
サイゼリヤ	2,900	2,843.00	8,244,700	
V Tホールディングス	7,400	586.00	4,336,400	
魚力	600	2,206.00	1,323,600	
ポブラ	500	226.00	113,000	
フジ・コーポレーション	1,000	1,249.00	1,249,000	
ユナイテッドアローズ	2,300	1,982.00	4,558,600	
ハイデイ日高	2,900	1,743.00	5,054,700	
京都きもの友禅	1,300	258.00	335,400	

コロワイド	7,500	1,772.00	13,290,000	
ピーシーデポコーポレーション	2,300	473.00	1,087,900	
壱番屋	1,400	4,870.00	6,818,000	
トップカルチャー	700	345.00	241,500	
P L A N T	500	777.00	388,500	
スギホールディングス	4,000	8,650.00	34,600,000	
薬王堂ホールディングス	900	2,585.00	2,326,500	
ヴィア・ホールディングス	2,500	200.00	500,000	
スクロール	2,800	903.00	2,528,400	
ヨンドシーホールディングス	1,800	1,863.00	3,353,400	
木曽路	2,600	2,514.00	6,536,400	
S R S ホールディングス	2,600	847.00	2,202,200	
千趣会	3,600	398.00	1,432,800	
タカキュー	1,600	132.00	211,200	
リテールパートナーズ	2,400	1,297.00	3,112,800	
ケーヨー	3,700	855.00	3,163,500	
上新電機	2,300	2,641.00	6,074,300	
日本瓦斯	9,600	1,680.00	16,128,000	
ロイヤルホールディングス	3,400	2,109.00	7,170,600	
東天紅	100	1,136.00	113,600	
いなげや	2,200	1,465.00	3,223,000	
チヨダ	1,900	818.00	1,554,200	
ライフコーポレーション	1,900	4,835.00	9,186,500	
リンガーハット	2,400	2,360.00	5,664,000	
MrMaxHD	2,700	687.00	1,854,900	
テンアライド	1,800	333.00	599,400	
AOKIホールディングス	3,800	693.00	2,633,400	
オークワ	3,100	1,203.00	3,729,300	
コメリ	3,100	2,685.00	8,323,500	
青山商事	4,400	786.00	3,458,400	
しまむら	2,300	10,040.00	23,092,000	
はせがわ	1,000	272.00	272,000	
高島屋	14,400	1,153.00	16,603,200	
松屋	4,300	1,153.00	4,957,900	
エイチ・ツー・オー リテイリング	9,400	951.00	8,939,400	
近鉄百貨店	800	2,699.00	2,159,200	

丸井グループ	16,700	2,113.00	35,287,100
アクシアル リテイリング	1,600	4,125.00	6,600,000
井筒屋	1,100	203.00	223,300
イオン	76,200	3,066.00	233,629,200
イズミ	4,000	3,620.00	14,480,000
平和堂	3,700	2,341.00	8,661,700
フジ	2,400	2,250.00	5,400,000
ヤオコー	2,200	7,350.00	16,170,000
ゼビオホールディングス	2,400	1,193.00	2,863,200
ケースホールディングス	16,800	1,196.00	20,092,800
Olympicグループ	1,000	800.00	800,000
日産東京販売ホールディングス	2,900	247.00	716,300
シルバーライフ	400	1,610.00	644,000
一家ダイニングプロジェクト	400	575.00	230,000
Genky DrugStores	900	5,180.00	4,662,000
ナルミヤ・インターナショナル	400	1,052.00	420,800
ブックオフグループホールディングス	1,200	990.00	1,188,000
ギフト	300	2,718.00	815,400
アインホールディングス	2,900	7,460.00	21,634,000
元気寿司	600	2,732.00	1,639,200
ヤマダホールディングス	66,400	491.00	32,602,400
アークランドサカモト	3,100	1,814.00	5,623,400
ニトリホールディングス	7,900	22,520.00	177,908,000
グルメ杵屋	1,400	1,025.00	1,435,000
愛眼	1,600	223.00	356,800
ケーユーホールディングス	1,000	1,072.00	1,072,000
吉野家ホールディングス	6,500	2,211.00	14,371,500
松屋フーズホールディングス	1,000	3,660.00	3,660,000
サガミホールディングス	2,900	1,044.00	3,027,600
関西スーパーマーケット	1,500	1,901.00	2,851,500
王将フードサービス	1,300	6,090.00	7,917,000
プレナス	2,200	2,163.00	4,758,600
ミニストップ	1,500	1,504.00	2,256,000
アークス	3,800	2,370.00	9,006,000
バローホールディングス	4,000	2,531.00	10,124,000
藤久	500	745.00	372,500

ベルク	1,000	6,250.00	6,250,000	
大庄	1,100	1,036.00	1,139,600	
ファーストリテイリング	2,600	75,940.00	197,444,000	
サンドラッグ	7,400	3,635.00	26,899,000	
サクスパー ホールディングス	1,700	562.00	955,400	
ヤマザワ	500	1,757.00	878,500	
やまや	400	2,571.00	1,028,400	
ペルーナ	4,200	883.00	3,708,600	
島根銀行	700	618.00	432,600	
じもとホールディングス	1,300	733.00	952,900	
めぶきフィナンシャルグループ	103,000	259.00	26,677,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,500	1,663.00	4,157,500	
九州フィナンシャルグループ	40,500	432.00	17,496,000	
ゆうちょ銀行	56,200	989.00	55,581,800	
富山第一銀行	4,700	305.00	1,433,500	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	120,800	453.00	54,722,400	
西日本フィナンシャルホールディングス	12,900	733.00	9,455,700	
三十三フィナンシャルグループ	1,700	1,506.00	2,560,200	
第四北越フィナンシャルグループ	3,200	2,733.00	8,745,600	
ひろぎんホールディングス	29,200	664.00	19,388,800	
新生銀行	16,200	1,890.00	30,618,000	
あおぞら銀行	11,800	2,799.00	33,028,200	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,356,100	639.50	867,225,950	
りそなホールディングス	228,400	450.00	102,780,000	
三井住友トラスト・ホールディングス	37,500	3,859.00	144,712,500	
三井住友フィナンシャルグループ	137,200	3,992.00	547,702,400	
千葉銀行	66,200	734.00	48,590,800	
群馬銀行	40,800	364.00	14,851,200	
武蔵野銀行	3,000	1,942.00	5,826,000	
千葉興業銀行	5,000	294.00	1,470,000	
筑波銀行	8,200	185.00	1,517,000	
七十七銀行	6,200	1,302.00	8,072,400	
青森銀行	1,500	2,220.00	3,330,000	
秋田銀行	1,200	1,504.00	1,804,800	
山形銀行	2,200	897.00	1,973,400	
岩手銀行	1,300	1,782.00	2,316,600	

東邦銀行	17,700	217.00	3,840,900	
東北銀行	900	1,053.00	947,700	
みちのく銀行	1,300	893.00	1,160,900	
ふくおかフィナンシャルグループ	17,900	2,094.00	37,482,600	
静岡銀行	48,300	929.00	44,870,700	
十六銀行	2,500	2,296.00	5,740,000	
スルガ銀行	17,400	395.00	6,873,000	
八十二銀行	44,700	400.00	17,880,000	
山梨中央銀行	2,300	860.00	1,978,000	
大垣共立銀行	3,900	1,979.00	7,718,100	
福井銀行	1,700	1,693.00	2,878,100	
北國銀行	1,800	2,211.00	3,979,800	
清水銀行	800	1,686.00	1,348,800	
富山銀行	400	2,410.00	964,000	
滋賀銀行	4,000	1,935.00	7,740,000	
南都銀行	2,900	2,060.00	5,974,000	
百五銀行	17,800	338.00	6,016,400	
京都銀行	7,100	5,250.00	37,275,000	
紀陽銀行	7,000	1,610.00	11,270,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	13,200	872.00	11,510,400	
山陰合同銀行	12,500	575.00	7,187,500	
中国銀行	17,100	918.00	15,697,800	
鳥取銀行	600	1,156.00	693,600	
伊予銀行	26,300	603.00	15,858,900	
百十四銀行	2,100	1,606.00	3,372,600	
四国銀行	2,800	764.00	2,139,200	
阿波銀行	3,000	2,272.00	6,816,000	
大分銀行	1,100	1,890.00	2,079,000	
宮崎銀行	1,200	2,179.00	2,614,800	
佐賀銀行	1,100	1,525.00	1,677,500	
沖縄銀行	1,800	2,880.00	5,184,000	
琉球銀行	4,300	809.00	3,478,700	
セブン銀行	66,200	260.00	17,212,000	
みずほフィナンシャルグループ	269,400	1,612.50	434,407,500	
高知銀行	700	847.00	592,900	
山口フィナンシャルグループ	24,700	681.00	16,820,700	

長野銀行	700	1,201.00	840,700
名古屋銀行	1,600	2,821.00	4,513,600
北洋銀行	29,900	272.00	8,132,800
愛知銀行	700	3,710.00	2,597,000
中京銀行	700	1,439.00	1,007,300
大光銀行	700	1,593.00	1,115,100
愛媛銀行	2,800	805.00	2,254,000
トマト銀行	800	1,131.00	904,800
京葉銀行	8,500	466.00	3,961,000
栃木銀行	9,600	184.00	1,766,400
北日本銀行	600	1,619.00	971,400
東和銀行	3,500	542.00	1,897,000
福島銀行	2,300	257.00	591,100
大東銀行	1,000	685.00	685,000
トモニホールディングス	15,300	332.00	5,079,600
フィデアホールディングス	19,200	133.00	2,553,600
池田泉州ホールディングス	22,800	172.00	3,921,600
F P G	6,700	728.00	4,877,600
ジャパンインベストメントアドバイザー	1,500	1,389.00	2,083,500
マーキュリアホールディングス	700	769.00	538,300
S B I ホールディングス	24,400	2,850.00	69,540,000
日本アジア投資	1,700	275.00	467,500
ジャフコ グループ	2,500	7,310.00	18,275,000
大和証券グループ本社	148,500	696.10	103,370,850
野村ホールディングス	302,700	570.30	172,629,810
岡三証券グループ	16,900	435.00	7,351,500
丸三証券	5,900	694.00	4,094,600
東洋証券	6,500	172.00	1,118,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	21,100	440.00	9,284,000
光世証券	500	645.00	322,500
水戸証券	5,300	325.00	1,722,500
いちよし証券	4,000	713.00	2,852,000
松井証券	9,700	853.00	8,274,100
マネックスグループ	17,800	608.00	10,822,400
極東証券	2,700	915.00	2,470,500
岩井コスモホールディングス	2,000	1,474.00	2,948,000

藍澤證券	3,600	1,186.00	4,269,600	
マネーパートナーズグループ	2,100	226.00	474,600	
スパークス・グループ	9,100	306.00	2,784,600	
小林洋行	600	276.00	165,600	
かんぽ生命保険	24,600	2,078.00	51,118,800	
S O M P Oホールディングス	34,900	5,206.00	181,689,400	
アニコム ホールディングス	5,600	910.00	5,096,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	48,100	3,901.00	187,638,100	
第一生命ホールディングス	97,600	2,445.00	238,632,000	
東京海上ホールディングス	65,300	5,985.00	390,820,500	
T & Dホールディングス	59,300	1,497.00	88,772,100	
アドバンスクリエイト	1,000	1,145.00	1,145,000	
全国保証	5,200	5,690.00	29,588,000	
あんしん保証	700	328.00	229,600	
ジェイリース	700	1,706.00	1,194,200	
イントラスト	600	763.00	457,800	
日本モーゲージサービス	1,000	1,090.00	1,090,000	
C a s a	600	994.00	596,400	
アルヒ	2,900	1,354.00	3,926,600	
プレミアグループ	900	3,685.00	3,316,500	
クレディセゾン	11,600	1,360.00	15,776,000	
芙蓉総合リース	2,100	8,040.00	16,884,000	
みずほリース	3,100	3,770.00	11,687,000	
東京センチュリー	4,600	6,610.00	30,406,000	
日本証券金融	8,400	931.00	7,820,400	
アイフル	33,300	377.00	12,554,100	
リコーリース	1,600	3,860.00	6,176,000	
イオンフィナンシャルサービス	12,100	1,338.00	16,189,800	
アコム	39,100	434.00	16,969,400	
ジャックス	2,200	2,895.00	6,369,000	
オリエントコーポレーション	53,600	156.00	8,361,600	
オリックス	120,400	2,173.50	261,689,400	
三菱H C キャピタル	68,600	601.00	41,228,600	
九州リースサービス	1,000	630.00	630,000	
日本取引所グループ	53,600	3,031.00	162,461,600	

イー・ギャランティ	2,300	2,586.00	5,947,800	
アサックス	1,000	720.00	720,000	
NECキャピタルソリューション	800	2,210.00	1,768,000	
いちご	22,100	370.00	8,177,000	
日本駐車場開発	21,700	167.00	3,623,900	
スター・マイカ・ホールディングス	1,100	1,524.00	1,676,400	
SREホールディングス	300	7,970.00	2,391,000	
ADワークスグループ	3,900	160.00	624,000	
ヒューリック	42,100	1,353.00	56,961,300	
三栄建築設計	800	1,991.00	1,592,800	
野村不動産ホールディングス	11,400	2,985.00	34,029,000	
三重交通グループホールディングス	4,000	539.00	2,156,000	
サムティ	2,800	2,380.00	6,664,000	
ディア・ライフ	2,500	510.00	1,275,000	
コーセーアールイー	600	665.00	399,000	
日本商業開発	1,300	1,756.00	2,282,800	
プレサンスコーポレーション	3,300	1,944.00	6,415,200	
THEグローバル社	1,200	222.00	266,400	
ハウスコム	300	1,289.00	386,700	
日本管理センター	900	1,269.00	1,142,100	
サンセイランディック	600	828.00	496,800	
エストラスト	200	662.00	132,400	
フージャースホールディングス	3,200	697.00	2,230,400	
オープンハウス	6,300	6,220.00	39,186,000	
東急不動産ホールディングス	53,900	686.00	36,975,400	
飯田グループホールディングス	16,500	2,945.00	48,592,500	
イーランド	300	1,541.00	462,300	
ムゲンエステート	1,200	498.00	597,600	
ビーロッド	1,300	550.00	715,000	
ファーストブラザーズ	500	1,047.00	523,500	
ハウズドゥ	1,000	1,029.00	1,029,000	
シーアールイー	500	2,414.00	1,207,000	
プロパティエージェント	300	3,345.00	1,003,500	
ケイアイスター不動産	700	5,680.00	3,976,000	
アグレ都市デザイン	400	1,066.00	426,400	
グッドコムアセット	900	1,341.00	1,206,900	

ジェイ・エス・ピー	400	3,320.00	1,328,000	
テンポイノベーション	600	927.00	556,200	
グローバル・リンク・マネジメント	300	956.00	286,800	
フェイスネットワーク	200	1,429.00	285,800	
パーク24	10,600	1,911.00	20,256,600	
パラカ	500	1,844.00	922,000	
三井不動産	90,400	2,624.50	237,254,800	
三菱地所	130,200	1,810.50	235,727,100	
平和不動産	3,400	4,245.00	14,433,000	
東京建物	19,600	1,769.00	34,672,400	
ダイビル	5,000	1,587.00	7,935,000	
京阪神ビルディング	3,400	1,533.00	5,212,200	
住友不動産	44,600	3,964.00	176,794,400	
テオオーシー	3,600	676.00	2,433,600	
東京楽天地	300	4,195.00	1,258,500	
レオパレス21	16,400	260.00	4,264,000	
スターツコーポレーション	2,400	2,987.00	7,168,800	
フジ住宅	2,300	729.00	1,676,700	
空港施設	2,000	596.00	1,192,000	
明和地所	900	623.00	560,700	
ゴールドクレスト	1,800	1,780.00	3,204,000	
エスリード	800	1,680.00	1,344,000	
日神グループホールディングス	2,900	528.00	1,531,200	
日本エスコン	3,700	806.00	2,982,200	
タカラレーベン	8,300	324.00	2,689,200	
A V A N T I A	1,000	903.00	903,000	
イオンモール	9,900	1,726.00	17,087,400	
毎日コムネット	700	765.00	535,500	
ファースト住建	700	1,333.00	933,100	
ランド	107,700	12.00	1,292,400	
カチタス	4,900	4,180.00	20,482,000	
トーセイ	2,700	1,220.00	3,294,000	
穴吹興産	400	2,080.00	832,000	
サンフロンティア不動産	2,400	1,200.00	2,880,000	
エフ・ジェー・ネクスト	1,900	1,083.00	2,057,700	
インテリックス	400	781.00	312,400	

ランドビジネス	900	271.00	243,900	
サンネクスタグループ	600	1,020.00	612,000	
グランディハウス	1,300	496.00	644,800	
日本空港ビルデング	6,900	4,955.00	34,189,500	
明豊ファシリティワークス	900	935.00	841,500	
日本工営	1,100	3,545.00	3,899,500	
L I F U L L	5,900	371.00	2,188,900	
ミクシィ	4,900	2,765.00	13,548,500	
ジェイエシーリクルートメント	1,600	2,132.00	3,411,200	
日本M & Aセンター	31,500	3,645.00	114,817,500	
メンバーズ	600	3,380.00	2,028,000	
中広	300	400.00	120,000	
UTグループ	2,800	3,160.00	8,848,000	
アイティメディア	600	2,397.00	1,438,200	
タケエイ	2,100	1,851.00	3,887,100	
E・Jホールディングス	1,000	1,370.00	1,370,000	
夢真ビーネックスグループ	5,100	1,347.00	6,869,700	
コシダカホールディングス	5,100	592.00	3,019,200	
アルトナー	500	863.00	431,500	
パソナグループ	2,100	3,400.00	7,140,000	
C D S	500	1,666.00	833,000	
リンクアンドモチベーション	4,200	1,112.00	4,670,400	
G C A	2,800	1,395.00	3,906,000	
エス・エム・エス	6,500	4,325.00	28,112,500	
サニーサイドアップグループ	700	777.00	543,900	
パーソルホールディングス	19,200	2,755.00	52,896,000	
リニカル	1,100	841.00	925,100	
クックパッド	6,000	237.00	1,422,000	
エスクリ	600	551.00	330,600	
アイ・ケイ・ケイ	900	695.00	625,500	
学情	800	1,291.00	1,032,800	
スタジオアリス	1,000	2,427.00	2,427,000	
シミックホールディングス	1,100	1,528.00	1,680,800	
エプコ	400	900.00	360,000	
N J S	400	1,976.00	790,400	
総合警備保障	7,600	5,060.00	38,456,000	

カカクコム	14,200	3,755.00	53,321,000	
アイロムグループ	700	2,328.00	1,629,600	
セントケア・ホールディング	1,400	1,022.00	1,430,800	
サイネックス	300	673.00	201,900	
ルネサンス	1,200	1,203.00	1,443,600	
ディップ	3,000	4,280.00	12,840,000	
デジタルホールディングス	1,300	1,814.00	2,358,200	
新日本科学	2,300	944.00	2,171,200	
キャリアデザインセンター	500	1,245.00	622,500	
ベネフィット・ワン	7,000	5,510.00	38,570,000	
エムスリー	33,900	8,721.00	295,641,900	
ツカダ・グローバルホールディング	1,200	359.00	430,800	
プラス	200	715.00	143,000	
アウトソーシング	11,000	2,057.00	22,627,000	
ウェルネット	1,900	537.00	1,020,300	
ワールドホールディングス	800	2,872.00	2,297,600	
ディー・エヌ・エー	8,100	2,092.00	16,945,200	
博報堂DYホールディングス	26,700	1,916.00	51,157,200	
ぐるなび	3,300	541.00	1,785,300	
タカミヤ	2,300	485.00	1,115,500	
ジャパンベストレスキューシステム	1,300	1,247.00	1,621,100	
ファンコミュニケーションズ	4,800	439.00	2,107,200	
ライク	500	1,905.00	952,500	
ビジネス・ブレークスルー	800	447.00	357,600	
エスプール	5,400	1,064.00	5,745,600	
WDBホールディングス	900	3,670.00	3,303,000	
手間いらず	200	5,960.00	1,192,000	
ティア	1,100	515.00	566,500	
CDG	200	1,591.00	318,200	
アドウェイズ	3,100	737.00	2,284,700	
バリューコマース	1,500	4,855.00	7,282,500	
インフォマート	21,000	1,090.00	22,890,000	
J Pホールディングス	5,500	279.00	1,534,500	
エコナックホールディングス	3,500	88.00	308,000	
レッグス	400	2,352.00	940,800	
プレステージ・インターナショナル	7,200	791.00	5,695,200	

アミューズ	1,000	2,391.00	2,391,000	
ドリームインキュベータ	600	947.00	568,200	
クイック	1,200	1,437.00	1,724,400	
T A C	1,000	246.00	246,000	
電通グループ	19,800	4,320.00	85,536,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	900	1,064.00	957,600	
ぴあ	500	3,510.00	1,755,000	
イオンファンタジー	700	2,020.00	1,414,000	
シーティーエス	2,200	823.00	1,810,600	
ネクシィーズグループ	700	926.00	648,200	
H . U . グループホールディングス	5,400	3,245.00	17,523,000	
アルプス技研	1,700	2,118.00	3,600,600	
サニックス	3,000	344.00	1,032,000	
ダイオーズ	400	1,138.00	455,200	
日本空調サービス	2,000	737.00	1,474,000	
オリエンタルランド	20,400	17,040.00	347,616,000	
ダスキン	4,500	2,696.00	12,132,000	
明光ネットワークジャパン	2,300	628.00	1,444,400	
ファルコホールディングス	900	1,791.00	1,611,900	
秀英予備校	400	433.00	173,200	
田谷	400	579.00	231,600	
ラウンドワン	6,600	1,374.00	9,068,400	
リゾートトラスト	8,800	2,049.00	18,031,200	
ビー・エム・エル	2,500	4,485.00	11,212,500	
りらいあコミュニケーションズ	2,900	1,285.00	3,726,500	
リソー教育	9,700	434.00	4,209,800	
早稲田アカデミー	800	981.00	784,800	
ユー・エス・エス	21,500	1,998.00	42,957,000	
東京個別指導学院	1,700	665.00	1,130,500	
サイバーエージェント	47,300	2,286.00	108,127,800	
楽天グループ	98,500	1,129.00	111,206,500	
クリーク・アンド・リバー社	1,000	1,881.00	1,881,000	
モーニングスター	2,800	532.00	1,489,600	
テー・オー・ダブリュー	3,400	337.00	1,145,800	
山田コンサルティンググループ	1,100	1,168.00	1,284,800	
セントラルスポーツ	700	2,555.00	1,788,500	

フルキャストホールディングス	1,600	2,326.00	3,721,600	
エン・ジャパン	3,400	4,145.00	14,093,000	
リソルホールディングス	200	4,085.00	817,000	
テクノプロ・ホールディングス	11,500	3,370.00	38,755,000	
アトラグループ	400	319.00	127,600	
インターワークス	600	422.00	253,200	
アイ・アールジャパンホールディングス	800	15,370.00	12,296,000	
K e e P e r 技研	1,200	4,170.00	5,004,000	
ファーストロジック	400	774.00	309,600	
三機サービス	400	1,131.00	452,400	
G u n o s y	1,200	722.00	866,400	
デザインワン・ジャパン	500	248.00	124,000	
イー・ガーディアン	800	3,325.00	2,660,000	
リブセンス	1,100	208.00	228,800	
ジャパンマテリアル	5,900	1,367.00	8,065,300	
ベクトル	2,400	1,144.00	2,745,600	
ウチヤマホールディングス	900	352.00	316,800	
チャーム・ケア・コーポレーション	1,400	1,667.00	2,333,800	
キャリアリンク	600	1,903.00	1,141,800	
I B J	1,600	1,057.00	1,691,200	
アサンテ	700	1,850.00	1,295,000	
バリューHR	800	1,814.00	1,451,200	
M&Aキャピタルパートナーズ	1,600	5,880.00	9,408,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	700	1,628.00	1,139,600	
E R Iホールディングス	500	1,234.00	617,000	
アビスト	300	3,075.00	922,500	
シグマクシス	1,100	2,948.00	3,242,800	
ウィルグループ	1,400	1,320.00	1,848,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	2,800	223.00	624,400	
メドピア	1,500	4,355.00	6,532,500	
レアジョブ	400	1,453.00	581,200	
リクルートホールディングス	137,600	6,966.00	958,521,600	
エラン	2,600	1,290.00	3,354,000	
土木管理総合試験所	900	376.00	338,400	
ネットマーケティング	900	481.00	432,900	
日本郵政	145,300	981.80	142,655,540	

ベルシステム24ホールディングス	3,200	1,698.00	5,433,600	
鎌倉新書	1,900	944.00	1,793,600	
S MN	400	687.00	274,800	
一蔵	200	404.00	80,800	
グローバルキッズCOMPANY	300	756.00	226,800	
エアトリ	1,200	3,140.00	3,768,000	
アトラエ	1,300	2,637.00	3,428,100	
ストライク	700	4,350.00	3,045,000	
ソラスト	4,700	1,576.00	7,407,200	
セラク	600	2,355.00	1,413,000	
インソース	1,900	2,125.00	4,037,500	
ペイカレント・コンサルティング	1,300	58,100.00	75,530,000	
Orchestra Holdings	400	3,800.00	1,520,000	
アイモバイル	500	1,414.00	707,000	
キャリアインデックス	800	1,113.00	890,400	
MS - Japan	800	1,172.00	937,600	
船場	400	828.00	331,200	
グレイステクノロジー	1,900	1,147.00	2,179,300	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	5,500	2,692.00	14,806,000	
フルテック	300	1,429.00	428,700	
グリーンズ	700	562.00	393,400	
ツナググループ・ホールディングス	400	316.00	126,400	
GameWith	600	560.00	336,000	
ソウルドアウト	500	1,711.00	855,500	
MS&Consulting	300	606.00	181,800	
ウェルビー	700	1,660.00	1,162,000	
エル・ティー・エス	200	3,730.00	746,000	
ミダックホールディングス	800	5,590.00	4,472,000	
日総工産	1,500	759.00	1,138,500	
キュービーネットホールディングス	900	1,883.00	1,694,700	
RPAホールディングス	2,300	613.00	1,409,900	
スプリックス	500	961.00	480,500	
マネジメントソリューションズ	900	3,470.00	3,123,000	
プロレド・パートナーズ	400	2,120.00	848,000	
and factory	400	552.00	220,800	

テノ・ホールディングス	200	969.00	193,800	
フロンティア・マネジメント	500	1,052.00	526,000	
ピアラ	300	771.00	231,300	
コプロ・ホールディングス	200	1,284.00	256,800	
ギークス	300	1,722.00	516,600	
カーブスホールディングス	5,300	906.00	4,801,800	
フォーラムエンジニアリング	1,300	928.00	1,206,400	
ダイレクトマーケティングミックス	1,000	4,465.00	4,465,000	
ポピンズホールディングス	400	3,350.00	1,340,000	
LITALICO	800	6,870.00	5,496,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	1,000	1,185.00	1,185,000	
リログループ	10,500	2,357.00	24,748,500	
東祥	1,200	1,844.00	2,212,800	
エイチ・アイ・エス	4,300	2,345.00	10,083,500	
ラックランド	500	2,887.00	1,443,500	
共立メンテナンス	3,200	3,875.00	12,400,000	
イチネンホールディングス	2,000	1,330.00	2,660,000	
建設技術研究所	1,100	2,700.00	2,970,000	
スペース	1,400	971.00	1,359,400	
長大	800	2,483.00	1,986,400	
燦ホールディングス	800	1,538.00	1,230,400	
スバル興業	100	8,340.00	834,000	
東京テアトル	800	1,302.00	1,041,600	
タナベ経営	400	1,600.00	640,000	
ナガワ	600	13,410.00	8,046,000	
東京都競馬	1,400	4,210.00	5,894,000	
常磐興産	800	1,499.00	1,199,200	
カナモト	3,400	2,714.00	9,227,600	
西尾レントオール	1,800	3,045.00	5,481,000	
アゴラ ホスピタリティィー グループ	10,500	26.00	273,000	
トランス・コスモス	1,800	3,750.00	6,750,000	
乃村工藝社	8,200	1,005.00	8,241,000	
藤田観光	800	2,326.00	1,860,800	
KNT - CTホールディングス	1,000	1,402.00	1,402,000	
日本管財	2,100	2,730.00	5,733,000	
トーカイ	1,900	2,426.00	4,609,400	

白洋舎	200	2,095.00	419,000	
セコム	18,900	8,541.00	161,424,900	
セントラル警備保障	900	2,837.00	2,553,300	
丹青社	3,600	871.00	3,135,600	
メイテック	2,300	6,800.00	15,640,000	
応用地質	2,200	1,469.00	3,231,800	
船井総研ホールディングス	3,900	2,916.00	11,372,400	
進学会ホールディングス	800	427.00	341,600	
オオバ	1,300	882.00	1,146,600	
いであ	500	1,900.00	950,000	
学究社	600	1,405.00	843,000	
ベネッセホールディングス	7,000	2,465.00	17,255,000	
イオンディライト	2,400	3,685.00	8,844,000	
ナック	900	980.00	882,000	
ダイセキ	3,800	4,815.00	18,297,000	
ステップ	700	1,883.00	1,318,100	
合 計	21,327,300		57,767,585,540	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M先進国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	3,262,162,374
コール・ローン	359,989,463
株式	108,925,315,881
投資証券	2,587,790,860
派生商品評価勘定	870,188
未収入金	7,429,361,895
未収配当金	160,892,310
差入委託証拠金	3,402,123,063
流動資産合計	126,128,506,034
資産合計	126,128,506,034
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,876,074
未払金	7,281,106,447
未払利息	976
流動負債合計	7,343,983,497
負債合計	7,343,983,497
純資産の部	
元本等	
元本	62,012,711,874
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	56,771,810,663
元本等合計	118,784,522,537
純資産合計	118,784,522,537
負債純資産合計	126,128,506,034

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

4.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 原則として、約定日基準で計上しております。 為替予約取引による為替差損益 原則として、約定日基準で計上しております。</p>
5.その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	49,503,216,612円
期中追加設定元本額	58,244,683,602円
期中一部解約元本額	45,735,188,340円
期末元本額	62,012,711,874円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	3,062,801,831円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	6,520,773,202円
りそなラップ型ファンド(成長型)	6,456,087,530円
DCりそな グローバルバランス	53,801,452円
つみたてバランスファンド	1,753,734,332円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,523,184,657円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	831,861,446円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	541,950,314円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	157,294,186円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	100,113,518円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	53,655,895円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	79,635,170円
リスクコントロール・オープン	46,925,001円
FWりそな先進国株式アクティブファンド	409,012,198円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	161,375,935円
FWりそな先進国株式インデックスファンド	23,939,039,388円
Smart-i 先進国株式インデックス	6,448,440,902円
Smart-i 8資産バランス 安定型	276,696,804円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	730,938,397円
Smart-i 8資産バランス 成長型	843,735,788円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,140,387,419円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,137,732,210円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,272,826,957円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	921,149,940円

りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,045,518,088円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	178,211,062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)	6,786,108円
りそなFT 先進国株式インデックス(適格機関投資家専用)	279,905,531円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	375,404,379円
りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	663,142,579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)	83,913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)	211,963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)	293,779円
2. 計算日における受益権の総数	62,012,711,874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	1.9155円
(10,000口当たり純資産額)	(19,155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 9月15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 9月15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 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		10,151,549,545
投資証券		369,291,324
合計		10,520,840,869

（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 9月15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	7,679,542,325	-	7,647,314,689	32,227,636
合計		7,679,542,325	-	7,647,314,689	32,227,636

(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 9月15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	8,182,789,670	-	8,153,011,420	29,778,250
	米ドル	5,976,309,892	-	5,956,246,602	20,063,290
	カナダドル	270,041,955	-	268,224,925	1,817,030
	ユーロ	852,635,100	-	849,730,665	2,904,435
	英ポンド	369,317,586	-	367,264,971	2,052,615
	スイスフラン	245,240,578	-	245,081,143	159,435
	スウェーデンク ローナ	93,805,958	-	93,450,930	355,028
	ノルウェークロー ネ	19,188,781	-	19,092,635	96,146
	デンマーククロー ネ	78,887,703	-	78,606,150	281,553
	オーストラリアド ル	175,230,879	-	173,549,672	1,681,207
	ニュージーランド ドル	391,465	-	388,590	2,875
	香港ドル	74,196,946	-	73,964,694	232,252
シンガポールドル	27,542,827	-	27,410,443	132,384	
合計		8,182,789,670	-	8,153,011,420	29,778,250

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	BAKER HUGHES COMPANY	11,112	24.34	270,466.08	
	CHENIERE ENERGY INC	4,740	88.54	419,679.60	
	CHEVRON CORP	35,641	96.20	3,428,664.20	
	CONOCOPHILLIPS	25,220	56.94	1,436,026.80	
	DEVON ENERGY CORP	11,449	28.27	323,663.23	
	EOG RESOURCES INC	11,132	69.52	773,896.64	
	EXXON MOBIL CORP	77,935	54.58	4,253,692.30	
	HALLIBURTON CO	15,912	20.07	319,353.84	
	HESS CORP	5,183	68.91	357,160.53	
	KINDER MORGAN INC	39,208	16.01	627,720.08	
	MARATHON PETROLEUM CORP	12,478	57.56	718,233.68	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	16,526	26.28	434,303.28	
	ONEOK INC	7,921	53.05	420,209.05	
	PHILLIPS 66	8,474	65.24	552,843.76	
	PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4,195	152.95	641,625.25	
	SCHLUMBERGER LTD	26,723	27.67	739,425.41	
	VALERO ENERGY CORP	6,797	64.70	439,765.90	
WILLIAMS COS INC	20,127	24.75	498,143.25		

AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	3,913	268.86	1,052,049.18
ALBEMARLE CORP	2,101	230.47	484,217.47
AMCOR PLC	30,404	12.32	374,577.28
AVERY DENNISON CORP	1,280	221.82	283,929.60
BALL CORP	6,339	92.65	587,308.35
CELANESE CORP	1,759	149.71	263,339.89
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,957	46.12	136,376.84
CORTEVA INC	12,364	42.26	522,502.64
CROWN HOLDINGS INC	2,078	105.59	219,416.02
DOW INC	14,184	59.65	846,075.60
DUPONT DE NEMOURS INC	10,182	68.47	697,161.54
EASTMAN CHEMICAL CO	2,692	104.50	281,314.00
ECOLAB INC	4,554	223.56	1,018,092.24
FMC CORP	2,761	96.85	267,402.85
FREEPORT-MCMORAN INC	26,009	34.79	904,853.11
INTERNATIONAL PAPER CO	6,946	57.75	401,131.50
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,311	143.75	619,706.25
LINDE PLC	9,609	311.94	2,997,431.46
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,481	93.83	420,452.23
MARTIN MARIETTA MATERIALS	1,158	361.68	418,825.44
MOSAIC CO/THE	5,552	32.04	177,886.08
NEWMONT CORP	15,206	57.20	869,783.20
NUCOR CORP	5,308	106.20	563,709.60
PACKAGING CORP OF AMERICA	1,870	148.28	277,283.60
PPG INDUSTRIES INC	4,543	150.33	682,949.19
RPM INTERNATIONAL INC	2,344	79.55	186,465.20
SEALED AIR CORP	2,628	58.15	152,818.20
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,753	298.86	1,420,481.58
STEEL DYNAMICS INC	3,569	61.97	221,170.93
VULCAN MATERIALS CO	2,241	175.73	393,810.93
WESTROCK CO	5,361	50.56	271,052.16
3M CO	10,765	182.42	1,963,751.30
ALLEGION PLC	1,523	139.56	212,549.88
AMETEK INC	4,464	131.24	585,855.36
BOEING CO/THE	10,303	211.57	2,179,805.71

CARRIER GLOBAL CORP	15,650	54.98	860,437.00
CATERPILLAR INC	10,165	202.33	2,056,684.45
CUMMINS INC	2,808	231.82	650,950.56
DEERE & CO	5,529	355.98	1,968,213.42
DOVER CORP	2,606	166.97	435,123.82
EATON CORP PLC	7,026	156.30	1,098,163.80
EMERSON ELECTRIC CO	10,598	97.65	1,034,894.70
FASTENAL CO	11,090	53.04	588,213.60
FORTIVE CORP	5,995	74.98	449,505.10
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	1,882	96.20	181,048.40
GENERAC HOLDINGS INC	1,124	433.54	487,298.96
GENERAL DYNAMICS CORP	4,547	196.66	894,213.02
GENERAL ELECTRIC CO	20,363	100.38	2,044,037.94
HEICO CORP	647	126.51	81,851.97
HEICO CORP-CLASS A	819	113.52	92,972.88
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	12,834	220.19	2,825,918.46
HOWMET AEROSPACE INC	5,854	31.59	184,927.86
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	604	197.75	119,441.00
IDEX CORP	1,126	215.92	243,125.92
ILLINOIS TOOL WORKS	5,557	217.07	1,206,257.99
INGERSOLL-RAND INC	6,884	53.55	368,638.20
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4,100	54.00	221,400.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	13,521	74.37	1,005,556.77
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	3,883	226.98	881,363.34
LENNOX INTERNATIONAL INC	728	313.29	228,075.12
LOCKHEED MARTIN CORP	4,663	344.34	1,605,657.42
MASCO CORP	4,315	58.96	254,412.40
NORDSON CORP	746	242.05	180,569.30
NORTHROP GRUMMAN CORP	2,884	351.73	1,014,389.32
OTIS WORLDWIDE CORP	7,802	90.36	704,988.72
OWENS CORNING	1,611	93.54	150,692.94
PACCAR INC	6,725	83.93	564,429.25
PARKER HANNIFIN CORP	2,247	285.71	641,990.37
PENTAIR PLC	3,558	75.96	270,265.68
PLUG POWER INC	8,433	24.66	207,957.78

RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	28,068	82.74	2,322,346.32
ROCKWELL AUTOMATION INC	2,223	313.31	696,488.13
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,875	468.72	878,850.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3,195	57.33	183,169.35
SMITH (A.O.) CORP	2,718	68.33	185,720.94
SNAP-ON INC	1,158	216.07	250,209.06
STANLEY BLACK & DECKER INC	2,839	182.38	517,776.82
SUNRUN INC	2,890	44.49	128,576.10
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	913	431.39	393,859.07
TEXTRON INC	4,227	69.84	295,213.68
TRANE TECHNOLOGIES PLC	4,538	183.74	833,812.12
TRANSDIGM GROUP INC	1,006	614.00	617,684.00
UNITED RENTALS INC	1,210	331.30	400,873.00
WABTEC CORP	2,696	89.40	241,022.40
WW GRAINGER INC	677	409.88	277,488.76
XYLEM INC	3,290	132.49	435,892.10
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	2,440	79.97	195,126.80
CINTAS CORP	1,623	396.11	642,886.53
CLARIVATE PLC	5,086	23.67	120,385.62
COPART INC	4,160	144.59	601,494.40
COSTAR GROUP INC	7,645	89.34	683,004.30
EQUIFAX INC	2,365	273.86	647,678.90
IHS MARKIT LTD	6,841	123.39	844,110.99
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	2,482	133.01	330,130.82
LEIDOS HOLDINGS INC	1,963	94.61	185,719.43
REPUBLIC SERVICES INC	4,391	124.95	548,655.45
ROBERT HALF INTL INC	2,316	101.79	235,745.64
ROLLINS INC	3,021	37.73	113,982.33
TRANSUNION	3,373	119.00	401,387.00
VERISK ANALYTICS INC	3,002	205.56	617,091.12
WASTE CONNECTIONS INC	5,074	130.22	660,736.28
WASTE MANAGEMENT INC	7,500	154.58	1,159,350.00
AMERCO	106	658.94	69,847.64
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	2,304	90.08	207,544.32
CSX CORP	42,717	30.50	1,302,868.50

DELTA AIR LINES INC	1,316	39.44	51,903.04
EXPEDITORS INTL WASH INC	3,076	128.28	394,589.28
FEDEX CORP	4,433	255.20	1,131,301.60
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1,685	168.15	283,332.75
KANSAS CITY SOUTHERN	1,637	280.00	458,360.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	2,460	51.72	127,231.20
LYFT INC-A	4,003	50.53	202,271.59
NORFOLK SOUTHERN CORP	4,723	244.79	1,156,143.17
OLD DOMINION FREIGHT LINE	1,802	288.66	520,165.32
SOUTHWEST AIRLINES CO	2,205	48.03	105,906.15
UBER TECHNOLOGIES INC	21,623	39.01	843,513.23
UNION PACIFIC CORP	12,317	203.41	2,505,400.97
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	13,408	191.01	2,561,062.08
APTIV PLC	4,894	149.83	733,268.02
AUTOLIV INC	1,547	87.55	135,439.85
BORGWARNER INC	3,548	42.95	152,386.60
FORD MOTOR CO	70,192	12.86	902,669.12
GENERAL MOTORS CO	23,162	50.74	1,175,239.88
LEAR CORP	775	157.49	122,054.75
TESLA INC	15,012	744.49	11,176,283.88
DR HORTON INC	6,722	87.88	590,729.36
GARMIN LTD	2,605	169.47	441,469.35
HASBRO INC	2,664	97.48	259,686.72
LENNAR CORP-A	5,456	98.59	537,907.04
LULULEMON ATHLETICA INC	2,360	420.50	992,380.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	916	186.44	170,779.04
NEWELL RUBBERMAID INC	5,534	24.72	136,800.48
NIKE INC -CL B	23,550	158.76	3,738,798.00
NVR INC	54	4,958.59	267,763.86
PELOTON INTERACTIVE INC-A	5,029	108.50	545,646.50
PULTEGROUP INC	3,683	47.18	173,763.94
VF CORP	5,597	70.47	394,420.59
WHIRLPOOL CORP	966	216.24	208,887.84
AIRBNB INC-CLASS A	2,341	163.30	382,285.30
ARAMARK	4,618	32.35	149,392.30

BOOKING HOLDINGS INC	763	2,328.66	1,776,767.58
CAESARS ENTERTAINMENT INC	4,099	103.07	422,483.93
CARNIVAL CORP	14,286	22.86	326,577.96
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	530	1,859.79	985,688.70
DARDEN RESTAURANTS INC	2,383	148.62	354,161.46
DOMINO'S PIZZA INC	763	506.96	386,810.48
DRAFTKINGS INC - CL A	5,981	59.05	353,178.05
EXPEDIA GROUP INC	2,522	150.60	379,813.20
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	5,330	131.82	702,600.60
LAS VEGAS SANDS CORP	5,125	38.71	198,388.75
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	5,283	142.34	751,982.22
MCDONALD'S CORP	13,762	241.13	3,318,431.06
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,600	11.95	43,020.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7,027	41.41	290,988.07
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	4,500	82.42	370,890.00
STARBUCKS CORP	21,786	118.86	2,589,483.96
VAIL RESORTS INC	810	298.25	241,582.50
WYNN RESORTS LTD	1,490	92.25	137,452.50
YUM! BRANDS INC	5,679	128.99	732,534.21
ACTIVISION BLIZZARD INC	13,734	77.84	1,069,054.56
ALPHABET INC-CL A	5,509	2,850.89	15,705,553.01
ALPHABET INC-CL C	5,335	2,868.12	15,301,420.20
ALTICE USA INC- A	4,447	26.61	118,334.67
AMC ENTERTAINMENT HLDS-CL A	9,418	47.30	445,471.40
CABLE ONE INC	110	1,908.16	209,897.60
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	2,464	761.86	1,877,223.04
COMCAST CORP-CLASS A	84,450	55.59	4,694,575.50
DISCOVERY INC - A	1,722	26.26	45,219.72
DISCOVERY INC-C	3,336	25.29	84,367.44
DISH NETWORK CORP-A	3,674	42.00	154,308.00
ELECTRONIC ARTS INC	5,533	145.37	804,332.21
FACEBOOK INC-A	43,885	376.53	16,524,019.05
FOX CORP - CLASS A	6,194	35.30	218,648.20
FOX CORP- CLASS B	1,836	32.84	60,294.24
IAC/INTERACTIVECORP	1,126	132.57	149,273.82

INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	5,874	37.02	217,455.48
LIBERTY BROADBAND-A	223	172.94	38,565.62
LIBERTY BROADBAND-C	2,679	177.62	475,843.98
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	3,916	49.48	193,763.68
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	1,757	47.75	83,896.75
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	946	48.15	45,549.90
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	2,455	88.68	217,709.40
MATCH GROUP INC	4,936	157.36	776,728.96
NETFLIX INC	8,169	577.76	4,719,721.44
NEWS CORP - CLASS A	5,861	22.01	129,000.61
OMNICOM GROUP	3,237	72.46	234,553.02
PINTEREST INC- CLASS A	10,741	54.43	584,632.63
ROKU INC	2,074	316.76	656,960.24
SEA LTD-ADR	1,252	333.55	417,604.60
SIRIUS XM HOLDINGS INC	10,387	6.03	62,633.61
SNAP INC - A	17,919	71.31	1,277,803.89
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	2,134	152.15	324,688.10
TWITTER INC	15,236	60.19	917,054.84
VIACOMCBS INC - CLASS B	12,080	38.92	470,153.60
WALT DISNEY CO/THE	33,416	182.40	6,095,078.40
ZILLOW GROUP INC - A	904	92.21	83,357.84
ZILLOW GROUP INC - C	2,694	91.90	247,578.60
ADVANCE AUTO PARTS INC	937	201.17	188,496.29
AMAZON.COM INC	8,301	3,450.00	28,638,450.00
AUTOZONE INC	373	1,563.77	583,286.21
BATH & BODY WORKS INC	4,700	63.41	298,027.00
BEST BUY CO INC	3,865	110.17	425,807.05
BURLINGTON STORES INC	1,107	290.43	321,506.01
CARMAX INC	2,885	135.00	389,475.00
CARVANA CO	1,176	329.07	386,986.32
CHEWY INC - CLASS A	1,090	72.22	78,719.80
DOLLAR GENERAL CORP	4,442	216.29	960,760.18
DOLLAR TREE INC	3,916	88.43	346,291.88
DOORDASH INC - A	1,355	203.33	275,512.15
EBAY INC	12,828	71.39	915,790.92

ETSY INC	2,096	214.31	449,193.76
GENUINE PARTS CO	2,564	120.00	307,680.00
HOME DEPOT INC	19,510	333.12	6,499,171.20
LKQ CORP	4,394	51.11	224,577.34
LOWE'S COS INC	13,051	204.17	2,664,622.67
MERCADOLIBRE INC	835	1,856.34	1,550,043.90
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1,321	590.85	780,512.85
POOL CORP	783	474.68	371,674.44
ROSS STORES INC	6,761	112.42	760,071.62
TARGET CORP	9,152	242.24	2,216,980.48
TJX COMPANIES INC	22,436	69.48	1,558,853.28
TRACTOR SUPPLY COMPANY	2,120	205.26	435,151.20
ULTA BEAUTY INC	950	373.73	355,043.50
WAYFAIR INC- CLASS A	1,439	266.37	383,306.43
COSTCO WHOLESALE CORP	8,153	458.41	3,737,416.73
KROGER CO	13,182	41.79	550,875.78
SYSCO CORP	9,754	75.78	739,158.12
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	14,055	48.22	677,732.10
WALMART INC	28,487	144.30	4,110,674.10
ALTRIA GROUP INC	34,528	48.37	1,670,119.36
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	10,811	60.38	652,768.18
BOSTON BEER COMPANY INC-A	139	531.01	73,810.39
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,282	70.89	374,440.98
BUNGE LTD	2,145	76.98	165,122.10
CAMPBELL SOUP CO	3,976	43.36	172,399.36
COCA-COLA CO/THE	75,491	55.69	4,204,093.79
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE	4,239	58.45	247,769.55
CONAGRA BRANDS INC	8,705	33.19	288,918.95
CONSTELLATION BRANDS INC-A	3,278	215.59	706,704.02
GENERAL MILLS INC	10,536	58.77	619,200.72
HERSHEY CO/THE	2,482	174.55	433,233.10
HORMEL FOODS CORP	4,355	42.41	184,695.55
JM SMUCKER CO/THE	1,878	122.46	229,979.88
KELLOGG CO	4,596	63.68	292,673.28
KEURIG DR PEPPER INC	13,149	35.02	460,477.98

KRAFT HEINZ CO/THE	11,371	36.21	411,743.91
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,135	60.88	129,978.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	4,263	85.08	362,696.04
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	2,795	46.58	130,191.10
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	26,266	60.35	1,585,153.10
MONSTER BEVERAGE CORP	6,813	94.96	646,962.48
PEPSICO INC	25,477	155.15	3,952,756.55
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	28,825	101.96	2,938,997.00
TYSON FOODS INC-CL A	5,049	75.43	380,846.07
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,186	83.71	350,410.06
CLOROX COMPANY	2,061	172.24	354,986.64
COLGATE-PALMOLIVE CO	13,947	77.30	1,078,103.10
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	4,311	330.82	1,426,165.02
KIMBERLY-CLARK CORP	6,347	138.12	876,647.64
PROCTER & GAMBLE CO/THE	44,905	145.43	6,530,534.15
ABBOTT LABORATORIES	32,672	127.05	4,150,977.60
ABIOMED INC	756	353.53	267,268.68
ALIGN TECHNOLOGY INC	1,331	706.45	940,284.95
AMERISOURCEBERGEN CORP	2,999	123.09	369,146.91
ANTHEM INC	4,548	366.47	1,666,705.56
BAXTER INTERNATIONAL INC	9,517	81.77	778,205.09
BECTON DICKINSON AND CO	5,101	260.45	1,328,555.45
BOSTON SCIENTIFIC CORP	25,011	44.85	1,121,743.35
CARDINAL HEALTH INC	4,308	52.13	224,576.04
CENTENE CORP	11,094	60.80	674,515.20
CERNER CORP	5,093	73.92	376,474.56
CIGNA CORP	6,400	203.65	1,303,360.00
COOPER COS INC/THE	912	441.47	402,620.64
CVS HEALTH CORP	24,374	83.89	2,044,734.86
DANAHER CORP	11,810	324.09	3,827,502.90
DAVITA INC	1,175	122.33	143,737.75
DENTSPLY SIRONA INC	4,622	61.83	285,778.26
DEXCOM INC	1,815	542.23	984,147.45
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	11,579	120.94	1,400,364.26
HCA HEALTHCARE INC	4,736	254.67	1,206,117.12

HENRY SCHEIN INC	2,103	78.44	164,959.32
HOLOGIC INC	4,988	78.05	389,313.40
HUMANA INC	2,285	401.99	918,547.15
IDEXX LABORATORIES INC	1,506	661.39	996,053.34
INSULET CORP	1,229	294.29	361,682.41
INTUITIVE SURGICAL INC	2,190	1,039.01	2,275,431.90
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,615	296.80	479,332.00
MASIMO CORP	1,017	271.62	276,237.54
MCKESSON CORP	2,622	203.99	534,861.78
MEDTRONIC PLC	24,835	130.58	3,242,954.30
MOLINA HEALTHCARE INC	1,137	262.05	297,950.85
NOVOCURE LTD	1,677	126.07	211,419.39
OAK STREET HEALTH INC	1,457	51.68	75,297.76
QUEST DIAGNOSTICS INC	2,543	154.81	393,681.83
RESMED INC	2,749	292.28	803,477.72
STERIS PLC	1,666	215.94	359,756.04
STRYKER CORP	6,293	275.26	1,732,211.18
TELADOC HEALTH INC	2,707	133.72	361,980.04
TELEFLEX INC	849	387.34	328,851.66
UNITEDHEALTH GROUP INC	17,309	412.54	7,140,654.86
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,562	146.82	229,332.84
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	2,458	299.01	734,966.58
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	1,407	452.06	636,048.42
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	3,999	147.68	590,572.32
10X GENOMICS INC-CLASS A	1,307	155.67	203,460.69
ABBVIE INC	32,533	106.48	3,464,113.84
AGILENT TECHNOLOGIES INC	5,725	172.42	987,104.50
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	2,148	187.97	403,759.56
AMGEN INC	10,629	216.04	2,296,289.16
AVANTOR INC	8,797	42.01	369,561.97
BIO-RAD LABORATORIES-A	375	802.89	301,083.75
BIO-TECHNE CORP	759	509.89	387,006.51
BIOGEN INC	2,844	295.95	841,681.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,634	76.17	200,631.78
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	41,260	62.11	2,562,658.60

CATALENT INC	2,865	138.15	395,799.75
CHARLES RIVER LABORATORIES	981	436.24	427,951.44
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	7,588	32.92	249,796.96
ELI LILLY & CO	15,011	233.09	3,498,913.99
EXACT SCIENCES CORP	3,021	97.06	293,218.26
GILEAD SCIENCES INC	23,309	70.45	1,642,119.05
HORIZON THERAPEUTICS PLC	4,161	106.17	441,773.37
ILLUMINA INC	2,556	448.85	1,147,260.60
INCYTE CORP	2,513	72.24	181,539.12
IQVIA HOLDINGS INC	3,609	257.55	929,497.95
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	753	134.94	101,609.82
JOHNSON & JOHNSON	48,283	164.80	7,957,038.40
MERCK & CO. INC.	46,645	72.11	3,363,570.95
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	443	1,559.44	690,831.92
MODERNA INC	6,298	427.71	2,693,717.58
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	1,875	94.62	177,412.50
NOVAVAX INC	1,081	234.29	253,267.49
PERKINELMER INC	2,057	183.38	377,212.66
PFIZER INC	102,891	44.71	4,600,256.61
PPD INC	1,772	46.72	82,787.84
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,831	645.15	1,181,269.65
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	1,652	39.67	65,534.84
SEAGEN INC	2,657	150.46	399,772.22
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	20,942	9.06	189,734.52
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	7,230	562.40	4,066,152.00
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	4,878	188.41	919,063.98
VIATRIS INC	17,737	13.68	242,642.16
WATERS CORP	1,044	409.49	427,507.56
ZOETIS INC	8,810	203.55	1,793,275.50
BANK OF AMERICA CORP	141,487	39.84	5,636,842.08
CITIGROUP INC	38,098	68.78	2,620,380.44
CITIZENS FINANCIAL GROUP	7,501	42.77	320,817.77
FIFTH THIRD BANCORP	12,435	38.98	484,716.30
FIRST REPUBLIC BANK/CA	3,332	199.63	665,167.16
HUNTINGTON BANCSHARES INC	26,034	15.04	391,551.36

JPMORGAN CHASE & CO	55,456	157.07	8,710,473.92
KEYCORP	17,095	20.60	352,157.00
M & T BANK CORP	2,483	133.67	331,902.61
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	7,883	188.35	1,484,763.05
REGIONS FINANCIAL CORP	16,951	19.45	329,696.95
SVB FINANCIAL GROUP	1,059	584.44	618,921.96
TRUIST FINANCIAL CORP	24,988	54.63	1,365,094.44
US BANCORP	26,272	55.91	1,468,867.52
WELLS FARGO & CO	76,045	46.05	3,501,872.25
ALLY FINANCIAL INC	7,337	51.74	379,616.38
AMERICAN EXPRESS CO	12,690	159.48	2,023,801.20
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2,076	266.58	553,420.08
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	2,618	61.02	159,750.36
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	15,877	51.14	811,949.78
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	24,361	277.20	6,752,869.20
BLACKROCK INC	2,824	901.95	2,547,106.80
BLACKSTONE INC	12,766	130.60	1,667,239.60
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	7,945	154.39	1,226,628.55
CARLYLE GROUP INC/THE	2,700	49.12	132,624.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,956	124.23	242,993.88
CME GROUP INC	6,339	188.85	1,197,120.15
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5,853	120.34	704,350.02
EQUITABLE HOLDINGS INC	5,598	29.37	164,413.26
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	749	383.75	287,428.75
FRANKLIN RESOURCES INC	4,563	31.32	142,913.16
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	800	98.85	79,080.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	6,292	403.69	2,540,017.48
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	9,958	119.26	1,187,591.08
INVESCO LTD	5,927	24.95	147,878.65
KKR & CO INC	10,109	63.39	640,809.51
MARKETAXESS HOLDINGS INC	693	426.24	295,384.32
MOODY'S CORP	2,986	380.15	1,135,127.90
MORGAN STANLEY	25,825	101.91	2,631,825.75
MSCI INC	1,558	653.27	1,017,794.66
NASDAQ INC	2,170	195.55	424,343.50

NORTHERN TRUST CORP	3,716	110.13	409,243.08
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2,262	134.19	303,537.78
S&P GLOBAL INC	4,477	451.59	2,021,768.43
SCHWAB (CHARLES) CORP	26,890	69.73	1,875,039.70
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,736	59.21	102,788.56
STATE STREET CORP	5,873	86.57	508,425.61
SYNCHRONY FINANCIAL	9,758	47.68	465,261.44
T ROWE PRICE GROUP INC	4,302	212.88	915,809.76
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	1,530	84.72	129,621.60
VOYA FINANCIAL INC	1,741	62.94	109,578.54
AFLAC INC	12,418	54.29	674,173.22
ALLEGHANY CORP	197	619.57	122,055.29
ALLSTATE CORP	5,727	132.13	756,708.51
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,465	129.32	189,453.80
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	16,302	54.43	887,317.86
AON PLC	3,988	291.69	1,163,259.72
ARCH CAPITAL GROUP LTD	6,101	39.26	239,525.26
ARTHUR J GALLAGHER & CO	4,004	145.00	580,580.00
ASSURANT INC	896	165.81	148,565.76
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,286	68.45	156,476.70
BROWN & BROWN INC	4,086	56.10	229,224.60
CHUBB LTD	8,405	181.28	1,523,658.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,376	117.44	279,037.44
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	382	176.25	67,327.50
EVEREST RE GROUP LTD	550	253.91	139,650.50
FNF GROUP	4,754	46.37	220,442.98
GLOBE LIFE INC	1,521	92.12	140,114.52
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	6,544	70.12	458,865.28
JACKSON FINANCIAL INC-A W/I	1,081	26.00	28,106.00
LINCOLN NATIONAL CORP	3,341	65.57	219,069.37
LOEWS CORP	2,906	53.18	154,541.08
MARKEL CORP	207	1,227.96	254,187.72
MARSH & MCLENNAN COS	9,503	157.61	1,497,767.83
METLIFE INC	14,154	60.78	860,280.12
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	4,994	65.14	325,309.16

PROGRESSIVE CORP	10,386	93.20	967,975.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	7,526	103.72	780,596.72
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	562	144.44	81,175.28
TRAVELERS COS INC/THE	4,812	156.35	752,356.20
WILLIS TOWERS WATSON PLC	2,158	234.27	505,554.66
WR BERKLEY CORP	2,140	71.47	152,945.80
CBRE GROUP INC - A	5,718	96.46	551,558.28
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20,100	4.63	93,063.00
ACCENTURE PLC-CL A	11,720	340.72	3,993,238.40
ADOBE INC	8,789	645.01	5,668,992.89
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	2,900	111.92	324,568.00
ANSYS INC	1,690	369.07	623,728.30
AUTODESK INC	4,149	279.35	1,159,023.15
AUTOMATIC DATA PROCESSING	7,956	199.74	1,589,131.44
AVALARA INC	1,520	185.54	282,020.80
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	2,591	69.15	179,167.65
BLACK KNIGHT INC	3,383	74.00	250,342.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2,131	169.67	361,566.77
CADENCE DESIGN SYS INC	5,302	164.93	874,458.86
CERIDIAN HCM HOLDING INC	1,929	106.96	206,325.84
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1,664	116.34	193,589.76
CITRIX SYSTEMS INC	2,682	109.58	293,893.56
CLOUDFLARE INC - CLASS A	4,172	126.76	528,842.72
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	10,113	75.68	765,351.84
COUPA SOFTWARE INC	1,218	243.40	296,461.20
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	3,333	257.30	857,580.90
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	1,259	160.00	201,440.00
DATADOG INC - CLASS A	3,110	138.12	429,553.20
DOCUSIGN INC	3,419	267.98	916,223.62
DROPBOX INC-CLASS A	5,332	30.68	163,585.76
DYNATRACE INC	3,655	70.61	258,079.55
EPAM SYSTEMS INC	1,089	622.71	678,131.19
FAIR ISAAC CORP	571	439.27	250,823.17
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	11,624	123.42	1,434,634.08
FISERV INC	11,293	107.39	1,212,755.27

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1,410	255.75	360,607.50
FORTINET INC	2,653	300.58	797,438.74
GARTNER INC	1,494	310.60	464,036.40
GLOBAL PAYMENTS INC	5,612	162.11	909,761.32
GODADDY INC - CLASS A	3,327	74.21	246,896.67
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	1,578	119.98	189,328.44
HUBSPOT INC	774	671.83	519,996.42
INTL BUSINESS MACHINES CORP	16,591	136.22	2,260,026.02
INTUIT INC	5,057	568.27	2,873,741.39
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	1,284	167.11	214,569.24
MASTERCARD INC-CLASS A	16,268	345.80	5,625,474.40
MICROSOFT CORP	130,855	299.79	39,229,020.45
MONGODB INC	1,095	505.21	553,204.95
NORTONLIFELOCK INC	8,787	26.18	230,043.66
OKTA INC	2,109	253.29	534,188.61
ORACLE CORP	34,651	86.39	2,993,499.89
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	27,325	26.26	717,554.50
PALO ALTO NETWORKS INC	1,857	484.83	900,329.31
PAYCHEX INC	6,255	109.66	685,923.30
PAYCOM SOFTWARE INC	910	468.02	425,898.20
PAYPAL HOLDINGS INC	20,518	282.24	5,791,000.32
PTC INC	1,603	122.44	196,271.32
RINGCENTRAL INC-CLASS A	1,270	217.44	276,148.80
SALESFORCE.COM INC	17,892	254.37	4,551,188.04
SERVICENOW INC	3,664	645.42	2,364,818.88
SNOWFLAKE INC-CLASS A	3,384	319.25	1,080,342.00
SPLUNK INC	2,723	150.49	409,784.27
SQUARE INC - A	7,309	247.05	1,805,688.45
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	4,126	71.34	294,348.84
SYNOPSYS INC	2,897	332.59	963,513.23
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	8,378	70.83	593,413.74
TWILIO INC - A	2,853	337.00	961,461.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	748	467.97	350,041.56
UNITY SOFTWARE INC	839	131.73	110,521.47
VERISIGN INC	1,710	221.95	379,534.50

VISA INC-CLASS A SHARES	31,073	223.03	6,930,211.19
VMWARE INC-CLASS A	1,126	139.96	157,594.96
WESTERN UNION CO	5,513	21.07	116,158.91
WIX.COM LTD	998	214.78	214,350.44
WORKDAY INC-CLASS A	3,335	269.78	899,716.30
ZENDESK INC	1,677	115.50	193,693.50
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	4,006	281.44	1,127,448.64
ZSCALER INC	1,359	275.80	374,812.20
AMPHENOL CORP-CL A	11,321	75.73	857,339.33
APPLE INC	305,110	148.12	45,192,893.20
ARISTA NETWORKS INC	1,021	357.76	365,272.96
ARROW ELECTRONICS INC	902	112.23	101,231.46
CDW CORP/DE	2,596	193.48	502,274.08
CISCO SYSTEMS INC	77,523	57.87	4,486,256.01
COGNEX CORP	2,959	88.05	260,539.95
CORNING INC	14,801	38.26	566,286.26
DELL TECHNOLOGIES -C	5,156	97.44	502,400.64
F5 NETWORKS INC	916	202.05	185,077.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	24,541	13.75	337,438.75
HP INC	22,784	27.56	627,927.04
IPG PHOTONICS CORP	558	173.18	96,634.44
JUNIPER NETWORKS INC	4,533	27.99	126,878.67
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	3,086	178.17	549,832.62
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3,225	240.81	776,612.25
NETAPP INC	4,369	92.19	402,778.11
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	3,159	82.73	261,344.07
TE CONNECTIVITY LTD	6,242	144.74	903,467.08
TRIMBLE INC	4,462	91.31	407,425.22
WESTERN DIGITAL CORP	5,145	57.54	296,043.30
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	934	576.79	538,721.86
AT&T INC	131,946	27.33	3,606,084.18
LIBERTY GLOBAL PLC-A	1,306	28.51	37,234.06
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	6,233	28.60	178,263.80
LUMEN TECHNOLOGIES INC	20,471	12.50	255,887.50
T-MOBILE US INC	11,700	128.92	1,508,364.00

VERIZON COMMUNICATIONS INC	76,391	54.41	4,156,434.31
AES CORP	13,306	23.82	316,948.92
ALLIANT ENERGY CORP	3,704	59.28	219,573.12
AMEREN CORPORATION	4,330	85.93	372,076.90
AMERICAN ELECTRIC POWER	9,559	87.83	839,566.97
AMERICAN WATER WORKS CO INC	3,521	184.88	650,962.48
ATMOS ENERGY CORP	2,000	91.28	182,560.00
CENTERPOINT ENERGY INC	9,913	25.66	254,367.58
CMS ENERGY CORP	5,193	63.18	328,093.74
CONSOLIDATED EDISON INC	5,799	74.19	430,227.81
DOMINION ENERGY INC	14,281	76.15	1,087,498.15
DTE ENERGY COMPANY	3,309	117.42	388,542.78
DUKE ENERGY CORP	14,423	101.61	1,465,521.03
EDISON INTERNATIONAL	6,481	58.48	379,008.88
ENERGY CORP	3,422	114.39	391,442.58
ESSENTIAL UTILITIES INC	3,982	47.62	189,622.84
EVERGY INC	3,540	65.76	232,790.40
EVERSOURCE ENERGY	6,304	86.97	548,258.88
EXELON CORP	18,615	50.38	937,823.70
FIRSTENERGY CORP	10,241	37.45	383,525.45
NEXTERA ENERGY INC	36,285	84.64	3,071,162.40
NISOURCE INC	7,043	24.31	171,215.33
NRG ENERGY INC	5,306	43.89	232,880.34
P G & E CORP	21,589	9.80	211,572.20
PINNACLE WEST CAPITAL	1,526	74.00	112,924.00
PPL CORP	13,143	29.38	386,141.34
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	9,840	62.57	615,688.80
SEMPRA ENERGY	6,074	133.83	812,883.42
SOUTHERN CO/THE	19,916	65.97	1,313,858.52
UGI CORP	3,091	43.84	135,509.44
VISTRA CORP	9,405	18.00	169,290.00
WEC ENERGY GROUP INC	6,164	93.42	575,840.88
XCEL ENERGY INC	9,302	66.11	614,955.22
ADVANCED MICRO DEVICES	22,341	105.73	2,362,113.93
ANALOG DEVICES INC	9,915	173.47	1,719,955.05

	APPLIED MATERIALS INC	16,875	140.14	2,364,862.50	
	BROADCOM INC	7,490	501.87	3,759,006.30	
	ENPHASE ENERGY INC	2,171	157.95	342,909.45	
	INTEL CORP	74,055	54.52	4,037,478.60	
	KLA CORP	2,843	356.39	1,013,216.77	
	LAM RESEARCH CORP	2,631	603.50	1,587,808.50	
	MARVELL TECHNOLOGY INC	14,361	62.30	894,690.30	
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	5,092	160.65	818,029.80	
	MICRON TECHNOLOGY INC	20,691	73.49	1,520,581.59	
	MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	786	495.46	389,431.56	
	NVIDIA CORP	45,598	222.42	10,141,907.16	
	NXP SEMICONDUCTORS NV	5,108	211.48	1,080,239.84	
	ON SEMICONDUCTOR CORP	7,719	47.85	369,354.15	
	QORVO INC	2,035	182.13	370,634.55	
	QUALCOMM INC	20,714	141.14	2,923,573.96	
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	2,703	178.13	481,485.39	
	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	716	272.51	195,117.16	
	TERADYNE INC	2,952	122.32	361,088.64	
	TEXAS INSTRUMENTS INC	16,952	195.11	3,307,504.72	
	XILINX INC	4,587	155.58	713,645.46	
	米ドル 小計	5,676,738		720,570,225.23	(79,010,525,196)
カナダドル	CAMECO CORP	10,536	30.84	324,930.24	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	22,486	43.16	970,495.76	
	CENOVUS ENERGY INC	22,038	10.83	238,671.54	
	ENBRIDGE INC	37,716	50.50	1,904,658.00	
	IMPERIAL OIL LTD	2,877	35.34	101,673.18	
	INTER PIPELINE LTD	1,832	19.99	36,621.68	
	KEYERA CORP	5,630	32.41	182,468.30	
	PARKLAND CORP	1,790	36.43	65,209.70	
	PEMBINA PIPELINE CORP	8,636	39.58	341,812.88	
	SUNCOR ENERGY INC	25,615	23.58	604,001.70	
	TC ENERGY CORP	17,347	62.22	1,079,330.34	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	4,733	70.73	334,765.09	
	B2GOLD CORP	10,119	4.85	49,077.15	

BARRICK GOLD CORP	29,830	24.73	737,695.90
CCL INDUSTRIES INC - CL B	3,104	72.30	224,419.20
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	13,002	23.93	311,137.86
FRANCO-NEVADA CORP	3,254	179.35	583,604.90
IVANHOE MINES LTD-CL A	10,359	9.26	95,924.34
KINROSS GOLD CORP	19,092	7.40	141,280.80
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	5,057	54.42	275,201.94
LUNDIN MINING CORP	16,915	9.42	159,339.30
NUTRIEN LTD	9,609	77.42	743,928.78
PAN AMERICAN SILVER CORP	5,353	32.97	176,488.41
TECK RESOURCES LTD-CLS B	11,267	32.67	368,092.89
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,321	96.86	224,812.06
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	7,886	56.60	446,347.60
YAMANA GOLD INC	9,288	5.38	49,969.44
BALLARD POWER SYSTEMS INC	2,674	19.69	52,651.06
CAE INC	5,971	38.47	229,704.37
TOROMONT INDUSTRIES LTD	1,416	102.92	145,734.72
WSP GLOBAL INC	1,908	161.05	307,283.40
GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT	3,135	46.01	144,241.35
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	1,809	80.26	145,190.34
THOMSON REUTERS CORP	3,467	150.35	521,263.45
AIR CANADA	840	22.87	19,210.80
CANADIAN NATL RAILWAY CO	13,262	145.73	1,932,671.26
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	12,673	86.48	1,095,961.04
MAGNA INTERNATIONAL INC	5,409	100.14	541,657.26
GILDAN ACTIVEWEAR INC	3,788	48.85	185,043.80
RESTAURANT BRANDS INTERN	5,299	82.01	434,570.99
QUEBECOR INC -CL B	4,598	31.13	143,135.74
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	8,702	36.37	316,491.74
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	933	196.02	182,886.66
DOLLARAMA INC	5,287	56.12	296,706.44
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	14,242	50.35	717,084.70
EMPIRE CO LTD 'A'	2,628	38.34	100,757.52
LOBLAW COMPANIES LTD	3,243	87.63	284,184.09
METRO INC	5,800	61.90	359,020.00

WESTON (GEORGE) LTD	1,578	134.83	212,761.74
SAPUTO INC	3,667	34.46	126,364.82
BAUSCH HEALTH COS INC	6,138	36.40	223,423.20
CANOPY GROWTH CORP	3,659	18.57	67,947.63
BANK OF MONTREAL	12,016	127.48	1,531,799.68
BANK OF NOVA SCOTIA	22,473	77.69	1,745,927.37
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8,353	145.68	1,216,865.04
NATIONAL BANK OF CANADA	5,646	98.35	555,284.10
ROYAL BANK OF CANADA	26,218	128.43	3,367,177.74
TORONTO-DOMINION BANK	33,529	81.76	2,741,331.04
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	22,532	70.01	1,577,465.32
IGM FINANCIAL INC	81	47.59	3,854.79
ONEX CORPORATION	908	92.78	84,244.24
TMX GROUP LTD	1,457	139.87	203,790.59
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	456	544.26	248,182.56
GREAT-WEST LIFECO INC	4,328	39.24	169,830.72
IA FINANCIAL CORP INC	2,752	71.51	196,795.52
INTACT FINANCIAL CORP	3,439	173.67	597,251.13
MANULIFE FINANCIAL CORP	37,068	24.54	909,648.72
POWER CORP OF CANADA	10,869	43.86	476,714.34
SUN LIFE FINANCIAL INC	9,990	65.40	653,346.00
FIRSTSERVICE CORP	671	231.58	155,390.18
BLACKBERRY LTD	7,347	12.74	93,600.78
CGI INC	4,409	113.63	500,994.67
CONSTELLATION SOFTWARE INC	341	2,184.42	744,887.22
LIGHTSPEED COMMERCE INC	1,593	151.45	241,259.85
NUVEI CORP-SUBORDINATE VTG	829	163.69	135,699.01
OPEN TEXT CORP	4,289	66.83	286,633.87
SHOPIFY INC - CLASS A	2,083	1,838.94	3,830,512.02
BCE INC	2,440	65.15	158,966.00
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	7,251	59.91	434,407.41
TELUS CORP	4,085	28.97	118,342.45
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	14,058	19.52	274,412.16
ALTAGAS LTD	7,212	25.94	187,079.28
ATCO LTD -CLASS I	863	41.11	35,477.93

	BROOKFIELD RENEWABLE COR-A	2,056	53.79	110,592.24
	CANADIAN UTILITIES LTD-A	987	35.12	34,663.44
	EMERA INC	5,745	59.34	340,908.30
	FORTIS INC	8,232	58.36	480,419.52
	HYDRO ONE LTD	4,991	31.50	157,216.50
	NORTHLAND POWER INC	3,252	41.11	133,689.72
	カナダドル 小計	724,667		44,292,568.55 (3,825,106,219)
ユーロ	ENI SPA	42,914	10.90	467,934.25
	GALP ENERGIA SGPS SA	7,410	8.22	60,910.20
	NESTE OYJ	7,057	53.44	377,126.08
	OMV AG	2,574	48.96	126,023.04
	REPSOL SA	29,384	9.84	289,138.56
	TENARIS SA	5,062	8.52	43,168.73
	TOTALENERGIES SE	46,471	37.84	1,758,694.99
	VOPAK	762	35.06	26,715.72
	AIR LIQUIDE SA	8,863	149.06	1,321,118.78
	AKZO NOBEL	3,222	101.00	325,422.00
	ARCELORMITTAL	12,348	27.52	339,816.96
	ARKEMA	1,450	115.55	167,547.50
	BASF SE	17,246	65.57	1,130,820.22
	COVESTRO AG	4,092	58.94	241,182.48
	CRH PLC	14,992	43.75	655,900.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	3,922	27.93	109,541.46
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	1,085	42.52	46,134.20
	HEIDELBERGCEMENT AG	2,164	69.28	149,921.92
	KONINKLIJKE DSM NV	3,370	184.95	623,281.50
	LANXESS AG	1,915	64.22	122,981.30
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,976	48.37	192,319.12
	SOLVAY SA	1,489	109.45	162,971.05
	STORA ENSO OYJ-R SHS	8,716	16.04	139,848.22
	SYMRISE AG	2,370	119.75	283,807.50
	UMICORE	3,883	52.34	203,236.22
	UPM-KYMMENE OYJ	9,909	33.24	329,375.16
	VOESTALPINE AG	2,425	35.84	86,912.00

ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	6,034	23.35	140,893.90
AIRBUS SE	11,039	112.76	1,244,757.64
ALSTOM	5,811	31.69	184,150.59
BOUYGUES SA	3,499	36.04	126,103.96
BRENTAG SE	2,419	88.34	213,694.46
CNH INDUSTRIAL NV	16,278	13.81	224,799.18
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN	9,746	61.26	597,039.96
DASSAULT AVIATION SA	11	918.50	10,103.50
EIFFAGE	2,126	87.88	186,832.88
FERROVIAL SA	7,014	24.92	174,788.88
GEA GROUP AG	3,473	41.01	142,427.73
KINGSPAN GROUP PLC	2,977	97.98	291,686.46
KION GROUP AG	740	87.04	64,409.60
KNORR-BREMSE AG	1,136	105.70	120,075.20
KONE OYJ-B	5,617	65.32	366,902.44
LEGRAND SA	5,201	97.66	507,929.66
MTU AERO ENGINES AG	1,209	188.85	228,319.65
PRYSMIAN SPA	4,594	32.81	150,729.14
RATIONAL AG	80	918.60	73,488.00
SAFRAN SA	6,537	103.66	677,625.42
SCHNEIDER ELECTRIC SE	10,043	154.66	1,553,250.38
SIEMENS AG-REG	14,180	147.46	2,090,982.80
SIEMENS ENERGY AG	7,711	23.12	178,278.32
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY, S.A .	4,128	23.35	96,388.80
THALES SA	1,768	83.16	147,026.88
VINCI SA	9,484	88.82	842,368.88
WARTSILA OYJ ABP	8,128	11.36	92,374.72
BUREAU VERITAS SA	4,564	28.44	129,800.16
RANDSTAD NV	1,871	59.96	112,185.16
TELEPERFORMANCE	1,061	376.10	399,042.10
WOLTERS KLUWER	5,268	96.92	510,574.56
ADP	314	97.64	30,658.96
AENA SME SA	1,497	132.30	198,053.10
ATLANTIA SPA	8,066	15.69	126,595.87
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,407	7.99	11,244.74

DEUTSCHE POST AG-REG	18,695	59.21	1,106,930.95
GETLINK	9,276	13.86	128,565.36
INPOST SA	3,195	15.42	49,279.68
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	6,483	82.27	533,356.41
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PRF	619	67.90	42,030.10
CONTINENTAL AG	1,647	112.70	185,616.90
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	16,135	72.50	1,169,787.50
FAURECIA	1,292	39.75	51,357.00
FERRARI NV	2,520	187.80	473,256.00
MICHELIN (CGDE)	3,355	136.65	458,460.75
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PRF	2,399	87.10	208,952.90
RENAULT SA	3,099	29.83	92,443.17
STELLANTIS NV	39,516	16.95	669,875.23
VALEO SA	3,692	22.65	83,623.80
VOLKSWAGEN AG	462	281.00	129,822.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	3,567	196.92	702,413.64
ADIDAS AG	3,605	293.50	1,058,067.50
ESSILORLUXOTTICA	5,113	170.18	870,130.34
HERMES INTERNATIONAL	608	1,269.50	771,856.00
KERING	1,339	658.30	881,463.70
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	5,131	646.80	3,318,730.80
MONCLER SPA	3,302	54.60	180,289.20
PUMA SE	1,586	103.90	164,785.40
SEB SA	609	131.30	79,961.70
ACCOR SA	2,330	28.72	66,917.60
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	2,798	170.75	477,758.50
LA FRANCAISE DES JEUX SAEM	2,369	44.23	104,780.87
SODEXO	2,086	71.28	148,690.08
BOLLORE	14,850	5.13	76,180.50
PUBLICIS GROUPE	3,613	56.26	203,267.38
SCOUT24 AG	1,621	69.34	112,400.14
UBISOFT ENTERTAINMENT	2,377	55.92	132,921.84
VIVENDI	14,144	32.53	460,104.32
DELIVERY HERO SE	2,979	126.70	377,439.30
HELLOFRESH SE	3,031	88.80	269,152.80

INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	20,744	30.18	626,053.92
JUST EAT TAKEAWAY	3,517	77.53	272,673.01
PROSUS NV	17,420	71.13	1,239,084.60
ZALANDO SE	4,318	95.06	410,469.08
CARREFOUR SA	10,978	15.04	165,109.12
COLRUYT SA	290	47.72	13,838.80
JERONIMO MARTINS	5,217	17.80	92,888.68
KESKO OYJ-B SHS	4,478	32.84	147,057.52
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N.V.	20,196	28.15	568,517.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	14,916	48.64	725,514.24
DANONE	12,509	60.10	751,790.90
DAVIDE CAMPARI-MILANO NV	9,014	11.92	107,491.95
HEINEKEN HOLDING NV	1,820	75.30	137,046.00
HEINEKEN NV	5,123	89.78	459,942.94
JDE PEET'S BV	1,184	27.83	32,950.72
KERRY GROUP PLC-A	2,701	122.15	329,927.15
PERNOD RICARD SA	4,009	189.60	760,106.40
REMY COINTREAU	264	168.30	44,431.20
BEIERSDORF AG	1,716	105.25	180,609.00
HENKEL AG & CO KGAA	1,562	72.50	113,245.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	3,219	78.66	253,206.54
L'OREAL	4,672	398.60	1,862,259.20
AMPLIFON SPA	2,059	42.68	87,878.12
BIOMERIEUX	402	112.70	45,305.40
CARL ZEISS MEDITEC AG - BR	630	197.80	124,614.00
DIASORIN SPA	629	201.80	126,932.20
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3,878	62.00	240,436.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	7,128	42.02	299,554.20
KONINKLIJKE PHILIPS NV	17,312	39.79	688,931.04
ORPEA	1,093	104.70	114,437.10
SARTORIUS AG-VORZUG	502	565.80	284,031.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	4,667	57.46	268,165.82
ARGENX SE	902	276.40	249,312.80
BAYER AG-REG	18,523	45.95	851,224.46
EUROFINS SCIENTIFIC	2,149	123.40	265,186.60

GRIFOLS SA	3,329	21.17	70,474.93
IPSEN	158	80.42	12,706.36
MERCK KGAA	2,192	199.70	437,742.40
ORION OYJ-CLASS B	2,696	34.30	92,472.80
QIAGEN N.V.	4,271	45.50	194,330.50
RECORDATI SPA	1,969	52.48	103,333.12
SANOFI	21,065	81.82	1,723,538.30
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	444	540.00	239,760.00
UCB SA	2,766	90.88	251,374.08
ABN AMRO BANK NV-CVA	3,806	11.77	44,827.06
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	125,466	5.58	700,100.28
BANCO SANTANDER SA	302,871	3.09	936,174.26
BNP PARIBAS	19,707	53.39	1,052,156.73
CAIXABANK S.A	78,740	2.59	204,094.08
COMMERZBANK AG	13,866	5.43	75,403.30
CREDIT AGRICOLE SA	21,999	11.82	260,028.18
ERSTE GROUP BANK AG	3,921	35.25	138,215.25
FINECOBANK SPA	11,008	15.37	169,192.96
ING GROEP NV-CVA	69,555	11.73	816,436.59
INTESA SANPAOLO	313,674	2.38	748,583.00
KBC GROEP NV	4,507	71.80	323,602.60
MEDIOBANCA SPA	14,465	9.78	141,554.49
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONA	4,422	21.28	94,100.16
SOCIETE GENERALE SA	14,646	26.26	384,603.96
UNICREDIT SPA	35,836	10.76	385,595.36
AMUNDI SA	618	75.85	46,875.30
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	35,265	10.92	385,375.92
DEUTSCHE BOERSE AG	3,691	140.00	516,740.00
EURAZEO	403	83.85	33,791.55
EXOR NV	2,224	70.10	155,902.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	1,979	95.40	188,796.60
SOFINA	168	353.80	59,438.40
WENDEL	294	120.30	35,368.20
AEGON NV	35,058	4.17	146,402.20
AGEAS	4,661	41.43	193,105.23

ALLIANZ SE-REG	7,695	193.64	1,490,059.80
ASSICURAZIONI GENERALI	20,419	17.60	359,374.40
AXA SA	36,748	23.25	854,574.74
CNP ASSURANCES	1,015	13.90	14,113.57
HANNOVER RUECK SE	1,152	160.60	185,011.20
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2,689	244.50	657,460.50
NN GROUP NV	4,060	44.10	179,046.00
POSTE ITALIANE SPA	11,160	11.56	129,009.60
SAMPO OYJ-A SHS	8,421	43.87	369,429.27
SCOR SE	4,228	26.48	111,957.44
AROUNDTOWN SA	20,993	6.26	131,416.18
DEUTSCHE WOHNEN SE	6,085	53.02	322,626.70
LEG IMMOBILIEN SE	1,515	127.00	192,405.00
VONOVIA SE	9,452	53.42	504,925.84
ADYEN NV	351	2,678.50	940,153.50
AMADEUS IT GROUP SA	7,648	51.04	390,353.92
ATOS SE	1,599	46.61	74,529.39
BECHTLE AG	1,242	64.12	79,637.04
CAPGEMINI SA	3,110	191.80	596,498.00
DASSAULT SYSTEMES SE	11,622	48.88	568,083.36
EDENRED	5,237	47.13	246,819.81
NEMETSCHKE SE	1,322	87.34	115,463.48
NEXI SPA	7,091	17.86	126,645.26
SAP SE	19,350	122.52	2,370,762.00
TEAMVIEWER AG	2,285	29.07	66,424.95
WORLDLINE SA	4,054	70.71	286,658.34
NOKIA OYJ	104,150	4.91	511,949.32
CELLNEX TELECOM SA	8,821	57.02	502,973.42
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	63,019	17.49	1,102,328.34
ELISA OYJ	3,342	54.46	182,005.32
ILIAD SA	98	182.00	17,836.00
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITAL	2,472	9.79	24,200.88
KONINKLIJKE KPN NV	58,946	2.79	164,989.85
ORANGE	34,597	9.39	325,038.81
PROXIMUS	918	16.73	15,362.73

	TELECOM ITALIA SPA	242,872	0.35	86,851.02	
	TELECOM ITALIA-RSP	71,459	0.38	27,218.73	
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	12,616	2.42	30,530.72	
	TELEFONICA SA	91,673	4.14	380,397.11	
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	766	35.37	27,093.42	
	E.ON SE	38,444	11.16	429,035.04	
	EDF	10,409	10.96	114,082.64	
	EDP RENOVAVEIS SA	6,378	22.80	145,418.40	
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	49,516	4.82	238,815.66	
	ELIA GROUP SA/NV	345	107.00	36,915.00	
	ENAGAS SA	6,522	18.82	122,744.04	
	ENDESA SA	4,803	19.41	93,226.23	
	ENEL SPA	154,114	7.43	1,145,837.59	
	ENGIE	31,335	11.98	375,581.31	
	FORTUM OYJ	9,445	27.05	255,487.25	
	IBERDROLA SA	111,424	10.08	1,123,153.92	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,648	21.84	101,512.32	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	8,634	17.12	147,814.08	
	RWE AG	11,090	33.58	372,402.20	
	SNAM SPA	32,585	4.98	162,273.30	
	SUEZ ENVIRONNEMENT CO	5,796	19.65	113,891.40	
	TERNA SPA	25,545	6.71	171,458.04	
	UNIPER SE	2,857	35.91	102,594.87	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	11,301	29.06	328,407.06	
	VERBUND AG	1,516	95.55	144,853.80	
	ASM INTERNATIONAL NV	888	374.60	332,644.80	
	ASML HOLDING NV	7,687	753.40	5,791,385.80	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	24,264	37.78	916,693.92	
	STMICROELECTRONICS NV	11,414	39.50	450,853.00	
	ユーロ 小計	3,452,278		90,149,818.09	(11,671,696,948)
英債券	BP PLC	376,730	3.00	1,130,190.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	76,366	14.50	1,107,307.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	69,142	14.51	1,003,388.70	
	ANGLO AMERICAN PLC	24,343	29.96	729,437.99	

ANTOFAGASTA PLC	4,320	14.27	61,668.00
BHP GROUP PLC	37,095	20.26	751,544.70
CRODA INTERNATIONAL PLC	2,193	92.08	201,931.44
EVRAZ PLC	3,072	5.85	17,995.77
GLENCORE PLC	188,830	3.35	634,279.97
JOHNSON MATTHEY PLC	3,139	27.63	86,730.57
MONDI PLC	7,876	19.51	153,700.14
RIO TINTO PLC	20,917	51.79	1,083,291.43
ASHTED GROUP PLC	8,555	58.60	501,323.00
BAE SYSTEMS PLC	55,064	5.51	303,733.02
BUNZL PLC	7,087	26.03	184,474.61
DCC PLC	1,401	62.00	86,862.00
FERGUSON PLC	3,775	105.75	399,206.25
MELROSE INDUSTRIES PLC	68,951	1.76	121,801.94
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	164,499	1.09	179,567.10
SMITHS GROUP PLC	6,986	14.14	98,816.97
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	1,204	164.05	197,516.20
EXPERIAN PLC	17,633	33.42	589,294.86
INTERTEK GROUP PLC	2,573	54.38	139,919.74
RELX PLC	34,385	21.94	754,406.90
RENTOKIL INITIAL PLC	29,565	5.95	176,089.14
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	20,488	6.86	140,547.68
BERKELEY GROUP HOLDINGS/THE	1,383	46.40	64,171.20
BURBERRY GROUP PLC	9,244	18.42	170,274.48
PERSIMMON PLC	5,194	27.71	143,925.74
TAYLOR WIMPEY PLC	77,500	1.68	130,587.50
COMPASS GROUP PLC	30,179	14.36	433,370.44
ENTAIN PLC	10,699	19.43	207,935.06
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	3,833	46.17	176,969.61
WHITBREAD PLC	2,921	32.85	95,954.85
AUTO TRADER GROUP PLC	20,378	6.19	126,139.82
INFORMA PLC	30,041	5.22	156,814.02
PEARSON PLC	13,772	7.36	101,472.09
WPP PLC	19,572	9.65	188,948.08
JD SPORTS FASHION PLC	4,960	11.51	57,089.60

KINGFISHER PLC	46,444	3.60	167,477.06
NEXT PLC	2,522	79.84	201,356.48
OCADO GROUP PLC	9,232	18.59	171,622.88
SAINSBURY (J) PLC	27,842	2.89	80,546.90
TESCO PLC	131,492	2.55	336,356.53
WM MORRISON SUPERMARKETS	42,443	2.91	123,678.90
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,974	19.13	95,177.49
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	40,721	26.59	1,082,771.39
COCA-COLA HBC AG-DI	3,818	24.55	93,731.90
DIAGEO PLC	43,404	35.09	1,523,046.36
IMPERIAL BRANDS PLC	18,836	15.25	287,343.18
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	13,308	58.21	774,658.68
UNILEVER PLC	48,263	40.07	1,934,139.72
NMC HEALTH PLC	438	0.00	0.00
SMITH & NEPHEW PLC	16,837	13.35	224,773.95
ASTRAZENECA PLC	28,522	81.30	2,318,838.60
GLAXOSMITHKLINE PLC	93,184	14.14	1,317,808.12
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	3,811	24.85	94,703.35
BARCLAYS PLC	318,366	1.80	576,051.44
HSBC HOLDINGS PLC	376,992	3.72	1,405,803.16
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,329,919	0.43	579,246.22
NATWEST GROUP PLC	106,419	2.08	221,457.93
STANDARD CHARTERED PLC	39,789	4.39	174,753.28
3I GROUP PLC	18,949	12.71	240,841.79
ABRDN PLC	32,937	2.58	85,142.14
HARGREAVES LANSDOWN PLC	5,595	14.33	80,204.32
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	6,283	81.06	509,299.98
M&G PLC	41,949	2.03	85,366.21
SCHRODERS PLC	2,782	38.01	105,743.82
ST JAMES'S PLACE PLC	11,459	16.17	185,292.03
ADMIRAL GROUP PLC	2,745	35.26	96,788.70
AVIVA PLC	74,601	4.04	301,761.04
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	19,597	3.05	59,810.04
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	104,259	2.77	289,735.76
PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC	8,750	6.44	56,367.50

	PRUDENTIAL PLC	49,279	14.51	715,284.68	
	AVEVA GROUP PLC	2,041	39.43	80,476.63	
	SAGE GROUP PLC/THE	24,193	7.41	179,270.13	
	HALMA PLC	6,704	30.61	205,209.44	
	BT GROUP PLC	161,710	1.55	251,539.90	
	VODAFONE GROUP PLC	498,320	1.16	578,350.19	
	NATIONAL GRID PLC	67,631	9.66	653,518.35	
	SEVERN TRENT PLC	5,286	28.40	150,122.40	
	SSE PLC	18,204	16.59	302,004.36	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	13,134	10.61	139,351.74	
	英ポンド 小計	5,389,849		32,025,502.28 (4,848,340,790)	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,849	18.91	53,874.59	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	78	959.00	74,802.00	
	GIVAUDAN-REG	178	4,546.00	809,188.00	
	HOLCIM LTD	10,443	48.29	504,292.47	
	SIKA AG-REG	2,720	327.60	891,072.00	
	ABB LTD-REG	30,902	33.93	1,048,504.86	
	GEBERIT AG-REG	731	764.80	559,068.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	215	274.60	59,039.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	707	288.00	203,616.00	
	ADECCO SA-REG	2,354	47.47	111,744.38	
	SGS SA-REG	121	2,900.00	350,900.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	1,129	346.30	390,972.70	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	9,372	103.40	969,064.80	
	SWATCH GROUP AG/THE-BR	410	259.80	106,518.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	251	50.90	12,775.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	76	2,184.00	165,984.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	24	10,570.00	253,680.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	109,400.00	109,400.00	
	NESTLE SA-REG	53,034	114.56	6,075,575.04	
	ALCON INC	9,606	79.36	762,332.16	
	SONOVA HOLDING AG-REG	1,029	371.70	382,479.30	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	209	1,843.00	385,187.00	
	LONZA GROUP AG-REG	1,318	776.60	1,023,558.80	

	NOVARTIS AG-REG	41,050	78.80	3,234,740.00	
	ROCHE HOLDING AG-BR	604	393.00	237,372.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12,947	346.20	4,482,251.40	
	VIFOR PHARMA AG	638	126.10	80,451.80	
	BANQUE CANTONALE VAUDOIS-REG	273	72.50	19,792.50	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	51,105	9.66	493,674.30	
	JULIUS BAER GROUP LTD	3,569	63.22	225,632.18	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	401	1,591.50	638,191.50	
	UBS GROUP AG-REG	65,676	15.31	1,005,827.94	
	BALOISE HOLDING AG - REG	658	143.60	94,488.80	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	675	476.90	321,907.50	
	SWISS RE AG	5,123	82.46	422,442.58	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	2,680	399.00	1,069,320.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	1,117	94.30	105,333.10	
	TEMENOS GROUP AG-REG	1,169	139.25	162,783.25	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	2,949	91.50	269,833.50	
	SWISSCOM AG-REG	414	532.60	220,496.40	
	スイスフラン 小計	318,805		28,388,168.55	(3,383,869,691)
スウェーデン ローナ	LUNDIN ENERGY AB	3,230	282.20	911,506.00	
	BOLIDEN AB	4,039	297.00	1,199,583.00	
	SVENSKA CELLULOZA AB SCA-B	14,123	140.00	1,977,220.00	
	ALFA LAVAL AB	6,477	347.30	2,249,462.10	
	ASSA ABLOY AB-B	19,749	276.20	5,454,673.80	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	12,933	603.00	7,798,599.00	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	6,878	511.00	3,514,658.00	
	EPIROC AB-A	13,568	194.35	2,636,940.80	
	EPIROC AB-B	4,649	165.00	767,085.00	
	INVESTMENT AB LATOUR-B SHS	1,464	293.70	429,976.80	
	NIBE INDUSTRIER AB-B SHS	26,943	127.75	3,441,968.25	
	SANDVIK AB	19,332	217.20	4,198,910.40	
	SKANSKA AB-B SHS	7,676	241.40	1,852,986.40	
	SKF AB-B SHARES	7,216	210.50	1,518,968.00	
	VOLVO AB-A SHS	3,298	193.80	639,152.40	
VOLVO AB-B SHS	25,143	191.40	4,812,370.20		

SECURITAS AB-B SHS	3,833	138.05	529,145.65		
ELECTROLUX AB-SER B	3,653	206.50	754,344.50		
HUSQVARNA AB-B SHS	8,099	114.75	929,360.25		
EVOLUTION AB	3,009	1,400.80	4,215,007.20		
EMBRACER GROUP AB	4,198	190.20	798,459.60		
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	13,064	174.92	2,285,154.88		
ICA GRUPPEN AB	1,462	409.00	597,958.00		
SWEDISH MATCH AB	26,306	78.24	2,058,181.44		
ESSITY AKTIEBOLAG-B	10,496	270.70	2,841,267.20		
NORDEA BANK ABP	62,224	105.68	6,575,832.32		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	31,381	120.65	3,786,117.65		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	23,005	94.12	2,165,230.60		
SWEDBANK AB - A SHARES	17,971	167.58	3,011,580.18		
EQT AB	6,253	397.20	2,483,691.60		
INDUSTRIVARDEN AB-A SHS	1,714	297.40	509,743.60		
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,353	282.70	665,193.10		
INVESTOR AB-B SHS	35,316	202.40	7,147,958.40		
KINNEVIK AB - B	3,881	336.85	1,307,314.85		
LUNDBERGS AB-B SHS	920	520.20	478,584.00		
FASTIGHETS AB BALDER-B SHRS	1,583	576.80	913,074.40		
SINCH AB	7,260	188.35	1,367,421.00		
ERICSSON LM-B SHS	57,053	101.06	5,765,776.18		
HEXAGON AB-B SHS	38,529	150.70	5,806,320.30		
TELE2 AB-B SHS	7,424	129.75	963,264.00		
TELIA CO AB	49,229	37.04	1,823,688.30		
スウェーデンクローナ 小計	596,934		103,183,729.35 (1,313,528,874)		
ノルウェーク ローネ	EQUINOR ASA	17,989	201.55	3,625,682.95	
	NORSK HYDRO ASA	31,435	65.28	2,052,076.80	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,772	411.10	1,139,569.20	
	ADEVINTA ASA	3,943	157.95	622,796.85	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	2,287	388.40	888,270.80	
	SCHIBSTED ASA-CL A	1,165	436.20	508,173.00	
	MOWI ASA	8,760	232.60	2,037,576.00	
	ORKLA ASA	11,182	77.00	861,014.00	

	DNB BANK ASA	17,429	187.80	3,273,166.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,674	197.70	528,649.80	
	TELENOR ASA	13,825	146.50	2,025,362.50	
	ノルウェークローネ 小計	113,461		17,562,338.10 (222,514,823)	
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	2,044	555.60	1,135,646.40	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	3,334	471.20	1,570,980.80	
	ROCKWOOL INTL A/S-B SHS	129	3,389.00	437,181.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	19,622	259.80	5,097,795.60	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-A	67	18,360.00	1,230,120.00	
	AP MOELLER-MAERSK A/S-B	99	19,455.00	1,926,045.00	
	DSV PANALPINA A S	3,883	1,640.50	6,370,061.50	
	PANDORA A/S	2,390	855.00	2,043,450.00	
	CARLSBERG AS-B	2,072	1,019.50	2,112,404.00	
	AMBU A/S-B	1,526	217.90	332,515.40	
	COLOPLAST-B	2,245	1,102.00	2,473,990.00	
	DEMANT A/S	1,941	359.60	697,983.60	
	GN STORE NORD A/S	1,892	478.50	905,322.00	
	GENMAB A/S	1,125	2,780.00	3,127,500.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	31,194	631.40	19,695,891.60	
	DANSKE BANK A/S	9,894	105.10	1,039,859.40	
TRYG A/S	4,694	153.05	718,416.70		
ORSTED A/S	3,278	944.00	3,094,432.00		
	デンマーククローネ 小計	91,429		54,009,595.00 (940,307,048)	
オーストラリアドル	AMPOL LTD	3,012	28.04	84,456.48	
	OIL SEARCH LTD	32,812	3.94	129,279.28	
	SANTOS LTD	26,550	6.49	172,309.50	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	357	39.76	14,194.32	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	18,677	20.81	388,668.37	
	BHP GROUP LTD	54,645	41.73	2,280,335.85	
	BLUESCOPE STEEL LTD	10,589	24.07	254,877.23	
	EVOLUTION MINING LTD	46,650	3.93	183,334.50	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	29,242	18.08	528,695.36	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES-CDI	8,752	54.12	473,658.24	

NEWCREST MINING LTD	15,067	24.47	368,689.49
NORTHERN STAR RESOURCES LTD	14,877	9.58	142,521.66
ORICA LTD	6,263	12.58	78,788.54
RIO TINTO LTD	6,335	106.66	675,691.10
SOUTH32 LTD	111,236	3.41	379,314.76
REECE LTD	5,105	19.86	101,385.30
BRAMBLES LTD	27,700	11.24	311,348.00
AURIZON HOLDINGS LTD	23,036	3.86	88,918.96
QANTAS AIRWAYS LTD	8,700	5.43	47,241.00
SYDNEY AIRPORT	22,505	8.23	185,216.15
TRANSURBAN GROUP	47,822	13.82	660,900.04
ARISTOCRAT LEISURE LTD	9,109	47.42	431,948.78
CROWN RESORTS LTD	773	9.64	7,451.72
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	1,035	164.98	170,754.30
TABCORP HOLDINGS LTD	37,903	4.85	183,829.55
REA GROUP LTD	563	154.98	87,253.74
SEEK LTD	6,794	31.28	212,516.32
WESFARMERS LTD	21,199	56.75	1,203,043.25
COLES GROUP LTD	24,160	17.28	417,484.80
ENDEAVOUR GROUP LTD/AUSTRALI	16,961	6.58	111,603.38
WOOLWORTHS GROUP LTD	21,411	39.31	841,666.41
TREASURY WINE ESTATES LTD	16,613	12.28	204,007.64
COCHLEAR LTD	1,060	230.00	243,800.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	2,750	68.03	187,082.50
SONIC HEALTHCARE LTD	7,270	41.80	303,886.00
CSL LTD	8,408	300.68	2,528,117.44
AUST AND NZ BANKING GROUP	52,757	27.71	1,461,896.47
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	32,624	101.58	3,313,945.92
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	61,014	28.23	1,722,425.22
WESTPAC BANKING CORP	67,854	25.72	1,745,204.88
ASX LTD	4,596	83.34	383,030.64
MACQUARIE GROUP LTD	6,487	178.31	1,156,696.97
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,557	39.07	60,831.99
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	57,056	5.24	298,973.44
MEDIBANK PRIVATE LTD	63,743	3.55	226,287.65

	QBE INSURANCE GROUP LTD	34,356	11.97	411,241.32	
	SUNCORP GROUP LTD	27,697	12.72	352,305.84	
	LENDLEASE GROUP	17,548	11.25	197,415.00	
	AFTERPAY LTD	3,885	122.20	474,747.00	
	COMPUTERSHARE LTD	12,120	16.52	200,222.40	
	WISETECH GLOBAL LTD	1,600	49.89	79,824.00	
	XERO LTD	2,603	147.49	383,916.47	
	TELSTRA CORP LTD	72,361	3.96	286,549.56	
	AGL ENERGY LTD	7,599	6.32	48,025.68	
	APA GROUP	24,697	9.07	224,001.79	
	AUSNET SERVICES	1,437	1.98	2,845.26	
	ORIGIN ENERGY LTD	26,408	4.58	120,948.64	
	オーストラリアドル 小計	1,275,940		27,835,606.10	(2,232,415,609)
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	22,290	7.42	165,391.80	
	A2 MILK CO LTD	7,857	5.70	44,784.90	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	11,000	31.55	347,050.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,506	15.00	82,590.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	43,325	4.90	212,509.12	
	MERCURY NZ LTD	7,200	6.48	46,656.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	22,959	5.05	115,942.95	
	ニュージーランドドル 小計	120,137		1,014,924.77	(78,879,953)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48,500	54.60	2,648,100.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD	25,000	166.80	4,170,000.00	
	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	30,000	28.75	862,500.00	
	MTR CORP	32,000	43.55	1,393,600.00	
	SITC INTERNATIONAL HOLDINGS	31,000	33.70	1,044,700.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	41,000	48.95	2,006,950.00	
	SANDS CHINA LTD	50,200	24.95	1,252,490.00	
	SJM HOLDINGS LTD	2,000	7.04	14,080.00	
	WYNN MACAU LTD	5,200	9.01	46,852.00	
	CHOW TAI FOOK JEWELLERY GROU	33,800	16.04	542,152.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	22,000	18.50	407,000.00	
WH GROUP LTD	152,000	5.71	867,920.00		

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	69,000	23.80	1,642,200.00	
	HANG SENG BANK LTD	11,900	138.30	1,645,770.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	22,800	504.50	11,502,600.00	
	AIA GROUP LTD	225,000	93.65	21,071,250.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	40,000	48.95	1,958,000.00	
	ESR CAYMAN LTD	29,200	24.00	700,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	27,000	17.92	483,840.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	29,916	33.80	1,011,160.80	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	26,000	35.65	926,900.00	
	SINO LAND CO	58,000	11.06	641,480.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	24,700	107.90	2,665,130.00	
	SWIRE PACIFIC LTD - CL A	4,200	51.10	214,620.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	5,000	20.40	102,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	23,000	39.10	899,300.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD-SS	101,000	10.74	1,084,740.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD (CKI)	4,400	43.85	192,940.00	
	CLP HOLDINGS LTD	35,500	76.25	2,706,875.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	31,000	7.68	238,080.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	208,717	12.40	2,588,090.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	32,000	47.30	1,513,600.00	
	香港ドル 小計	1,481,033		69,045,720.60 (973,544,660)	
シンガポールド ル	KEPPEL CORP LTD	39,400	5.25	206,850.00	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	36,700	3.81	139,827.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	26,300	4.92	129,396.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	80,800	0.77	62,620.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	25,200	4.11	103,572.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	33,700	30.34	1,022,458.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	56,700	11.65	660,555.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	20,300	25.83	524,349.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	21,800	10.05	219,090.00	
	CAPITALAND LTD	49,800	4.00	199,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	3,000	7.11	21,330.00	
	UOL GROUP LTD	2,100	7.00	14,700.00	
	VENTURE CORP LTD	4,100	18.72	76,752.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	169,000	2.40	405,600.00	
	シンガポールドル 小計	568,900		3,786,299.00	(308,886,272)
イスラエルシ ケル	ICL GROUP LTD	12,922	23.00	297,206.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	381	475.00	180,975.00	
	BANK HAPOALIM BM	18,231	28.81	525,235.11	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	29,954	27.79	832,421.66	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	23,671	17.52	414,715.92	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,414	108.30	153,136.20	
	AZRIELI GROUP	234	302.70	70,831.80	
	NICE SYSTEMS LTD	960	951.60	913,536.00	
	イスラエルシケル 小計	87,767		3,388,057.69	(115,699,798)
	合 計	19,897,938		108,925,315,881	(108,925,315,881)

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

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

(2)株式以外の有価証券

種 類	通貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	8,437	134,401.41	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,746	547,689.70	
		AMERICAN TOWER CORP	8,434	2,499,837.60	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	25,521	220,501.44	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,369	531,343.01	
		BOSTON PROPERTIES INC	2,200	242,836.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	1,697	256,467.61	
		CROWN CASTLE INTL CORP	8,093	1,531,600.25	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	5,383	830,112.43	
		DUKE REALTY CORP	7,472	377,859.04	
		EQUINIX INC	1,681	1,403,450.09	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3,451	288,572.62	
		EQUITY RESIDENTIAL	6,281	513,660.18	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,187	385,134.02	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,391	438,891.96
	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	9,835	347,863.95
	HOST HOTELS & RESORTS INC	10,493	174,498.59
	INVITATION HOMES INC	9,853	399,834.74
	IRON MOUNTAIN INC	5,780	262,643.20
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	8,954	184,362.86
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,088	400,019.04
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4,711	152,824.84
	PROLOGIS INC	13,794	1,828,394.70
	PUBLIC STORAGE	2,992	949,720.64
	REALTY INCOME CORP	6,839	466,488.19
	REGENCY CENTERS CORP	2,658	179,441.58
	SBA COMMUNICATIONS CORP	2,103	749,866.71
	SIMON PROPERTY GROUP INC	6,292	815,191.52
	SUN COMMUNITIES INC	1,872	373,913.28
	UDR INC	5,162	275,960.52
	VENTAS INC	6,823	391,571.97
	VEREIT INC	3,546	169,817.94
	VICI PROPERTIES INC	10,702	320,203.84
	VORNADO REALTY TRUST	2,829	115,932.42
	WELLTOWER INC	8,056	705,222.24
	WEYERHAEUSER CO	12,823	437,136.07
	WP CAREY INC	3,546	270,240.66
	米ドル 小計	229,094	20,173,506.86 (2,212,025,027)
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	950	57,912.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,530	34,501.50
	カナダドル 小計	2,480	92,413.50 (7,980,829)
ユーロ	COVIVIO	522	39,609.36
	GECINA SA	1,073	133,266.60
	KLEPIERRE	3,496	67,263.04
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	2,281	152,462.04
	ユーロ 小計	7,372	392,601.04 (50,830,056)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	13,842	71,646.19

	LAND SECURITIES GROUP PLC	14,632	101,809.45	
	SEGRO PLC	23,845	304,500.65	
	英債券 小計	52,319	477,956.29 (72,357,802)	
オーストラリアドル	DEXUS/AU	23,352	251,501.04	
	GOODMAN GROUP	29,600	666,296.00	
	GPT GROUP	32,860	162,985.60	
	MIRVAC GROUP	63,099	191,820.96	
	SCENTRE GROUP	126,307	367,553.37	
	STOCKLAND	54,131	245,754.74	
	VICINITY CENTRES	42,168	72,318.12	
	オーストラリアドル 小計	371,517	1,958,229.83 (157,050,032)	
香港ドル	LINK REIT	38,700	2,674,170.00	
	香港ドル 小計	38,700	2,674,170.00 (37,705,797)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	73,700	226,259.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	74,160	149,803.20	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	23,000	47,840.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	90,800	187,048.00	
	シンガポールドル 小計	261,660	610,950.20 (49,841,317)	
合計			2,587,790,860 (2,587,790,860)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
米ドル	株式 598銘柄	97.3%		71.0%
	投資証券 37銘柄		2.7%	2.0%
カナダドル	株式 89銘柄	99.8%		3.4%
	投資証券 2銘柄		0.2%	0.0%

ユーロ	株式	231銘柄	99.6%		10.5%
	投資証券	4銘柄		0.4%	0.0%
英ポンド	株式	84銘柄	98.5%		4.3%
	投資証券	3銘柄		1.5%	0.1%
スイスフラン	株式	40銘柄	100.0%		3.0%
スウェーデンクローナ	株式	41銘柄	100.0%		1.2%
ノルウェークローネ	株式	11銘柄	100.0%		0.2%
デンマーククローネ	株式	18銘柄	100.0%		0.8%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	93.4%		2.0%
	投資証券	7銘柄		6.6%	0.1%
ニュージーランドドル	株式	7銘柄	100.0%		0.1%
香港ドル	株式	32銘柄	96.3%		0.9%
	投資証券	1銘柄		3.7%	0.0%
シンガポールドル	株式	14銘柄	86.1%		0.3%
	投資証券	4銘柄		13.9%	0.0%
イスラエルシェケル	株式	8銘柄	100.0%		0.1%

（注）時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

2021年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	702,877,654
コール・ローン	29,513,577

2021年 9月15日現在

株式	15,290,975,155
投資証券	14,248,329
派生商品評価勘定	228,255
未収入金	8,752,568
未収配当金	17,739,435
差入委託証拠金	1,025,529,915
流動資産合計	17,089,864,888
資産合計	17,089,864,888
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	8,810,759
未払解約金	73,200,000
未払利息	80
流動負債合計	82,010,839
負債合計	82,010,839
純資産の部	
元本等	
元本	10,289,013,899
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,718,840,150
元本等合計	17,007,854,049
純資産合計	17,007,854,049
負債純資産合計	17,089,864,888

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

5. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	<p>原則として、約定日基準で計上しております。</p> <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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	7,606,454,069円
期中追加設定元本額	7,073,904,809円
期中一部解約元本額	4,391,344,979円
期末元本額	10,289,013,899円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	625,148,314円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,194,149,050円
りそなラップ型ファンド(成長型)	1,377,224,325円
DCりそな グローバルバランス	11,072,974円
つみたてバランスファンド	508,011,403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	160,528,551円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	104,385,600円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	29,751,756円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	19,170,715円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	10,303,028円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	15,240,799円
リスクコントロール・オープン	8,374,879円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	147,364,110円
FWりそな先進国+新興国株式アクティブファンド	177,536,471円
FWりそな新興国株式インデックスファンド	2,508,583,288円
Smart-i 新興国株式インデックス	1,446,319,601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	141,293,463円
Smart-i 8資産バランス 成長型	162,151,287円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	219,233,369円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	411,226,488円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	246,078,063円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	178,183,833円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	200,986,833円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	34,455,696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)	1,328,589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)	12,143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)	43,251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)	68,378円
2. 計算日における受益権の総数	10,289,013,899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	1.6530円
(10,000口当たり純資産額)	(16,530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 9月15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 9月15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 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額(円)	
株式		809,096,443
投資証券		901,271
合計		808,195,172

(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 9月15日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,757,681,276	-	1,748,920,241	8,761,035
	合計	1,757,681,276	-	1,748,920,241	8,761,035

(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 9月15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	83,596,752	-	83,551,459	45,293
	米ドル	83,596,752	-	83,551,459	45,293
	売建	62,942,880	-	62,719,056	223,824
	米ドル	62,942,880	-	62,719,056	223,824
	合計	146,539,632	-	146,270,515	178,531

(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

			評価額

通貨	銘柄	株式数	単価	金額	備考
米ドル	GAZPROM PAO -SPON ADR	102,058	9.30	949,139.40	
	LUKOIL PJSC-SPON ADR	7,204	90.26	650,233.04	
	NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	1,583	268.90	425,668.70	
	ROSNEFT OIL CO PJSC-REGS GDR	18,641	7.63	142,305.39	
	SURGUTNEFTEGAS-SP ADR	11,989	4.52	54,214.25	
	TATNEFT PAO-SPONSORED ADR	4,156	41.54	172,640.24	
	YPF S.A. -SPONSORED ADR	1,900	5.35	10,165.00	
	CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	3,193	7.24	23,117.32	
	MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	11,006	32.93	362,427.58	
	NOVOLIPETSK STEEL PJSC-GDR	2,400	31.50	75,600.00	
	PHOSAGRO PJSC-GDR REG S	2,346	21.48	50,392.08	
	POLYUS PJSC-REG S-GDR	1,078	88.75	95,672.50	
	SEVERSTAL - GDR REG S	3,200	22.40	71,680.00	
	SOUTHERN COPPER CORP	1,502	60.77	91,276.54	
	51JOB INC-ADR	500	72.27	36,135.00	
	DIDI GLOBAL INC	4,700	8.45	39,715.00	
	ZTO EXPRESS CAYMAN INC-ADR	7,644	30.25	231,231.00	
	LI AUTO INC - ADR	9,403	29.81	280,303.43	
	NIO INC - ADR	23,442	37.89	888,217.38	
	XPENG INC - ADR	6,697	38.44	257,432.68	
	GAOTU TECHEDU INC	1,900	2.48	4,712.00	
	HUAZHU GROUP LTD-ADR	3,157	48.55	153,272.35	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	24,300	2.00	48,600.00	
	TAL EDUCATION GROUP- ADR	6,500	4.67	30,355.00	
	TRIP.COM GROUP LTD	8,938	28.40	253,839.20	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	7,300	61.22	446,906.00	
	AUTOHOME INC-ADR	1,495	44.70	66,826.50	
	BAIDU INC - SPON ADR	4,787	160.52	768,409.24	
	BILIBILI INC-SPONSORED ADR	2,884	79.50	229,278.00	
	HELLO GROUP INC -SPN ADR	2,650	12.00	31,800.00	
	HUYA INC-ADR	1,300	9.36	12,168.00	
	IQIYI INC-ADR	4,500	8.98	40,410.00	
JOYY INC	920	62.05	57,086.00		
MAIL.RU GROUP-GDR REGS	1,691	21.60	36,525.60		

NETEASE INC-ADR	6,940	84.52	586,568.80
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	10,500	8.06	84,630.00
WEIBO CORP-SPON ADR	930	51.66	48,043.80
YANDEX NV-A	5,260	81.87	430,636.20
BAOZUN INC-SPN ADR	900	20.73	18,657.00
DADA NEXUS LTD-ADR	1,000	19.51	19,510.00
JD.COM INC-ADR	14,947	77.90	1,164,371.30
OZON HOLDINGS PLC - ADR	920	50.65	46,598.00
PINDUODUO INC-ADR	7,561	101.78	769,558.58
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	8,297	13.49	111,926.53
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	6,121	14.88	91,111.08
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	2,296	31.65	72,668.40
ADECOAGRO SA	1,800	9.70	17,460.00
RLX TECHNOLOGY INC-ADR	12,431	5.05	62,776.55
BEIGENE LTD-ADR	809	368.89	298,432.01
BURNING ROCK BIOTECH LTD-ADR	800	19.62	15,696.00
HUTCHMED CHINA-ADR	1,668	39.14	65,285.52
I-MAB-SPONSORED ADR	500	68.72	34,360.00
ZAI LAB LTD-ADR	1,341	134.59	180,485.19
COMMERCIAL INTL BANK-GDR REG	33,401	2.86	95,693.86
CREDICORP LTD	1,206	106.27	128,161.62
SBERBANK PJSC -SPONSORED ADR	46,567	17.94	835,644.81
TCS GROUP HOLDING-GDR REG S	2,091	91.46	191,242.86
VTB BANK JSC -GDR-REG S	32,868	1.36	44,897.68
360 DIGITECH INC	1,400	21.66	30,324.00
LUFAX HOLDING LTD	2,900	7.81	22,649.00
NOAH HOLDINGS LTD-SPON ADS	500	38.50	19,250.00
UP FINTECH HOLDING LTD - ADR	1,400	13.41	18,774.00
KE HOLDINGS INC	6,406	17.44	111,720.64
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	10,080	0.91	9,172.80
21VIANET GROUP INC-ADR	1,400	20.10	28,140.00
AGORA INC-ADR	800	29.97	23,976.00
CHINDATA GROUP HOLDINGS-ADR	1,500	10.35	15,525.00
GDS HOLDINGS LTD - ADR	1,653	60.94	100,733.82
GLOBANT SA	698	322.50	225,105.00

	KINGSOFT CLOUD HOLDINGS-ADR	900	31.84	28,656.00	
	ONECONNECT FINANCIAL TECHNO	1,900	4.31	8,189.00	
	MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	7,200	9.69	69,768.00	
	DAQO NEW ENERGY CORP-ADR	800	61.00	48,800.00	
	米ドル 小計	537,655		13,262,953.47	(1,454,282,847)
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	262,300	15.28	4,007,944.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV-SER B	53,900	87.14	4,696,846.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	1,850	267.38	494,653.00	
	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	19,800	54.85	1,086,030.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	7,400	69.65	515,410.00	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	6,700	231.78	1,552,926.00	
	GRUPO AEROPORT DEL SURESTE-B	3,830	361.36	1,384,008.80	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	2,750	147.31	405,102.50	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	39,400	48.83	1,923,902.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	6,500	68.82	447,330.00	
	WALMART DE MEXICO SAB DE CV	90,500	71.61	6,480,705.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	7,700	124.11	955,647.00	
	BECLE SAB DE CV	11,400	49.00	558,600.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	7,745	114.75	888,738.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	33,500	174.72	5,853,120.00	
	GRUMA S.A.B. -B	4,125	236.66	976,222.50	
	GRUPO BIMBO SAB- SERIES A	26,700	55.35	1,477,845.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	24,500	35.24	863,380.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	44,700	128.52	5,744,844.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	30,800	17.64	543,312.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	590,000	18.86	11,127,400.00		
TELESITES SAB DE CV	19,700	16.91	333,127.00		
	メキシコペソ 小計	1,295,800		52,317,093.55	(288,241,026)
ブラジルリアル	COSAN SA	16,900	23.50	397,150.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	64,500	26.68	1,720,860.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	82,400	25.88	2,132,512.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	10,400	14.51	150,904.00	
	BRADSPAR SA -PREF	3,300	60.64	200,112.00	

BRASKEM SA-PREF A	2,900	69.42	201,318.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	12,400	33.13	410,812.00	
GERDAU SA-PREF	18,400	27.55	506,920.00	
KLABIN SA - UNIT	13,600	25.75	350,200.00	
SUZANO SA	13,207	60.05	793,080.35	
VALE SA	68,100	94.09	6,407,529.00	
WEG SA	29,300	39.38	1,153,834.00	
CCR SA	18,800	11.77	221,276.00	
LOCALIZA RENT A CAR	9,710	58.00	563,180.00	
RUMO SA	21,000	18.42	386,820.00	
ALPARGATAS SA - PREF	2,700	57.93	156,411.00	
AMERICANAS SA	8,400	41.23	346,332.00	
LOJAS RENNER S.A.	16,200	37.38	605,556.00	
MAGAZINE LUIZA SA	51,000	17.03	868,530.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	18,700	25.32	473,484.00	
VIA S/A	21,100	9.05	190,955.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	8,000	18.67	149,360.00	
RAIA DROGASIL SA	17,600	26.00	457,600.00	
AMBEV SA	81,900	16.44	1,346,436.00	
BRF SA	9,900	23.89	236,511.00	
JBS SA	16,900	33.28	562,432.00	
NATURA &CO HOLDING SA	15,700	49.95	784,215.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVE	17,200	15.23	261,956.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	9,200	84.70	779,240.00	
REDE D'OR SAO LUIZ SA	7,200	70.30	506,160.00	
HYPERA SA	6,400	34.80	222,720.00	
BANCO BRADESCO S.A.	23,432	18.27	428,102.64	
BANCO BRADESCO SA-PREF	83,779	21.23	1,778,628.17	
BANCO DO BRASIL S.A.	13,800	29.23	403,374.00	
BANCO INTER SA-UNITS	5,500	67.46	371,030.00	
BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	6,200	36.92	228,904.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	83,500	28.99	2,420,665.00	
ITAUSA SA	77,100	11.06	852,726.00	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	107,500	14.13	1,518,975.00	
BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT	20,900	27.63	577,467.00	

	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	13,700	19.62	268,794.00	
	TOTVS SA	9,200	38.55	354,660.00	
	TELEFONICA BRASIL S.A.	7,600	42.79	325,204.00	
	TIM SA	17,100	12.19	208,449.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	3,400	38.63	131,342.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	4,900	38.20	187,180.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	15,742	13.76	216,609.92	
	CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	11,000	7.13	78,430.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	5,000	35.09	175,450.00	
	CPFL ENERGIA SA	5,600	27.88	156,128.00	
	ENERGISA SA-UNITS	4,200	43.45	182,490.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	4,775	39.28	187,562.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	15,100	25.28	381,728.00	
	ブラジルリアル 小計	1,232,045		34,978,304.08	(731,781,099)
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	7,351	7,049.00	51,817,199.00	
	EMPRESAS CMPC SA	23,076	1,620.00	37,383,120.00	
	SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B	2,233	43,348.00	96,796,084.00	
	FALABELLA SA	10,992	2,825.00	31,052,400.00	
	CENCOSUD SA	25,901	1,410.00	36,520,410.00	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	3,292	7,375.10	24,278,829.20	
	BANCO DE CHILE	766,095	77.15	59,104,229.25	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	945	30,700.00	29,011,500.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	961,724	40.40	38,853,649.60	
	CENCOSUD SHOPPING SA	5,205	997.99	5,194,537.95	
	COLBUN SA	161,671	129.50	20,936,394.50	
	ENEL AMERICAS SA	383,577	101.30	38,856,350.10	
	ENEL CHILE SA	369,172	37.90	13,991,618.80	
	チリペソ 小計	2,721,234		483,796,322.40	(67,624,082)
コロンビアペソ	ECOPETROL SA	71,024	2,550.00	181,111,200.00	
	BANCOLOMBIA SA	4,637	31,000.00	143,747,000.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	7,902	31,070.00	245,515,140.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	5,442	19,920.00	108,404,640.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	6,643	22,330.00	148,338,190.00	

コロンビアペソ 小計		95,648		827,116,170.00 (23,678,681)
ユーロ	OPAP SA	3,467	13.36	46,319.12
	JUMBO SA	1,515	12.90	19,543.50
	ALPHA SERVICES AND HOLDINGS	36,613	1.15	42,104.95
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES A	42,000	0.84	35,649.60
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	4,371	16.48	72,055.93
ユーロ 小計		87,966		215,673.10 (27,923,196)
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	6,269	13.66	85,634.54
英ポンド 小計		6,269		85,634.54 (12,964,213)
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	1,755	106.70	187,258.50
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	22,741	17.77	404,107.57
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	15,288	14.96	228,708.48
	KOC HOLDING AS	14,295	22.42	320,493.90
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI	29,869	8.50	253,886.50
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	1,092	168.80	184,329.60
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	8,276	67.45	558,216.20
	AKBANK T.A.S.	43,035	5.65	243,147.75
	TURKIYE GARANTI BANKASI	44,864	9.56	428,899.84
	TURKIYE IS BANKASI-C	25,039	5.41	135,460.99
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	19,091	15.84	302,401.44
トルコリラ 小計		225,345		3,246,910.77 (42,214,060)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	1,233	845.00	1,041,885.00
	MONETA MONEY BANK AS	7,045	89.00	627,005.00
	CEZ AS	2,634	688.00	1,812,192.00
チェココルナ 小計		10,912		3,481,082.00 (17,771,271)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	7,310	2,396.00	17,514,760.00
	RICHTER GEDEON NYRT	2,477	8,595.00	21,289,815.00
	OTP BANK PLC	3,814	18,400.00	70,177,600.00
ハンガリーフォリント 小計		13,601		108,982,175.00 (40,323,077)
ポーランドズロ	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	4,822	80.50	388,171.00

チ	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	26,615	6.38	169,803.70
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	2,547	174.45	444,324.15
	LPP SA	19	14,390.00	273,410.00
	CD PROJEKT SA	1,166	188.78	220,117.48
	CYFROWY POLSAT SA	4,876	34.62	168,807.12
	ALLEGRO.EU SA	5,718	62.10	355,087.80
	DINO POLSKA SA	930	339.10	315,363.00
	BANK PEKAO SA	3,378	107.00	361,446.00
	PKO BANK POLSKI SA	15,333	43.71	670,205.43
	SANTANDER BANK POLSKA SA	538	303.80	163,444.40
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	9,703	38.49	373,468.47
	ORANGE POLSKA SA	11,699	8.12	94,995.88
	PGE SA	17,929	10.20	182,875.80
		ポーランドズロチ 小計	105,273	
ロシアルーブル	SURGUTNEFTEGAS-PREFERENCE	114,400	38.14	4,363,216.00
	ALROSA PJSC	46,260	150.02	6,939,925.20
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ	24,440	181.38	4,432,927.20
	INTER RAO UES PJSC	423,000	4.70	1,991,272.50
	ロシアルーブル 小計	608,100		17,727,340.90 (26,591,011)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	28,000	6.99	195,720.00
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	428,000	3.90	1,669,200.00
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-H	61,500	18.58	1,142,670.00
	PETROCHINA CO LTD-H	376,000	3.72	1,398,720.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	26,000	16.40	426,400.00
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	66,000	6.78	447,480.00
	ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	22,000	47.60	1,047,200.00
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	34,500	13.36	460,920.00
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	48,000	6.16	295,680.00
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	62,000	12.48	773,760.00
	CHINA RESOURCES CEMENT	36,000	8.90	320,400.00
	GANFENG LITHIUM CO LTD-H	4,600	153.10	704,260.00
	HUABAO INTERNATIONAL HOLDING	19,000	16.80	319,200.00
JIANGXI COPPER CO LTD-H	18,000	17.08	307,440.00	

LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	22,000	7.24	159,280.00
MMG LTD	40,000	3.87	154,800.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	26,000	11.40	296,400.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-H	9,500	14.90	141,550.00
ZHAOJIN MINING INDUSTRY - H	13,000	6.61	85,930.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	102,000	11.84	1,207,680.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	44,000	5.73	252,120.00
BOC AVIATION LTD	3,500	63.40	221,900.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	58,000	3.96	229,680.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	29,500	33.50	988,250.00
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS L	17,000	15.16	257,720.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	65,000	4.34	282,100.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	30,000	6.94	208,200.00
CITIC LTD	92,000	9.72	894,240.00
FOSUN INTERNATIONAL LTD	40,000	10.00	400,000.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	10,000	28.95	289,500.00
SANY HEAVY EQUIPMENT INTL	19,000	10.08	191,520.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	11,500	13.96	160,540.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	31,000	18.08	560,480.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	12,800	16.46	210,688.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	8,700	39.30	341,910.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY - H	19,600	8.06	157,976.00
A-LIVING SMART CITY SERVICES	9,000	30.30	272,700.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	59,000	6.18	364,620.00
CIFI EVER SUNSHINE SERVICES	12,000	13.70	164,400.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	27,000	56.15	1,516,050.00
GREENTOWN SERVICE GROUP CO L	32,000	8.09	258,880.00
AIR CHINA LTD-H	30,000	5.19	155,700.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H	30,000	4.66	139,800.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	24,000	13.24	317,760.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	26,000	4.46	115,960.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-H	60,200	14.82	892,164.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	32,000	6.07	194,240.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	20,000	8.09	161,800.00
SHENZHEN INTL HOLDINGS	19,500	10.86	211,770.00

ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	18,000	6.67	120,060.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	34,000	7.30	248,200.00	
BYD CO LTD-H	13,500	263.00	3,550,500.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	44,000	8.14	358,160.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	9,600	44.40	426,240.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	102,000	26.50	2,703,000.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	54,000	33.60	1,814,400.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	46,000	8.16	375,360.00	
MINTH GROUP LTD	12,000	28.80	345,600.00	
YADEA GROUP HOLDINGS LTD	20,000	12.98	259,600.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	19,000	159.00	3,021,000.00	
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	54,000	6.58	355,320.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-H	39,800	28.00	1,114,400.00	
LI NING CO LTD	39,000	98.95	3,859,050.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	14,400	168.10	2,420,640.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	6,000	8.59	51,540.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	13,000	13.32	173,160.00	
CHINA YUHUA EDUCATION CORP L	24,000	3.72	89,280.00	
HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDI	17,000	31.40	533,800.00	
JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLD	12,000	24.75	297,000.00	
TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD	20,800	17.76	369,408.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	200,000	0.81	162,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	7,800	67.20	524,160.00	
KUAISHOU TECHNOLOGY	4,300	97.70	420,110.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	98,700	472.80	46,665,360.00	
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	260,340	158.30	41,211,822.00	
CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS	10,000	40.10	401,000.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LIMITED	275,000	0.79	217,250.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	44,000	2.75	121,000.00	
JD HEALTH INTERNATIONAL INC	6,500	76.90	499,850.00	
MEITUAN	69,200	245.00	16,954,000.00	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	24,000	9.73	233,520.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	9,000	63.80	574,200.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	31,500	3.76	118,440.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-B	2,200	102.03	224,466.00	

CHINA FEIHE LTD	64,000	13.50	864,000.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	55,000	47.35	2,604,250.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	26,000	58.65	1,524,900.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	30,500	4.22	128,710.00
NONGFU SPRING CO LTD-H	6,400	38.05	243,520.00
SMOORE INTERNATIONAL HOLDING	32,000	34.55	1,105,600.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	32,000	14.60	467,200.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	8,000	61.50	492,000.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS	21,000	7.42	155,820.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	93,000	5.42	504,060.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING	7,000	42.25	295,750.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	10,500	41.65	437,325.00
VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS	6,000	23.00	138,000.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION T	74,000	11.76	870,240.00
JINXIN FERTILITY GROUP LTD	20,000	13.22	264,400.00
MICROPORT SCIENTIFIC CORP	12,000	50.40	604,800.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHN	7,200	55.00	396,000.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	40,000	13.62	544,800.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	11,300	16.14	182,382.00
SINOPHARM GROUP CO-H	21,600	21.05	454,680.00
VENUS MEDTECH HANGZHOU INC-H	3,500	44.60	156,100.00
3SBIO INC	20,500	8.59	176,095.00
AKESO INC	5,000	43.70	218,500.00
CANSINO BIOLOGICS INC-H	1,200	278.00	333,600.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	22,000	15.00	330,000.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTIC	25,500	4.04	103,020.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	46,000	3.76	172,960.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	158,000	9.70	1,532,600.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	18,000	33.25	598,500.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-H	1,900	167.20	317,680.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	18,000	20.90	376,200.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	20,500	65.20	1,336,600.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-H	2,100	184.40	387,240.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	8,000	48.15	385,200.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	184,250	6.67	1,228,947.50

SSY GROUP LTD	22,000	4.46	98,120.00
WUXI APPTTEC CO LTD-H	6,168	168.90	1,041,775.20
WUXI BIOLOGICS (CAYMAN) INC.	62,000	117.30	7,272,600.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	461,000	2.73	1,258,530.00
BANK OF CHINA LTD-H	1,374,000	2.81	3,860,940.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	137,000	4.62	632,940.00
CHINA BOHAI BANK CO LTD-H	39,500	3.30	130,350.00
CHINA CITIC BANK CORP LTD-H	140,000	3.65	511,000.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	1,654,000	5.66	9,361,640.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	47,000	2.85	133,950.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	67,500	66.40	4,482,000.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	110,600	3.26	360,556.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	57,000	3.01	171,570.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	974,000	4.40	4,285,600.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-H	125,000	5.61	701,250.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	149,000	1.45	216,050.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	14,000	10.28	143,920.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	56,000	4.62	258,720.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGE-H	103,000	1.02	105,060.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITA-H	23,200	22.50	522,000.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	43,500	20.60	896,100.00
FAR EAST HORIZON LTD	29,000	8.92	258,680.00
GF SECURITIES CO LTD-H	21,600	15.20	328,320.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	43,600	7.22	314,792.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	25,800	12.56	324,048.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	131,000	13.28	1,739,680.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	47,000	23.50	1,104,500.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD	24,400	12.34	301,096.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	14,100	23.40	329,940.00
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	126,000	2.49	313,740.00
PICC PROPERTY & CASUALTY-H	124,000	7.42	920,080.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	109,000	57.60	6,278,400.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURAN-H	7,900	35.90	283,610.00
AGILE GROUP HOLDINGS LTD	18,000	7.29	131,220.00
CHINA AOYUAN GROUP LTD	20,000	4.32	86,400.00

CHINA EVERGRANDE GROUP	24,000	2.97	71,280.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP	96,000	2.43	233,280.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST	68,000	17.82	1,211,760.00
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	20,000	6.15	123,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	56,000	29.30	1,640,800.00
CHINA RESOURCES MIXC LIFESTY	10,800	37.20	401,760.00
CHINA VANKE CO LTD-H	27,100	20.20	547,420.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	54,000	5.05	272,700.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	137,000	7.88	1,079,560.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	15,000	12.66	189,900.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H	26,400	5.84	154,176.00
HOPSON DEVELOPMENT HOLDINGS	10,700	28.70	307,090.00
KAISA GROUP HOLDINGS LTD	37,000	2.20	81,400.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	21,500	7.39	158,885.00
LOGAN GROUP CO LTD	23,000	8.24	189,520.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	32,500	34.85	1,132,625.00
POLY PROPERTY SERVICES CO LT	2,400	44.25	106,200.00
POWERLONG REAL ESTATE HOLDIN	25,000	5.73	143,250.00
SEAZEN GROUP LIMITED	36,000	6.46	232,560.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	52,000	2.27	118,040.00
SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD	20,000	15.68	313,600.00
SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD	10,000	16.06	160,600.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	46,000	16.30	749,800.00
SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD	11,000	16.02	176,220.00
WHARF HOLDINGS LTD	22,000	26.60	585,200.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	20,800	7.35	152,880.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	22,000	4.27	93,940.00
CHINA YOUZAN LTD	220,000	1.05	231,000.00
CHINASOFT INTERNATIONAL LTD	48,000	13.44	645,120.00
KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	46,000	25.35	1,166,100.00
KINGSOFT CORP LTD	15,200	30.90	469,680.00
MING YUAN CLOUD GROUP HOLDIN	6,000	27.55	165,300.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	13,000	14.74	191,620.00
WEIMOB INC	27,000	11.90	321,300.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	14,000	40.55	567,700.00

	BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	10,500	33.25	349,125.00	
	KINGBOARD HOLDINGS LTD	10,500	37.40	392,700.00	
	KINGBOARD LAMINATES HLDG LTD	16,500	14.10	232,650.00	
	LENOVO GROUP LTD	130,000	8.20	1,066,000.00	
	SUNNY OPTICAL TECH	12,400	226.00	2,802,400.00	
	XIAOMI CORP-CLASS B	247,800	23.25	5,761,350.00	
	ZTE CORP-H	12,200	27.05	330,010.00	
	CHINA TOWER CORP LTD-H	656,000	1.05	688,800.00	
	BEIJING ENTERPRISES HLDGS	8,500	29.80	253,300.00	
	BEIJING ENTERPRISES WATER GR	76,000	3.25	247,000.00	
	CGN POWER CO LTD-H	171,000	2.14	365,940.00	
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,800	22.20	1,216,560.00	
	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	60,000	16.04	962,400.00	
	CHINA POWER INTERNATIONAL	59,000	3.45	203,550.00	
	CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	16,000	45.90	734,400.00	
	CHINA RESOURCES POWER HOLDIN	32,000	20.30	649,600.00	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	13,900	143.90	2,000,210.00	
	GUANGDONG INVESTMENT LTD	48,000	10.70	513,600.00	
	HUANENG POWER INTL INC-H	52,000	3.94	204,880.00	
	KUNLUN ENERGY CO LTD	64,000	8.86	567,040.00	
	FLAT GLASS GROUP CO LTD-H	7,000	37.05	259,350.00	
	HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	8,000	42.55	340,400.00	
	XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	86,000	17.48	1,503,280.00	
	香港ドル 小計	14,655,358		257,900,921.70 (3,636,402,995)	
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	69,800	2.66	185,668.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	5,900	19.82	116,938.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	40,000	7.92	316,800.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN	49,400	5.58	275,652.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	7,600	8.73	66,348.00	
	SIME DARBY BERHAD	58,700	2.24	131,488.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	22,700	6.70	152,090.00	
	MISC BHD	26,800	7.00	187,600.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	19,600	4.35	85,260.00	
	GENTING BHD	32,900	4.94	162,526.00	

	GENTING MALAYSIA BHD	55,700	3.02	168,214.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	2,100	27.52	57,792.00	
	IOI CORP BHD	49,600	3.90	193,440.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BHD	6,400	20.42	130,688.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	1,000	134.80	134,800.00	
	PPB GROUP BERHAD	11,120	18.42	204,830.40	
	QL RESOURCES BHD	17,150	5.50	94,325.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	30,400	3.84	116,736.00	
	HARTELEGA HOLDINGS BHD	33,500	6.32	211,720.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	31,800	6.54	207,972.00	
	KOSSAN RUBBER INDUSTRIES	16,600	2.70	44,820.00	
	SUPERMAX CORP BHD	19,217	2.64	50,732.88	
	TOP GLOVE CORP BHD	99,500	3.23	321,385.00	
	AMMB HOLDINGS BHD	23,400	3.13	73,242.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BHD	114,200	4.78	545,876.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	10,100	18.46	186,446.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	5,300	18.30	96,990.00	
	MALAYAN BANKING BHD	64,500	8.29	534,705.00	
	PUBLIC BANK BERHAD	252,600	4.00	1,010,400.00	
	RHB BANK BHD	28,700	5.35	153,545.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	47,800	4.04	193,112.00	
	DIGI.COM BHD	52,900	4.48	236,992.00	
	MAXIS BHD	45,700	4.77	217,989.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	18,400	5.98	110,032.00	
	PETRONAS GAS BHD	14,000	16.76	234,640.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	38,200	10.18	388,876.00	
	マレーシアリングット 小計	1,423,287		7,600,670.28	(200,113,487)
タイバーツ	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	23,700	112.50	2,666,250.00	
	PTT PCL-NVDR	174,800	39.00	6,817,200.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	24,000	50.50	1,212,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	26,800	44.75	1,199,300.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	42,100	60.75	2,557,575.00	
	SCG PACKAGING PCL-NVDR	20,500	66.25	1,358,125.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	12,700	412.00	5,232,400.00	

AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	70,100	62.25	4,363,725.00	
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO	154,900	8.80	1,363,120.00	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	157,400	9.45	1,487,430.00	
ASSET WORLD CORP PCL-NVDR	190,600	4.32	823,392.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	48,600	33.00	1,603,800.00	
CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	33,225	33.75	1,121,343.75	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	88,100	14.10	1,242,210.00	
PTT OIL & RETAIL BUSINE-NVDR	54,500	29.00	1,580,500.00	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	16,500	34.00	561,000.00	
CP ALL PCL-NVDR	94,900	62.25	5,907,525.00	
CARABAO GROUP PCL-NVDR	4,900	129.50	634,550.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	73,500	26.50	1,947,750.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	19,500	34.75	677,625.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	48,600	21.60	1,049,760.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	159,100	22.30	3,547,930.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PCL-NVDR	9,900	131.00	1,296,900.00	
SRI TRANG GLOVES THAILA-NVDR	13,400	33.75	452,250.00	
KRUNG THAI BANK - NVDR	76,200	11.00	838,200.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	15,400	103.50	1,593,900.00	
BANGKOK COMMERCIAL ASSE-NVDR	18,300	18.50	338,550.00	
KRUNGTHAI CARD PCL-NVDR	14,700	63.50	933,450.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	16,300	63.00	1,026,900.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	16,200	70.00	1,134,000.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	38,500	53.75	2,069,375.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	156,200	8.10	1,265,220.00	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	5,200	582.00	3,026,400.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	19,700	190.00	3,743,000.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL-NVDR	17,100	77.75	1,329,525.00	
TRUE CORP PCL-NVDR	260,800	3.36	876,288.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	9,500	42.75	406,125.00	
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	4,000	177.00	708,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	23,900	65.25	1,559,475.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	13,300	79.50	1,057,350.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	46,700	40.50	1,891,350.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	11,200	45.75	512,400.00	

	タイパーツ 小計	2,325,525		75,013,168.75 (249,043,720)	
フィリピンベソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	42,460	45.10	1,914,946.00	
	AYALA CORPORATION	4,750	810.50	3,849,875.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	1,560	555.00	865,800.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	51,491	65.00	3,346,915.00	
	SM INVESTMENTS CORP	4,030	988.00	3,981,640.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	17,520	188.00	3,293,760.00	
	JOLLIBEE FOODS CORP	6,950	204.20	1,419,190.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	13,570	143.00	1,940,510.00	
	BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	34,680	82.45	2,859,366.00	
	BDO UNIBANK INC	35,410	113.00	4,001,330.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	27,612	45.00	1,242,540.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	145,000	3.77	546,650.00	
	AYALA LAND INC	134,900	33.60	4,532,640.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	179,600	33.50	6,016,600.00	
	GLOBE TELECOM INC	450	3,174.00	1,428,300.00	
	PLDT INC	1,555	1,480.00	2,301,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	3,140	295.00	926,300.00	
	フィリピンベソ 小計	704,678		44,467,762.00 (97,660,098)	
インドネシアル ピア	ADARO ENERGY TBK PT	323,600	1,385.00	448,186,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	33,800	21,400.00	723,320,000.00	
	ANEKA TAMBANG TBK	111,500	2,470.00	275,405,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	559,600	1,010.00	565,196,000.00	
	INDAH KIAT PULP & PAPER TBK	53,900	7,875.00	424,462,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	23,200	10,700.00	248,240,000.00	
	MERDEKA COPPER GOLD TBK PT	160,500	2,740.00	439,770,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK	55,300	8,900.00	492,170,000.00	
	ASTRA INTERNATIONAL TBK PT	354,700	5,525.00	1,959,717,500.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	139,000	6,600.00	917,400,000.00	
	GUDANG GARAM TBK PT	6,600	32,500.00	214,500,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	32,700	8,450.00	276,315,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK P	81,200	6,175.00	501,410,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	100,700	4,050.00	407,835,000.00	

	KALBE FARMA TBK PT	346,500	1,480.00	512,820,000.00	
	(Right)BANK RAKYAT INDONESIA-RIGHTS	221,245	226.00	50,001,370.00	
	BANK CENTRAL ASIA TBK PT	191,300	32,725.00	6,260,292,500.00	
	BANK MANDIRI PERSERO TBK PT	303,200	6,100.00	1,849,520,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PERSER	105,500	5,400.00	569,700,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA PERSER	961,400	3,700.00	3,557,180,000.00	
	SARANA MENARA NUSANTARA PT	347,300	1,350.00	468,855,000.00	
	TELKOM INDONESIA PERSERO TBK	861,600	3,440.00	2,963,904,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	140,900	2,990.00	421,291,000.00	
	インドネシアルピア 小計	5,515,245		24,547,490,870.00 (189,015,679)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	848	43,050.00	36,506,400.00	
	S-OIL CORP	847	100,500.00	85,123,500.00	
	SK INNOVATION CO LTD	887	256,000.00	227,072,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	1,981	42,700.00	84,588,700.00	
	HYUNDAI STEEL CO	1,620	53,100.00	86,022,000.00	
	KOREA ZINC CO LTD	158	521,000.00	82,318,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	307	199,000.00	61,093,000.00	
	LG CHEM LTD	794	734,000.00	582,796,000.00	
	LG CHEM LTD-PREFERENCE	133	345,500.00	45,951,500.00	
	LOTTE CHEMICAL CORP	320	256,000.00	81,920,000.00	
	POSCO	1,280	366,500.00	469,120,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	576	154,500.00	88,992,000.00	
	SK CHEMICALS CO LTD/NEW	110	296,000.00	32,560,000.00	
	SK IE TECHNOLOGY CO LTD	261	227,500.00	59,377,500.00	
	SKC CO LTD	311	177,500.00	55,202,500.00	
	CJ CORP	193	106,000.00	20,458,000.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	514	29,550.00	15,188,700.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	883	42,500.00	37,527,500.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES & CONSTRUCTION	4,146	21,000.00	87,066,000.00	
	ECOPRO BM CO LTD	207	436,800.00	90,417,600.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	1,254	44,750.00	56,116,500.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONST	1,161	53,900.00	62,577,900.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	813	68,400.00	55,609,200.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	1,000	31,550.00	31,550,000.00	

KOREA SHIPBUILDING & OFFSHOR	719	118,500.00	85,201,500.00	
LG CORP	1,396	96,600.00	134,853,600.00	
SAMSUNG C&T CORP	1,346	130,000.00	174,980,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	2,405	24,150.00	58,080,750.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	6,907	6,630.00	45,793,410.00	
SK	511	268,500.00	137,203,500.00	
S-1 CORPORATION	228	85,200.00	19,425,600.00	
CJ LOGISTICS	135	170,500.00	23,017,500.00	
HMM CO LTD	4,121	38,350.00	158,040,350.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	314	181,500.00	56,991,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	3,186	32,450.00	103,385,700.00	
PAN OCEAN CO LTD	5,356	7,490.00	40,116,440.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	1,393	45,100.00	62,824,300.00	
HANON SYSTEMS	3,541	16,100.00	57,010,100.00	
HYUNDAI MOBIS CO LTD	1,146	269,500.00	308,847,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO	2,391	209,000.00	499,719,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PRF	610	99,500.00	60,695,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	336	101,000.00	33,936,000.00	
KIA CORP	4,543	83,400.00	378,886,200.00	
COWAY CO LTD	831	78,400.00	65,150,400.00	
FILA HOLDINGS CORP	654	46,700.00	30,541,800.00	
HLB INC	1,659	61,100.00	101,364,900.00	
LG ELECTRONICS INC	1,839	142,500.00	262,057,500.00	
KANGWON LAND INC	1,387	28,100.00	38,974,700.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	1,050	23,450.00	24,622,500.00	
HYBE CO LTD	230	283,500.00	65,205,000.00	
KAKAO CORP	5,344	124,000.00	662,656,000.00	
NAVER CORP	2,118	402,500.00	852,495,000.00	
NCSOFT CORP	286	599,000.00	171,314,000.00	
NETMARBLE CORPORATION	392	124,000.00	48,608,000.00	
PEARL ABYSS CORP	597	82,900.00	49,491,300.00	
CJ ENM CO LTD	195	149,600.00	29,172,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	602	90,400.00	54,420,800.00	
LOTTE SHOPPING CO	222	109,000.00	24,198,000.00	
SHINSEGAE INC	109	276,500.00	30,138,500.00	

BGF RETAIL CO LTD/NEW	138	179,000.00	24,702,000.00	
E-MART INC	374	170,500.00	63,767,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	123	441,000.00	54,243,000.00	
KT&G CORP	2,071	81,400.00	168,579,400.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	412	124,500.00	51,294,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	526	191,500.00	100,729,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	429	53,800.00	23,080,200.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	163	1,386,000.00	225,918,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	31	668,000.00	20,708,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	1,493	110,900.00	165,573,700.00	
ALTEOGEN INC	360	78,600.00	28,296,000.00	
CELLTRION INC	1,668	263,000.00	438,684,000.00	
CELLTRION PHARM INC	238	148,700.00	35,390,600.00	
GREEN CROSS CORP	90	358,000.00	32,220,000.00	
HANMI PHARM CO LTD	87	302,500.00	26,317,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	287	913,000.00	262,031,000.00	
SEEGENE INC	734	64,100.00	47,049,400.00	
SHIN POONG PHARMACEUTICAL CO	652	67,400.00	43,944,800.00	
SK BIOPHARMACEUTICALS CO LTD	529	115,000.00	60,835,000.00	
SK BIOSCIENCE CO LTD	327	276,500.00	90,415,500.00	
YUHAN CORP	839	64,800.00	54,367,200.00	
HANA FINANCIAL GROUP	5,198	45,150.00	234,689,700.00	
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	4,455	10,250.00	45,663,750.00	
KAKAOBANK CORP	800	69,700.00	55,760,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	6,813	52,300.00	356,319,900.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	7,585	39,150.00	296,952,750.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	9,157	11,100.00	101,642,700.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	715	88,500.00	63,277,500.00	
MERITZ SECURITIES CO LTD	6,080	5,310.00	32,284,800.00	
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	4,302	8,740.00	37,599,480.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES C	2,964	13,450.00	39,865,800.00	
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	1,222	49,150.00	60,061,300.00	
DB INSURANCE CO LTD	726	61,500.00	44,649,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	503	233,500.00	117,450,500.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LT	1,244	75,000.00	93,300,000.00	

	DOUZONE BIZON CO LTD	357	100,500.00	35,878,500.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	567	168,000.00	95,256,000.00	
	LG DISPLAY CO LTD	4,329	20,350.00	88,095,150.00	
	LG INNOTEK CO LTD	243	227,500.00	55,282,500.00	
	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	899	187,000.00	168,113,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	81,869	76,600.00	6,271,165,400.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	14,152	71,400.00	1,010,452,800.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	947	755,000.00	714,985,000.00	
	LG UPLUS CORP	3,613	14,600.00	52,749,800.00	
	SK TELECOM	157	303,500.00	47,649,500.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORP	4,249	23,800.00	101,126,200.00	
	SK HYNIX INC	9,376	107,500.00	1,007,920,000.00	
	韓国ウォン 小計	262,796		20,730,908,180.00 (1,940,413,005)	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	19,000	98.00	1,862,000.00	
	ASIA CEMENT CORP	41,000	46.50	1,906,500.00	
	CHINA STEEL CORP	206,000	39.85	8,209,100.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	61,000	83.20	5,075,200.00	
	FORMOSA PLASTICS CORP	66,000	102.00	6,732,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	90,000	88.60	7,974,000.00	
	TAIWAN CEMENT	87,477	51.40	4,496,317.80	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	2,100	910.00	1,911,000.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	55,000	29.75	1,636,250.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	4,174	338.50	1,412,899.00	
	EVERGREEN MARINE CORP LTD	43,550	123.50	5,378,425.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	38,000	29.90	1,136,200.00	
	WAN HAI LINES LTD	11,000	201.50	2,216,500.00	
	YANG MING MARINE TRANSPORT	28,000	117.50	3,290,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	30,000	37.35	1,120,500.00	
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	3,020	612.00	1,848,240.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	8,080	220.00	1,777,600.00	
	GIANT MANUFACTURING	6,000	343.00	2,058,000.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	3,000	420.00	1,260,000.00	
	POU CHEN	34,000	33.95	1,154,300.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	5,000	603.00	3,015,000.00	

MOMO.COM INC	1,000	2,010.00	2,010,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	9,000	278.00	2,502,000.00	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	85,000	69.40	5,899,000.00	
ONENESS BIOTECH CO LTD	3,000	186.00	558,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	72,332	16.65	1,204,327.80	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LT	322,000	23.00	7,406,000.00	
E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	208,900	26.35	5,504,515.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	165,263	22.70	3,751,470.10	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	135,416	21.15	2,864,048.40	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	190,000	32.50	6,175,000.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	181,995	14.05	2,557,029.75	
TAISHIN FINANCIAL HOLDING	182,708	18.55	3,389,233.40	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	152,361	22.20	3,382,414.20	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SA	58,000	45.65	2,647,700.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	22,996	281.00	6,461,876.00	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	156,920	25.10	3,938,692.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	138,000	59.80	8,252,400.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	218,000	14.30	3,117,400.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	27,899	29.10	811,860.90	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	126,500	80.80	10,221,200.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING	215,835	9.50	2,050,432.50	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	16,480	83.50	1,376,080.00	
ACCTON TECHNOLOGY CORP	8,000	278.50	2,228,000.00	
ACER INC	56,000	24.75	1,386,000.00	
ADVANTECH CO LTD	7,299	372.00	2,715,228.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	13,000	322.50	4,192,500.00	
AU OPTRONICS CORP	149,000	17.65	2,629,850.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	11,000	158.50	1,743,500.00	
COMPAL ELECTRONICS	63,000	23.10	1,455,300.00	
DELTA ELECTRONICS INC	34,000	263.50	8,959,000.00	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	14,000	62.80	879,200.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	214,800	107.50	23,091,000.00	
INNOLUX CORP	167,000	16.60	2,772,200.00	
INVENTEC CORP	41,000	24.65	1,010,650.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	1,600	2,530.00	4,048,000.00	

	LITE-ON TECHNOLOGY CORP	35,000	61.10	2,138,500.00	
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	10,000	138.50	1,385,000.00	
	NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD	4,000	444.00	1,776,000.00	
	PEGATRON CORP	33,000	64.50	2,128,500.00	
	QUANTA COMPUTER INC	43,000	75.70	3,255,100.00	
	SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	26,000	53.10	1,380,600.00	
	UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	22,000	142.50	3,135,000.00	
	WALSIN TECHNOLOGY CORP	5,000	172.00	860,000.00	
	WISTRON CORP	40,951	27.20	1,113,867.20	
	WIWYNN CORP	1,500	892.00	1,338,000.00	
	WPG HOLDINGS LTD	26,960	48.30	1,302,168.00	
	YAGEO CORPORATION	6,198	481.00	2,981,238.00	
	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	10,000	98.60	986,000.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	66,000	111.00	7,326,000.00	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	24,000	60.80	1,459,200.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	27,000	99.00	2,673,000.00	
	ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	58,000	124.50	7,221,000.00	
	ASMEDIA TECHNOLOGY INC	500	2,100.00	1,050,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	4,000	895.00	3,580,000.00	
	MEDIATEK INC	26,000	947.00	24,622,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	17,000	66.20	1,125,400.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS COR	10,000	440.00	4,400,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	3,000	412.50	1,237,500.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	10,000	111.50	1,115,000.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	8,000	529.00	4,232,000.00	
	SILERGY CORP	1,250	4,375.00	5,468,750.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	421,700	613.00	258,502,100.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	205,000	66.00	13,530,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	16,000	160.00	2,560,000.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	6,000	320.50	1,923,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	42,000	29.40	1,234,800.00	
	新台湾ドル 小計	5,519,764		575,700,863.05 (2,280,293,548)	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	13,868	493.10	6,838,310.80	
	COAL INDIA LTD	25,983	154.70	4,019,570.10	

HINDUSTAN PETROLEUM CORP	13,029	274.15	3,571,900.35	
INDIAN OIL CORP LTD	35,280	115.25	4,066,020.00	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	37,490	123.95	4,646,885.50	
PETRONET LNG LTD	12,992	231.05	3,001,801.60	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	49,019	2,368.45	116,099,050.55	
ACC LTD	1,105	2,442.95	2,699,459.75	
AMBUJA CEMENTS LTD	11,501	432.45	4,973,607.45	
ASIAN PAINTS LTD	6,669	3,362.50	22,424,512.50	
BERGER PAINTS INDIA LTD	4,076	834.85	3,402,848.60	
GRASIM INDUSTRIES LTD	4,259	1,611.80	6,864,656.20	
HINDALCO INDUSTRIES LTD	27,638	477.95	13,209,582.10	
JSW STEEL LTD	14,917	693.65	10,347,177.05	
PI INDUSTRIES LTD	1,583	3,497.60	5,536,700.80	
PIDILITE INDUSTRIES LTD	2,744	2,408.85	6,609,884.40	
SHREE CEMENT LTD	197	30,658.50	6,039,724.50	
TATA STEEL LTD	12,568	1,452.30	18,252,506.40	
ULTRATECH CEMENT LTD	1,770	7,856.45	13,905,916.50	
UPL LTD	9,171	752.50	6,901,177.50	
VEDANTA LTD	18,209	303.20	5,520,968.80	
ADANI ENTERPRISES LTD	4,905	1,513.20	7,422,246.00	
BHARAT ELECTRONICS LTD	19,000	202.40	3,845,600.00	
HAVELLS INDIA LTD	4,513	1,465.55	6,614,027.15	
LARSEN & TOUBRO LTD	11,966	1,696.45	20,299,720.70	
SIEMENS LTD	1,348	2,207.30	2,975,440.40	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	8,215	755.40	6,205,611.00	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,108	729.10	2,995,142.80	
INTERGLOBE AVIATION LTD	1,928	1,943.00	3,746,104.00	
BAJAJ AUTO LTD	1,141	3,751.05	4,279,948.05	
BALKRISHNA INDUSTRIES LTD	1,215	2,472.50	3,004,087.50	
BHARAT FORGE LTD	4,571	780.05	3,565,608.55	
EICHER MOTORS LTD	2,214	2,820.30	6,244,144.20	
HERO MOTOCORP LTD	1,947	2,851.70	5,552,259.90	
MAHINDRA & MAHINDRA LTD	15,204	750.20	11,406,040.80	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	2,363	6,894.45	16,291,585.35	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	23,659	221.95	5,251,115.05	

MRF LTD	27	80,423.85	2,171,443.95
TATA MOTORS LTD	26,597	306.10	8,141,341.70
PAGE INDUSTRIES LTD	97	32,590.45	3,161,273.65
TITAN CO LTD	5,705	2,055.70	11,727,768.50
JUBILANT FOODWORKS LTD	1,498	4,116.00	6,165,768.00
INFO EDGE INDIA LTD	1,257	6,722.50	8,450,182.50
TRENT LTD	2,541	1,004.00	2,551,164.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	2,611	3,979.70	10,390,996.70
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,925	4,101.50	7,895,387.50
ITC LTD	47,218	216.10	10,203,809.80
NESTLE INDIA LTD	540	20,230.45	10,924,443.00
TATA CONSUMER PRODUCTS LTD	9,657	881.30	8,510,714.10
UNITED SPIRITS LTD	4,926	758.90	3,738,341.40
COLGATE PALMOLIVE (INDIA)	2,394	1,732.95	4,148,682.30
DABUR INDIA LTD	11,099	639.20	7,094,480.80
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	6,424	1,114.05	7,156,657.20
HINDUSTAN UNILEVER LTD	14,201	2,762.55	39,230,972.55
MARICO LTD	9,787	558.30	5,464,082.10
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	1,657	4,732.45	7,841,669.65
AUROBINDO PHARMA LTD	4,816	748.05	3,602,608.80
BIOCON LTD	5,970	355.70	2,123,529.00
CIPLA LTD	7,779	953.15	7,414,553.85
DIVI'S LABORATORIES LTD	2,342	5,094.85	11,932,138.70
DR. REDDY'S LABORATORIES	1,854	4,930.75	9,141,610.50
IPCA LABORATORIES LTD	1,408	2,637.50	3,713,600.00
LUPIN LTD	3,463	982.65	3,402,916.95
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	14,813	781.40	11,574,878.20
TORRENT PHARMACEUTICALS LTD	872	3,133.10	2,732,063.20
AXIS BANK LTD	39,162	794.40	31,110,292.80
BANDHAN BANK LTD	9,895	284.35	2,813,643.25
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	29,449	2,818.05	82,988,754.45
ICICI BANK LTD	88,079	707.45	62,311,488.55
KOTAK MAHINDRA BANK LTD	9,646	1,867.75	18,016,316.50
STATE BANK OF INDIA	31,136	433.00	13,481,888.00
YES BANK LTD	141,484	12.45	1,761,475.80

	BAJAJ FINANCE LTD	4,758	7,417.55	35,292,702.90	
	BAJAJ FINSERV LTD	619	16,831.25	10,418,543.75	
	CHOLAMANDALAM INVESTMENT AND	6,200	581.25	3,603,750.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,091	3,268.90	3,566,369.90	
	MUTHOOT FINANCE LTD	1,814	1,542.40	2,797,913.60	
	PIRAMAL ENTERPRISES LTD	1,715	2,648.70	4,542,520.50	
	REC LTD	14,000	157.45	2,204,300.00	
	SBI CARDS & PAYMENT SERVICES	4,350	1,061.30	4,616,655.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	3,848	1,352.80	5,205,574.40	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	12,966	739.20	9,584,467.20	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURA	3,638	1,614.70	5,874,278.60	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA	6,031	689.90	4,160,786.90	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	7,961	1,170.90	9,321,534.90	
	DLF LTD	9,206	342.30	3,151,213.80	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	18,795	1,238.65	23,280,426.75	
	INFOSYS LTD	58,534	1,686.15	98,697,104.10	
	LARSEN & TOUBRO INFOTECH LTD	748	5,580.40	4,174,139.20	
	TATA CONSULTANCY SVCS LTD	15,906	3,885.90	61,809,125.40	
	TECH MAHINDRA LTD	10,942	1,452.05	15,888,331.10	
	WIPRO LTD	23,830	673.45	16,048,313.50	
	BHARTI AIRTEL LTD	42,745	694.20	29,673,579.00	
	INDUS TOWERS LTD	13,541	246.25	3,334,471.25	
	ADANI GREEN ENERGY LTD	7,171	1,149.40	8,242,347.40	
	ADANI TOTAL GAS LTD	5,050	1,375.00	6,943,750.00	
	ADANI TRANSMISSION LTD	5,050	1,942.70	9,810,635.00	
	GAIL INDIA LTD	24,471	156.00	3,817,476.00	
	INDRAPRASTHA GAS LTD	4,716	587.00	2,768,292.00	
	NTPC LTD	78,280	115.90	9,072,652.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	57,784	174.10	10,060,194.40	
	インドルピー 小計	1,400,454		1,219,683,329.40 (1,829,524,994)	
カタールリアル	QATAR FUEL QSC	9,835	17.97	176,734.95	
	QATAR GAS TRANSPORT(NAKILAT)	37,051	3.07	113,820.67	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDI	75,832	2.09	158,640.54	
	INDUSTRIES QATAR	23,913	13.28	317,564.64	

	COMMERCIAL BANK PQSC	33,159	6.00	199,186.11	
	MASRAF AL RAYAN	59,948	4.47	268,267.30	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	15,043	9.67	145,601.19	
	QATAR ISLAMIC BANK	18,726	18.19	340,625.94	
	QATAR NATIONAL BANK	78,198	19.05	1,489,671.90	
	BARWA REAL ESTATE CO	40,684	3.09	125,713.56	
	OOREDOO QPSC	12,412	6.97	86,536.46	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8,098	16.66	134,912.68	
	カタールリアル 小計	412,899		3,557,275.94 (106,006,823)	
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LTD	4,207	189.25	796,174.75	
	AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	1,637	236.75	387,559.75	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	852	1,365.50	1,163,406.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	6,642	225.35	1,496,774.70	
	GOLD FIELDS LTD	15,692	127.26	1,996,963.92	
	HARMONY GOLD MINING CO LTD	10,759	48.14	517,938.26	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	13,769	176.55	2,430,916.95	
	KUMBA IRON ORE LTD	1,067	607.18	647,861.06	
	SASOL LTD	9,989	235.20	2,349,412.80	
	SIBANYE STILLWATER LTD	48,590	50.65	2,461,083.50	
	BIDVEST GROUP LTD	5,290	193.89	1,025,678.10	
	MULTICHOICE GROUP LTD	6,108	105.99	647,386.92	
	MR PRICE GROUP LTD	4,651	202.13	940,106.63	
	NASPERS LTD-N SHS	3,738	2,380.17	8,897,075.46	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	16,364	59.99	981,676.36	
	BID CORP LTD	5,393	309.14	1,667,192.02	
	CLICKS GROUP LTD	4,471	305.15	1,364,325.65	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	8,180	181.31	1,483,115.80	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	3,680	202.25	744,280.00	
	TIGER BRANDS LTD	3,270	182.06	595,336.20	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	6,295	233.59	1,470,449.05	
	ABSA GROUP LTD	11,483	151.87	1,743,923.21	
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	1,396	1,910.00	2,666,360.00		
NEDBANK GROUP LTD	6,855	177.45	1,216,419.75		
STANDARD BANK GROUP LTD	22,324	147.36	3,289,664.64		

	FIRSTRAND LTD	88,568	60.69	5,375,191.92	
	REINET INVESTMENTS SCA	2,213	266.62	590,030.06	
	REMGRO LTD	8,773	119.41	1,047,583.93	
	DISCOVERY LTD	7,125	128.25	913,781.25	
	OLD MUTUAL LTD	76,960	16.06	1,235,977.60	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	10,014	31.22	312,637.08	
	SANLAM LTD	33,503	62.43	2,091,592.29	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	7,950	102.23	812,728.50	
	MTN GROUP LTD	29,214	125.87	3,677,166.18	
	VODACOM GROUP LTD	11,161	136.73	1,526,043.53	
	南アフリカランド 小計	498,183		60,563,813.82	(463,313,175)
アラブディルハム	ABU DHABI NATIONAL OIL CO FO	36,436	4.38	159,589.68	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	44,749	7.69	344,119.81	
	ABU DHABI ISLAMIC BANK	20,373	5.64	114,903.72	
	DUBAI ISLAMIC BANK	33,804	4.97	168,005.88	
	EMIRATES NBD PJSC	44,336	14.05	622,920.80	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	75,684	18.00	1,362,312.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	63,815	4.17	266,108.55	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	66,398	4.14	274,887.72	
	EMIRATES TELECOM GROUP CO	30,436	24.40	742,638.40	
	アラブディルハム 小計	416,031		4,055,486.56	(121,259,048)
クウェートディナール	AGILITY	18,700	0.99	18,569.10	
	BOUBYAN BANK K.S.C	21,129	0.78	16,480.62	
	KUWAIT FINANCE HOUSE	80,584	0.82	66,562.38	
	NATIONAL BANK OF KUWAIT	117,983	0.94	111,729.90	
	MABANEE CO KPSC	7,811	0.78	6,131.63	
	MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	35,345	0.60	21,242.34	
	クウェートディナール 小計	281,552		240,715.97	(87,981,687)
オフショア人民元	CHINA MERCHANTS ENERGY -A	2,400	5.44	13,056.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-A	32,500	4.65	151,125.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO-A	5,500	23.16	127,380.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRAN-A	3,400	6.04	20,536.00	

GUANGHUI ENERGY CO LTD-A	1,100	8.45	9,295.00
OFFSHORE OIL ENGINEERING-A	500	4.94	2,470.00
PETROCHINA CO LTD-A	21,700	5.71	123,907.00
SHAANXI COAL INDUSTRY CO L-A	9,500	15.70	149,150.00
SHANXI COKING COAL ENERGY-A	8,520	14.32	122,006.40
SHANXI LU'AN ENVIRONMENTAL-A	300	18.04	5,412.00
SHANXI MEIJIN ENERGY CO LT-A	3,700	12.88	47,656.00
YANTAI JEREH OILFIELD-A	900	44.66	40,194.00
YANZHOU COAL MINING CO-A	991	33.30	33,000.30
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-A	12,700	9.66	122,682.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A	3,900	48.50	189,150.00
ANHUI HONGLU STEEL CONSTRU-A	500	50.30	25,150.00
BAOSHAN IRON & STEEL CO-A	30,600	11.04	337,824.00
BBMG CORPORATION-A	900	2.96	2,664.00
CHIFENG JILONG GOLD MINING-A	2,400	16.70	40,080.00
CHINA JUSHI CO LTD -A	3,314	20.74	68,732.36
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-A	17,200	7.89	135,708.00
CHINA NORTHERN RARE EARTH -A	3,500	57.47	201,145.00
GEM CO LTD-A	3,500	13.13	45,955.00
GUANGDONG HONGDA BLASTING -A	500	28.81	14,405.00
GUANGZHOU TINCI MATERIALS -A	1,190	148.28	176,453.20
HENGLI PETROCHEMICAL CO L-A	5,720	30.09	172,114.80
HENGYI PETROCHEMICAL CO -A	1,950	12.52	24,414.00
HESTEEL CO LTD-A	1,500	3.23	4,845.00
HUAFON CHEMICAL CO LTD -A	4,600	14.41	66,286.00
HUAXIN CEMENT CO LTD-A	1,100	26.00	28,600.00
HUNAN VALIN STEEL CO LTD -A	3,500	8.41	29,435.00
INNER MONGOLIA BAOTOU STE-A	44,300	3.66	162,138.00
INNER MONGOLIA JUNZHENG EN-A	3,500	6.24	21,840.00
JIANGSU EASTERN SHENGHONG -A	3,200	38.50	123,200.00
JIANGSU SHAGANG CO LTD -A	1,900	7.80	14,820.00
JIANGSU YANGNONG CHEMICAL -A	300	122.00	36,600.00
JIANGSU YOKE TECHNOLOGY-A	500	84.80	42,400.00
JIANGXI COPPER CO LTD-A	2,000	28.57	57,140.00
JIANGXI GANFENG LITHIUM CO-A	1,100	181.80	199,980.00

KINGFA SCI.& TECH CO LTD-A	3,200	16.24	51,968.00
LB GROUP CO LTD-A	1,700	36.06	61,302.00
LUXI CHEMICAL GROUP CO LT-A	1,900	23.43	44,517.00
NINGXIA BAOFENG ENERGY GRO-A	6,100	16.77	102,297.00
PANGANG GROUP VANADIUM TIT-A	7,200	4.52	32,544.00
RONGSHENG PETRO CHEMICAL-A	10,050	22.40	225,120.00
SHANDONG GOLD MINING CO LT-A	3,468	21.25	73,695.00
SHANDONG HUALU HENGSHENG-A	1,820	39.00	70,980.00
SHANDONG NANSHAN ALUMINUM-A	10,000	5.41	54,100.00
SHANDONG SUN PAPER INDUSTR-A	2,200	13.04	28,688.00
SHANGHAI PUTAILAI NEW ENER-A	720	176.29	126,928.80
SHANXI TAIGANG STAINLESS-A	4,800	12.06	57,888.00
SHENGHE RESOURCES HOLDINGS-A	1,700	27.73	47,141.00
SHENZHEN CAPCHEM TECHNOLOG-A	600	144.41	86,646.00
SINOMA SCIENCE&TECHNOLOGY -A	2,200	37.28	82,016.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHE-A	600	4.72	2,832.00
SKSHU PAINT CO LTD-A	560	121.00	67,760.00
TANGSHAN JIDONG CEMENT INV-A	1,100	14.20	15,620.00
TONGKUN GROUP CO LTD-A	1,500	27.10	40,650.00
TONGLING NONFERROUS METALS-A	23,500	5.30	124,550.00
TRANSFAR ZHILIAN CO LTD-A	1,300	8.93	11,609.00
WANHUA CHEMICAL GROUP CO -A	3,800	112.22	426,436.00
WEIHAI GUANGWEI COMPOSITES-A	400	70.36	28,144.00
XIAMEN TUNGSTEN CO LTD-A	1,200	31.07	37,284.00
YINTAI GOLD CO LTD-A	2,380	9.76	23,228.80
YUNNAN ALUMINIUM CO LTD-A	3,100	22.20	68,820.00
YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL C	900	310.08	279,072.00
ZHEJIANG HUAYOU COBALT CO -A	1,160	114.43	132,738.80
ZHEJIANG JUHUA CO-A	2,300	15.75	36,225.00
ZHEJIANG LONGSHENG GROUP C-A	3,200	14.67	46,944.00
ZHEJIANG SATELLITE PETROCH-A	1,680	45.92	77,145.60
ZHONGJIN GOLD CORP-A	4,700	9.19	43,193.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-A	26,500	11.72	310,580.00
AECC AERO-ENGINE CONTROL-A	1,000	25.99	25,990.00
AECC AVIATION POWER CO-A	2,500	56.92	142,300.00

AVIC ELECTROMECHANICAL SY-A	3,000	13.88	41,640.00
AVICOPTER PLC-A	500	57.20	28,600.00
BEIJING NEW BUILDING MATER-A	1,400	35.49	49,686.00
BEIJING UNITED INFORMATION-A	400	113.69	45,476.00
CHINA BAOAN GROUP-A	4,500	22.44	100,980.00
CHINA CSSC HOLDINGS LTD-A	4,400	25.11	110,484.00
CHINA NATIONAL CHEMICAL-A	9,700	12.91	125,227.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-A	21,400	6.17	132,038.00
CHINA STATE CONSTRUCTION -A	56,800	5.09	289,112.00
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A	2,500	529.90	1,324,750.00
CRRC CORP LTD-A	35,700	6.54	233,478.00
DONGFANG ELECTRIC CORP LTD-A	600	16.68	10,008.00
EVE ENERGY CO LTD-A	1,820	96.61	175,830.20
FANGDA CARBON NEW MATERIAL-A	417	12.28	5,120.76
GOTION HIGH-TECH CO LTD-A	1,000	56.81	56,810.00
GUANGDONG KINLONG HARDWARE-A	400	145.01	58,004.00
HANGZHOU OXYGEN PLANT GROU-A	2,000	32.20	64,400.00
HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC-A	600	42.24	25,344.00
HONGFA TECHNOLOGY CO LTD-A	300	62.60	18,780.00
JIANGSU HENGLI HYDRAULIC C-A	2,036	89.90	183,036.40
JIANGSU ZHONGTIAN TECHNOLO-A	2,600	8.52	22,152.00
METALLURGICAL CORP OF CHIN-A	21,800	5.36	116,848.00
MING YANG SMART ENERGY GRO-A	4,000	22.30	89,200.00
NARI TECHNOLOGY CO LTD-A	7,646	31.68	242,225.28
POWER CONSTRUCTION CORP OF-A	23,000	8.51	195,730.00
RIYUE HEAVY INDUSTRY CO LT-A	2,000	32.87	65,740.00
SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD-A	8,200	27.01	221,482.00
SHANGHAI CONSTRUCTION GROU-A	5,600	3.03	16,968.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-A	10,400	4.59	47,736.00
SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO-A	2,700	68.15	184,005.00
SICHUAN ROAD&BRIDGE CO LT-A	9,000	8.81	79,290.00
SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A	1,500	135.29	202,935.00
SUNWODA ELECTRONIC CO LTD-A	1,300	37.00	48,100.00
SUZHOU GOLD MANTIS CONSTR -A	400	6.97	2,788.00
SUZHOU MAXWELL TECHNOLOGIE-A	160	639.09	102,254.40

TBEA CO LTD-A	2,100	25.85	54,285.00	
TOPSEC TECHNOLOGIES GROUP -A	900	16.30	14,670.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-A	5,900	18.35	108,265.00	
WUXI SHANGJI AUTOMATION CO-A	500	292.36	146,180.00	
XCMG CONSTRUCTION MACHIN-A	7,700	6.94	53,438.00	
XIAMEN C & D INC-A	300	9.01	2,703.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TECH-A	3,400	17.18	58,412.00	
YANTAI EDDIE PRECISION MAC-A	980	37.80	37,044.00	
YUTONG BUS CO LTD-A	200	11.47	2,294.00	
ZHEFU HOLDING GROUP CO LTD-A	5,300	6.92	36,676.00	
ZHEJIANG CHINT ELECTRICS-A	2,000	54.65	109,300.00	
ZHEJIANG DINGLI MACHINERY -A	420	65.20	27,384.00	
ZHEJIANG HANGKE TECHNOLOGY-A	800	94.03	75,224.00	
ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN-A	2,990	24.00	71,760.00	
ZHEJIANG WEIXING NEW BUILD-A	1,300	18.71	24,323.00	
ZHUZHOU KIBING GROUP CO LT-A	4,000	22.52	90,080.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY S-A	6,400	8.72	55,808.00	
BEIJING ORIGINWATER TECHNO-A	2,600	8.25	21,450.00	
SHANGHAI M&G STATIONERY IN-A	800	64.23	51,384.00	
AIR CHINA LTD-A	6,400	7.32	46,848.00	
BEIJING-SHANGHAI HIGH SPE-A	40,800	4.78	195,024.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-A	10,800	4.80	51,840.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-A	9,100	5.91	53,781.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO-A	12,870	22.07	284,040.90	
S F HOLDING CO LTD-A	4,300	63.81	274,383.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A	1,000	43.32	43,320.00	
SHANGHAI INTERNATIONAL POR-A	8,900	6.17	54,913.00	
SINOTRANS LIMITED-A	2,000	5.75	11,500.00	
SPRING AIRLINES CO LTD-A	900	54.35	48,915.00	
YTO EXPRESS GROUP CO LTD-A	4,000	12.45	49,800.00	
YUNDA HOLDING CO LTD-A	1,170	18.72	21,902.40	
BYD CO LTD -A	2,100	269.23	565,383.00	
CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A	200	185.39	37,078.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOB-A	6,020	19.15	115,283.00	
FAW JIEFANG GROUP CO LTD-A	3,200	11.63	37,216.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-A	1,900	46.90	89,110.00	
GREAT WALL MOTOR CO LTD-A	3,300	62.80	207,240.00	
HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS -A	3,000	23.43	70,290.00	
KUANG-CHI TECHNOLOGIES CO-A	2,200	23.59	51,898.00	
NINGBO JOYSON ELECTRONIC -A	1,200	18.90	22,680.00	
NINGBO TUOPU GROUP CO LTD-A	800	36.06	28,848.00	
SAIC MOTOR CORP LTD-A	6,910	20.43	141,171.30	
SAILUN GROUP CO LTD-A	3,100	10.10	31,310.00	
SHANDONG LINGLONG TYRE CO -A	1,300	32.21	41,873.00	
WEIFU HIGH-TECHNOLOGY GRP-A	100	21.94	2,194.00	
ECOVACS ROBOTICS CO LTD-A	600	149.70	89,820.00	
GUANGDONG XINBAO ELECTRICA-A	800	21.15	16,920.00	
HAIER SMART HOME CO LTD-A	5,700	26.64	151,848.00	
HANG ZHOU GREAT STAR INDUS-A	1,100	31.92	35,112.00	
HANGZHOU ROBAM APPLIANCES-A	1,000	35.47	35,470.00	
HUIZHOU DESAY SV AUTOMOTIV-A	500	83.45	41,725.00	
JASON FURNITURE HANGZHOU C-A	800	67.25	53,800.00	
JOYOUNG CO LTD -A	600	21.65	12,990.00	
MIDEA GROUP CO LTD-A	4,500	68.43	307,935.00	
NAVINFO CO LTD-A	900	11.93	10,737.00	
OPPEIN HOME GROUP INC-A	540	143.85	77,679.00	
SHENZHEN MTC CO LTD -A	4,500	5.44	24,480.00	
SUOFEIYA HOME COLLECTION C-A	400	18.71	7,484.00	
TCL TECHNOLOGY GROUP CORP-A	14,100	7.05	99,405.00	
XIAMEN INTRETECH INC-A	510	31.56	16,095.60	
ZHEJIANG SEMIR GARMENT CO-A	400	8.65	3,460.00	
ZHEJIANG SUPOR CO LTD -A	300	47.30	14,190.00	
OFFCN EDUCATION TECHNOLOGY-A	1,000	12.22	12,220.00	
SHANGHAI JINJIANG INTERNAT-A	600	44.50	26,700.00	
SHENZHEN OVERSEAS CHINESE-A	8,300	7.00	58,100.00	
SONGCHENG PERFORMANCE DEVE-A	1,080	14.89	16,081.20	
BEIJING ENLIGHT MEDIA CO L-A	1,300	9.71	12,623.00	
CHINA SOUTH PUBLISHING -A	200	9.09	1,818.00	
FOCUS MEDIA INFORMATION TE-A	12,100	7.25	87,725.00	
G-BITS NETWORK TECHNOLOGY XI	100	405.25	40,525.00	

GIANT NETWORK GROUP CO LTD-A	200	11.00	2,200.00	
KUNLUN TECH CO LTD-A	800	19.08	15,264.00	
LEO GROUP CO LTD-A	4,100	2.86	11,726.00	
MANGO EXCELLENT MEDIA CO L-A	3,110	43.07	133,947.70	
NANJI E-COMMERCE CO LTD-A	1,100	7.86	8,646.00	
PERFECT WORLD CO LTD-A	1,350	16.52	22,302.00	
WUHU SANQI INTERACTIVE ENT-A	900	21.15	19,035.00	
ZHEJIANG CENTURY HUATONG -A	3,000	6.98	20,940.00	
CHINA TOURISM GROUP DUTY F-A	1,900	246.85	469,015.00	
LIAONING CHENG DA CO LTD-A	200	24.80	4,960.00	
SHANGHAI YUYUAN TOURIST MA-A	5,000	10.14	50,700.00	
SUNING.COM CO LTD-A	9,100	5.32	48,412.00	
WANGFUJING GROUP CO LTD-A	800	30.75	24,600.00	
WUCHAN ZHONGDA GROUP CO L-A	6,000	6.88	41,280.00	
DASHENLIN PHARMACEUTICAL G-A	720	41.84	30,124.80	
LAOBAIXING PHARMACY CHAIN-A	280	47.43	13,280.40	
SHANGHAI BAILIAN GROUP CO-A	1,700	14.13	24,021.00	
YIFENG PHARMACY CHAIN CO L-A	546	51.52	28,129.92	
YIXINTANG PHARMACEUTICAL G-A	600	28.58	17,148.00	
YONGHUI SUPERSTORES CO LTD-A	3,100	3.99	12,369.00	
ANGEL YEAST CO LTD-A	700	43.24	30,268.00	
ANHUI GUJING DISTILLERY CO-A	300	220.58	66,174.00	
ANHUI KOUZI DISTILLERY CO -A	500	50.70	25,350.00	
BEIJING DABEINONG TECHNOLO-A	500	7.82	3,910.00	
BEIJING SHUNXIN AGRICULT-A	600	32.50	19,500.00	
BEIJING YANJING BREWERY CO-A	2,400	6.69	16,056.00	
CHACHA FOOD CO LTD-A	400	41.51	16,604.00	
CHONGQING BREWERY CO-A	400	134.18	53,672.00	
CHONGQING FULING ZHACAI-A	700	26.89	18,823.00	
FOSHAN HAITIAN FLAVOURING -A	3,390	88.18	298,930.20	
FU JIAN ANJOY FOODS CO LTD-A	400	169.55	67,820.00	
FUJIAN SUNNER DEVELOPMENT-A	900	19.18	17,262.00	
GUANGDONG HAID GROUP CO-A	2,600	60.41	157,066.00	
HEILONGJIANG AGRICULTURE-A	2,500	15.00	37,500.00	
HENAN SHUANGHUI INVESTMENT-A	2,400	25.11	60,264.00	

INNER MONGOLIA YILI INDUS-A	5,900	35.47	209,273.00
JIANGSU KING'S LUCK BREWER-A	1,000	43.83	43,830.00
JIANGSU YANGHE BREWERY -A	1,400	172.20	241,080.00
JIANGXI ZHENGBANG TECH -A	2,000	8.57	17,140.00
JIUGUI LIQUOR CO LTD-A	400	235.95	94,380.00
JONJEE HIGH-TECH INDUSTRIA-A	300	30.74	9,222.00
JUEWEI FOOD CO LTD-A	300	60.70	18,210.00
KWEICHOW MOUTAI CO LTD-A	1,300	1,657.00	2,154,100.00
LUZHOU LAOJIAO CO LTD-A	1,400	181.52	254,128.00
MUYUAN FOODSTUFF CO LTD-A	5,016	43.21	216,741.36
NEW HOPE LIUHE CO LTD-A	2,600	11.64	30,264.00
QIANHE CONDIMENT AND FOOD-A	800	17.58	14,064.00
SHANGHAI BAIRUN INVESTMENT-A	980	62.94	61,681.20
SHANXI XINGHUACUN FEN WINE-A	1,520	299.59	455,376.80
SICHUAN SWELLFUN CO LTD-A	400	121.99	48,796.00
TOLY BREAD CO LTD-A	700	28.70	20,090.00
TONGWEI CO LTD-A	4,400	51.97	228,668.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-A	900	85.77	77,193.00
WENS FOODSTUFFS GROUP CO - A	5,660	13.19	74,655.40
WULIANGYE YIBIN CO LTD-A	4,300	205.73	884,639.00
YIHAI KERRY ARAWANA HOLDIN-A	2,200	66.74	146,828.00
YUAN LONGPING HIGH-TECH AG-A	1,100	21.83	24,013.00
BY-HEALTH CO LTD-A	1,300	27.04	35,152.00
C&S PAPER CO LTD-A	1,000	16.87	16,870.00
PROYA COSMETICS CO LTD-A	100	173.37	17,337.00
SHANGHAI JAHWA UNITED CO -A	600	43.44	26,064.00
AIER EYE HOSPITAL GROUP CO-A	5,565	46.90	260,998.50
AUTOBIO DIAGNOSTICS CO LTD-A	630	49.96	31,474.80
CHINA NATIONAL MEDICINES-A	400	30.06	12,024.00
GUANGZHOU KINGMED DIAGNOST-A	700	97.50	68,250.00
GUANGZHOU WONDFO BIOTECH C-A	390	39.98	15,592.20
HUADONG MEDICINE CO LTD-A	1,740	30.43	52,948.20
INTCO MEDICAL TECHNOLOGY C-A	300	97.82	29,346.00
JAFRON BIOMEDICAL CO LTD-A	1,180	49.62	58,551.60
JIANGSU YUYUE MEDICAL EQU-A	500	32.18	16,090.00

JOINTOWN PHARMACEUTICAL-A	200	15.94	3,188.00
LEPU MEDICAL TECHNOLOGY-A	700	26.22	18,354.00
MEINIAN ONEHEALTH HEALTHCA-A	480	7.85	3,768.00
OVCTEK CHINA INC-A	920	68.80	63,296.00
SHANDONG PHARMACEUTICAL - A	600	32.03	19,218.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-A	2,000	20.01	40,020.00
SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A	1,500	339.10	508,650.00
TOPCHOICE MEDICAL CORPORAT-A	300	243.50	73,050.00
WINNING HEALTH TECHNOLOGY-A	1,040	14.22	14,788.80
APELOA PHARMACEUTICAL CO-A	900	34.45	31,005.00
ASYMCHEM LABORATORIES TIAN-A	200	405.88	81,176.00
BEIJING TIAN TAN BIOLOGICAL-A	1,080	34.09	36,817.20
BEIJING WANTAI BIOLOGICAL-A	700	180.50	126,350.00
BETTA PHARMACEUTICALS CO L-A	300	87.00	26,100.00
BGI GENOMICS CO LTD-A	300	96.19	28,857.00
CANSINO BIOLOGICS INC-A	200	351.50	70,300.00
CHANGCHUN HIGH & NEW TECH-A	400	244.43	97,772.00
CHINA RESOURCES SANJIU MED-A	100	27.92	2,792.00
CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICA-A	2,000	157.80	315,600.00
DAAN GENE CO LTD-A	960	20.19	19,382.40
DONG-E-E-JIAOCO LTD-A	100	34.00	3,400.00
GUANGZHOU BAIYUNSHAN PHAR-A	1,400	31.05	43,470.00
HANGZHOU TIGERMED CONSULTI-A	300	157.00	47,100.00
HUALAN BIOLOGICAL ENGINEER-A	1,780	28.80	51,264.00
HUMANWELL HEALTHCARE GROUP-A	1,400	20.84	29,176.00
IMEIK TECHNOLOGY DEVELOPME-A	300	533.25	159,975.00
JIANGSU HENGRUI MEDICINE C-A	8,016	46.80	375,148.80
JILIN AODONG PHARMACEUTICA-A	1,000	18.48	18,480.00
JOINCARE PHARMACEUTICAL GR-A	1,600	11.97	19,152.00
JOINN LABORATORIES CHINA C-A	560	152.09	85,170.40
LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-A	500	40.42	20,210.00
MACCURA BIOTECH CO LTD-A	1,000	28.04	28,040.00
NANJING KING-FRIEND BIOCHE-A	845	29.20	24,674.00
PHARMARON BEIJING CO LTD-A	700	204.88	143,416.00
SHANDONG BUCHANG PHARMACEU-A	260	19.10	4,966.00

SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-A	1,900	63.01	119,719.00
SHANGHAI RAAS BLOOD PRODUC-A	2,900	7.06	20,474.00
SHENZHEN HEPALINK PHARMACE-A	900	16.12	14,508.00
SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICA-A	600	113.01	67,806.00
SHENZHEN SALUBRIS PHARM-A	100	27.55	2,755.00
SHIJIAZHUANG YILING PHARMA-A	1,400	17.40	24,360.00
SICHUAN KELUN PHARMACEUTIC-A	200	18.30	3,660.00
TONGHUA DONGBAO PHARMACEUT-A	200	10.91	2,182.00
WALVAX BIOTECHNOLOGY CO-A	1,500	71.32	106,980.00
WUXI APPTec CO LTD-A	3,128	141.96	444,050.88
YIFAN PHARMACEUTICAL CO LT-A	1,000	16.65	16,650.00
YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD-A	1,100	98.10	107,910.00
ZHANGZHOU PIENZEHUANG PHA-A	600	339.76	203,856.00
ZHEJIANG HUAHAI PHARMACEUT-A	1,210	16.93	20,485.30
ZHEJIANG JIUZHOU PHARMACEU-A	1,300	44.28	57,564.00
ZHEJIANG NHU CO LTD-A	2,136	29.85	63,759.60
ZHEJIANG WOLWO BIO-PHARMAC-A	400	52.12	20,848.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-A	70,900	2.99	211,991.00
BANK OF BEIJING CO LTD -A	18,700	4.45	83,215.00
BANK OF CHENGDU CO LTD-A	1,500	12.82	19,230.00
BANK OF CHINA LTD-A	33,600	3.06	102,816.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-A	37,500	4.54	170,250.00
BANK OF HANGZHOU CO LTD-A	5,800	14.97	86,826.00
BANK OF JIANGSU CO LTD-A	14,900	6.36	94,764.00
BANK OF NANJING CO LTD -A	8,900	9.46	84,194.00
BANK OF NINGBO CO LTD -A	7,900	34.68	273,972.00
BANK OF SHANGHAI CO LTD-A	13,610	7.41	100,850.10
CHINA CONSTRUCTION BANK-A	9,200	6.15	56,580.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO-A	34,900	3.48	121,452.00
CHINA MERCHANTS BANK-A	22,300	52.10	1,161,830.00
CHINA MINSHENG BANKING-A	29,800	4.03	120,094.00
CHINA ZHESHANG BANK CO LTD-A	16,900	3.57	60,333.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-A	8,500	3.97	33,745.00
HUAXIA BANK CO LTD-A	12,300	5.69	69,987.00
IND & COMM BK OF CHINA-A	77,400	4.71	364,554.00

INDUSTRIAL BANK CO LTD -A	24,500	19.16	469,420.00
JIANGSU CHANGSHU RURAL COMME	5,300	6.36	33,708.00
PING AN BANK CO LTD-A	23,000	19.37	445,510.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHI-A	39,000	5.30	206,700.00
QINGDAO RURAL COMMERCIAL B-A	5,300	3.97	21,041.00
SHANGHAI PUDONG DEVEL BANK-A	27,500	9.21	253,275.00
AVIC INDUSTRY-FINANCE HOLD-A	900	4.01	3,609.00
BOC INTERNATIONAL CHINA CO-A	3,000	15.42	46,260.00
CAITONG SECURITIES CO LTD-A	1,500	11.19	16,785.00
CHANGJIANG SECURITIES CO L-A	6,800	7.97	54,196.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-A	2,800	10.96	30,688.00
CHINA GREAT WALL SECURITIE-A	3,000	13.38	40,140.00
CHINA INTERNATIONAL CAPTAL-A	1,200	57.71	69,252.00
CHINA MERCHANTS SECURITIES-A	6,700	19.10	127,970.00
CITIC SECURITIES CO-A	11,100	26.48	293,928.00
CSC FINANCIAL CO LTD-A	5,000	31.11	155,550.00
DONGXING SECURITIES CO LT-A	200	11.67	2,334.00
EAST MONEY INFORMATION CO-A	10,104	35.40	357,681.60
EVERBRIGHT SECURITIE CO -A	3,200	16.44	52,608.00
FIRST CAPITAL SECURITIES C-A	500	7.44	3,720.00
FOUNDER SECURITIES CO LTD-A	7,200	8.46	60,912.00
GF SECURITIES CO LTD-A	5,900	24.28	143,252.00
GUANGZHOU YUEXIU FINANCIAL-A	3,240	8.76	28,382.40
GUOLIAN SECURITIES CO LTD-A	2,200	13.63	29,986.00
GUOSEN SECURITIES CO LTD-A	4,600	12.01	55,246.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO-A	6,900	18.39	126,891.00
GUOYUAN SECURITIES CO LTD-A	500	8.11	4,055.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-A	8,900	12.38	110,182.00
HITHINK ROYALFLUSH INFORMA-A	500	136.23	68,115.00
HUAAN SECURITIES CO LTD-A	400	5.59	2,236.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-A	11,600	18.56	215,296.00
HUAXI SECURITIES CO LTD-A	300	9.93	2,979.00
INDUSTRIAL SECURITIES CO-A	6,700	10.97	73,499.00
NANJING SECURITIES CO LTD-A	1,600	10.27	16,432.00
NORTHEAST SECURITIES CO LT-A	3,000	9.00	27,000.00

ORIENT SECURITIES CO LTD-A	5,200	17.22	89,544.00
PACIFIC SECURITIES CO/THE-A	3,200	3.47	11,104.00
SDIC CAPITAL CO LTD-A	5,472	9.21	50,397.12
SEALAND SECURITIES CO LTD -A	2,500	4.28	10,700.00
SHANXI SECURITIES CO LTD-A	400	6.81	2,724.00
SHENWAN HONGYUAN GROUP CO-A	27,200	6.15	167,280.00
SINOLINK SECURITIES CO LTD-A	4,300	11.63	50,009.00
SOOCHOW SECURITIES CO LTD-A	300	9.57	2,871.00
SOUTHWEST SECURITIES CO LT-A	3,800	5.34	20,292.00
TIANFENG SECURITIES CO LTD-A	4,300	4.55	19,565.00
WESTERN SECURITIES CO LTD-A	500	8.26	4,130.00
ZHESHANG SECURITIES CO LTD-A	1,300	12.82	16,666.00
ZHONGTAI SECURITIES CO LTD-A	10,500	10.39	109,095.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-A	2,500	30.91	77,275.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-A	6,700	27.70	185,590.00
HUBEI BIOCAUSE PHARMACEUTI-A	600	3.57	2,142.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-A	1,900	41.79	79,401.00
PICC HOLDING CO-A	3,500	5.20	18,200.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-A	12,400	49.86	618,264.00
CHINA MERCHANTS PROPERTY O-A	700	13.38	9,366.00
CHINA MERCHANTS SHEKOU IND-A	8,000	10.36	82,880.00
CHINA VANKE CO LTD -A	12,800	20.13	257,664.00
FINANCIAL STREET HOLDINGS-A	400	6.21	2,484.00
FUTURE LAND HOLDINGS CO -A	2,400	35.97	86,328.00
GEMDALE CORP-A	3,300	11.97	39,501.00
GREENLAND HOLDINGS CORP LT-A	14,910	4.63	69,033.30
JIANGSU ZHONGNAN CONSTRUCT-A	3,100	4.76	14,756.00
JINKE PROPERTIES GROUP CO -A	700	4.87	3,409.00
POLY DEVELOPMENTS AND HOLD-A	12,800	12.99	166,272.00
RISESUN REAL ESTATE DEVEL-A	600	4.98	2,988.00
SHANGHAI LINGANG HOLDINGS-A	1,680	15.30	25,704.00
SHANGHAI ZHANGJIANG HIGH-A	900	17.45	15,705.00
YANGO GROUP CO LTD-A	3,400	4.57	15,538.00
YOUNGOR GROUP CO-A	3,100	6.70	20,770.00
ZHEJIANG CHINA COMMODITIES-A	13,000	4.96	64,480.00

ZHONGTIAN FINANCIAL GROUP -A	5,100	2.83	14,433.00
360 SECURITY TECHNOLOGY IN-A	12,200	12.49	152,378.00
BEIJING E-HUALU INFO TECH-A	480	34.03	16,334.40
BEIJING KINGSOFT OFFICE SO-A	600	252.99	151,794.00
BEIJING SHIJI INFORMATION -A	140	17.84	2,497.60
BEIJING SINNET TECHNOLOGY-A	700	14.07	9,849.00
CHINA NATIONAL SOFTWARE -A	200	52.22	10,444.00
CHINA TRANSINFO TECHNOLOGY-A	700	15.42	10,794.00
DHC SOFTWARE CO LTD -A	400	8.10	3,240.00
HUNDSUN TECHNOLOGIES INC-A	964	55.08	53,097.12
IFLYTEK CO LTD - A	2,500	51.05	127,625.00
LAKALA PAYMENT CO LTD-A	800	26.19	20,952.00
SANGFOR TECHNOLOGIES INC-A	400	238.69	95,476.00
SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE-A	1,920	68.96	132,403.20
THUNDER SOFTWARE TECHNOLOG-A	300	129.21	38,763.00
YONYOU NETWORK TECHNOLOGY-A	4,908	32.22	158,135.76
ADDSINO CO LTD -A	1,700	16.23	27,591.00
AVARY HOLDING SHENZHEN CO -A	2,300	30.18	69,414.00
BEIJING BDSTAR NAVIGATION -A	500	41.31	20,655.00
BEIJING YUANLIU HONGYUAN E-A	200	139.30	27,860.00
BOE TECHNOLOGY GROUP CO LT-A	50,500	5.71	288,355.00
CHAOZHOU THREE-CIRCLE GROU-A	1,800	36.70	66,060.00
CHINA GREATWALL TECHNOLOGY-A	2,600	14.52	37,752.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-A	11,000	5.29	58,190.00
FIBERHOME TELECOM TECH CO-A	1,100	18.33	20,163.00
FOXCONN INDUSTRIAL INTERNE-A	7,100	11.94	84,774.00
GOERTEK INC -A	3,300	46.78	154,374.00
GRG BANKING EQUIPMENT CO -A	2,200	10.51	23,122.00
GUANGDONG LY INTELLIGENT M-A	6,900	7.02	48,438.00
GUANGZHOU HAIGE COMMUNICAT-A	300	10.69	3,207.00
GUANGZHOU SHIYUAN ELECTRON-A	500	82.04	41,020.00
HUAGONG TECH CO LTD-A	1,000	27.48	27,480.00
INSPUR ELECTRONIC INFORMAT-A	600	29.73	17,838.00
LENS TECHNOLOGY CO LTD-A	4,600	23.98	110,308.00
LEYARD OPTOELECTRONIC CO L-A	2,300	10.54	24,242.00

LUXSHARE PRECISION INDUSTR-A	6,733	34.32	231,076.56
MAXSCEND MICROELECTRONICS -A	360	353.00	127,080.00
NINESTAR CORP-A	100	38.38	3,838.00
OFILM GROUP CO LTD-A	400	8.20	3,280.00
RAYTRON TECHNOLOGY CO LTD-A	700	90.00	63,000.00
SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD -A	4,600	23.00	105,800.00
SHENNAN CIRCUITS CO LTD-A	280	93.11	26,070.80
SHENZHEN KAIFA TECHNOLOGY-A	1,000	15.98	15,980.00
SHENZHEN SUNLORD ELECTRONI-A	800	33.94	27,152.00
SHENZHEN SUNWAY COMMUNICAT-A	900	23.68	21,312.00
SUZHOU DONGSHAN PRECISION-A	700	20.36	14,252.00
TIANJIN712 COMMUNICATION &-A	700	39.07	27,349.00
TIANMA MICROELECTRONICS-A	2,400	14.25	34,200.00
UNISPLENDOUR CORP LTD-A	1,876	24.14	45,286.64
UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUS-A	1,300	14.64	19,032.00
WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	103.72	124,464.00
WUHAN GUIDE INFRARED CO LT-A	1,904	25.57	48,685.28
WUHU TOKEN SCIENCE CO LTD-A	2,500	8.62	21,550.00
WUS PRINTED CIRCUIT KUNSHA-A	1,760	12.06	21,225.60
WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI-A	640	71.71	45,894.40
YEALINK NETWORK TECHNOLOGY-A	900	79.89	71,901.00
ZHEJIANG DAHUA TECHNOLOGY-A	2,400	24.26	58,224.00
ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD-A	500	34.32	17,160.00
ZTE CORP-A	3,800	33.50	127,300.00
CHINA UNITED NETWORK-A	46,500	4.23	196,695.00
CHINA NATIONAL NUCLEAR POW-A	26,400	6.78	178,992.00
CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A	22,900	20.09	460,061.00
ENN NATURAL GAS CO LTD-A	1,900	20.48	38,912.00
HUADIAN POWER INTL CORP-A	1,300	4.54	5,902.00
HUANENG POWER INTL INC-A	800	6.67	5,336.00
SDIC POWER HOLDINGS CO LTD-A	6,600	9.96	65,736.00
SHENERGY COMPANY LIMITED-A	700	6.77	4,739.00
SHENZHEN ENERGY GROUP CO L-A	600	8.54	5,124.00
SICHUAN CHUANTOU ENERGY CO-A	5,200	12.87	66,924.00
ADVANCED MICRO-FABRICATION-A	943	157.48	148,503.64

	FLAT GLASS GROUP CO LTD-A	1,100	49.85	54,835.00	
	GCL SYSTEM INTEGRATION TEC-A	4,300	4.46	19,178.00	
	GIGADEVICE SEMICONDUCTOR B-A	756	154.64	116,907.84	
	HANGZHOU FIRST APPLIED MAT-A	1,200	137.72	165,264.00	
	HANGZHOU SILAN MICROELECTR-A	2,000	58.63	117,260.00	
	INGENIC SEMICONDUCTOR CO -A	400	136.50	54,600.00	
	JA SOLAR TECHNOLOGY CO LTD-A	1,200	66.37	79,644.00	
	JCET GROUP CO LTD-A	1,900	33.20	63,080.00	
	LONGI GREEN ENERGY TECHNOL-A	6,240	81.91	511,118.40	
	MONTAGE TECHNOLOGY CO LTD-A	714	57.13	40,790.82	
	NATIONAL SILICON INDUSTRY -A	3,600	28.10	101,160.00	
	NAURA TECHNOLOGY GROUP CO-A	500	376.72	188,360.00	
	SANAN OPTOELECTRONICS CO L-A	4,400	33.77	148,588.00	
	SG MICRO CORP-A	450	324.60	146,070.00	
	SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY-A	250	106.01	26,502.50	
	SHENZHEN SC NEW ENERGY TEC-A	300	148.86	44,658.00	
	STARPOWER SEMICONDUCTOR LT-A	300	357.40	107,220.00	
	TIANJIN ZHONGHUAN SEMICOND-A	4,300	46.80	201,240.00	
	TIANSHUI HUATIAN TECHNOLOG-A	1,900	12.76	24,244.00	
	TONGFU MICROELECTRONIC CO-A	800	19.97	15,976.00	
	UNIGROUP GUOXIN MICROELECT-A	500	200.40	100,200.00	
	WILL SEMICONDUCTOR LTD-A	800	234.90	187,920.00	
	ZHEJIANG JINGSHENG MECHANI-A	900	70.60	63,540.00	
	オフショア人民元 小計	2,233,718		44,132,793.04 (751,581,465)	
サウジアラビア リアル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	3,931	27.15	106,726.65	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	38,107	34.95	1,331,839.65	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	1,879	71.90	135,100.10	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	6,762	21.02	142,137.24	
	NATIONAL PETROCHEMICAL CO	2,000	46.60	93,200.00	
	SABIC AGRI-NUTRIENTS CO	3,497	134.00	468,598.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	5,474	34.90	191,042.60	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	6,999	78.10	546,621.90	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	15,527	122.60	1,903,610.20	
	SAUDI CEMENT	1,265	64.00	80,960.00	

SAUDI IND INVESTMENT GROUP	2,983	35.80	106,791.40	
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	13,830	18.78	259,727.40	
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	4,534	67.70	306,951.80	
JARIR MARKETING CO	911	212.20	193,314.20	
ABDULLAH AL OTHAIM MARKETS	973	115.00	111,895.00	
ALMARAI CO	4,232	57.30	242,493.60	
SAVOLA	4,558	39.75	181,180.50	
DR SULAIMAN AL HABIB MEDICAL	786	179.00	140,694.00	
MOUWASAT MEDICAL SERVICES CO	749	182.00	136,318.00	
AL RAJHI BANK	21,069	121.80	2,566,204.20	
ALINMA BANK	16,108	23.86	384,336.88	
ARAB NATIONAL BANK	11,172	23.00	256,956.00	
BANK AL-JAZIRA	5,356	18.42	98,657.52	
BANK ALBILAD	6,762	42.40	286,708.80	
BANQUE SAUDI FRANSI	9,664	40.75	393,808.00	
RIYAD BANK	21,695	27.00	585,765.00	
SAUDI BRITISH BANK	14,383	33.25	478,234.75	
THE SAUDI NATIONAL BANK	37,761	61.10	2,307,197.10	
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	1,168	158.00	184,544.00	
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,298	95.40	123,829.20	
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	8,367	10.12	84,674.04	
EMAAR ECONOMIC CITY	4,295	12.98	55,749.10	
ETIHAD ETISALAT CO	5,584	31.20	174,220.80	
MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO	9,085	14.10	128,098.50	
SAUDI TELECOM CO	10,363	134.40	1,392,787.20	
SAUDI ELECTRICITY CO	15,559	27.25	423,982.75	
サウジアラビアリアル 小計	318,686		16,604,956.08	(486,193,114)
合 計	42,908,024		15,290,975,155	(15,290,975,155)

(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	58,900	1,294,033.00	
	メキシコペソ 小計		58,900	1,294,033.00 (7,129,474)	
	南アフリカランド	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	63,261	930,569.31	
	南アフリカランド 小計		63,261	930,569.31 (7,118,855)	
合計				14,248,329 (14,248,329)	

(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 73銘柄	100.0%		9.5%
メキシコペソ	株式 22銘柄	97.6%		1.9%
	投資証券 1銘柄		2.4%	0.0%
ブラジルリアル	株式 53銘柄	100.0%		4.8%
チリペソ	株式 13銘柄	100.0%		0.4%
コロンビアペソ	株式 5銘柄	100.0%		0.2%
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 212銘柄	100.0%		23.7%
マレーシアリンギット	株式 36銘柄	100.0%		1.3%
タイバーツ	株式 42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 23銘柄	100.0%		1.2%
韓国ウォン	株式 106銘柄	100.0%		12.7%

新台湾ドル	株式	87銘柄	100.0%		14.9%
インドルピー	株式	101銘柄	100.0%		12.0%
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	35銘柄	98.5%		3.0%
	投資証券	1銘柄		1.5%	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	482銘柄	100.0%		4.9%
サウジアラビアリアル	株式	36銘柄	100.0%		3.2%

（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 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	13,268,958
コール・ローン	36,023,863
投資信託受益証券	6,439,583,920
未収入金	35,132,300
流動資産合計	6,524,009,041
資産合計	6,524,009,041
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	14,556
未払解約金	31,055,000
未払利息	97
流動負債合計	31,069,653
負債合計	31,069,653

2021年 9月15日現在

純資産の部	
元本等	
元本	5,885,222,068
剰余金	
剰余金又は欠損金()	607,717,320
元本等合計	6,492,939,388
純資産合計	6,492,939,388
負債純資産合計	6,524,009,041

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2021年 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	4,943,476,261円
期中追加設定元本額	4,192,558,339円
期中一部解約元本額	3,250,812,532円
期末元本額	5,885,222,068円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	944,244,402円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	711,845,912円
りそなラップ型ファンド(成長型)	393,864,038円
DCりそな グローバルバランス	16,722,291円

つみたてバランスファンド	741,528,834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	119,934,381円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	77,805,563円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	22,282,210円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	14,385,909円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	7,699,349円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	11,390,599円
リスクコントロール・オープン	3,177,934円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	110,659,488円
FWりそな先進国+新興国債券アクティブファンド	49,800,958円
FWりそな新興国債券インデックスファンド	1,190,333,932円
Smart-i 8資産バランス 安定型	39,952,213円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	104,658,626円
Smart-i 8資産バランス 成長型	122,214,016円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	167,427,438円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	313,569,856円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	186,487,931円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	135,237,060円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	153,348,636円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	26,159,118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)	1,038,251円
りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	18,333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)	18,694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)	18,966円
2. 計算日における受益権の総数	5,885,222,068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	1.1033円
(10,000口当たり純資産額)	(11,033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 9月15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 9月15日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

投資信託受益証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

デリバティブ取引

(その他の注記)の2 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明

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

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

(関連当事者との取引に関する注記)

2021年 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		268,274,912
合計		268,274,912

(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 9月15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	42,349,378	-	42,334,822	14,556
	米ドル	42,349,378	-	42,334,822	14,556
	合計	42,349,378	-	42,334,822	14,556

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	ISHARES JPM EM LCL GOV BND	743,647	41,012,132.05	
		VANECK J.P.MORGAN EM LOCAL	573,532	17,716,403.48	
		米ドル 小計	1,317,179	58,728,535.53 (6,439,583,920)	
合計				6,439,583,920 (6,439,583,920)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額（単位：円）であります。

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

(注3)券面総額欄の数値は口数を表しております。

外貨建有価証券の内訳

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

(注) 時価比率は通貨ごとの有価証券の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

R M国内リートマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

2021年 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	179,252,146
投資証券	31,693,124,740
未収入金	500,253,900
未収配当金	318,082,716
前払金	1,869,000
差入委託証拠金	22,188,500
流動資産合計	32,714,771,002
資産合計	32,714,771,002
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,357,030
未払金	544,664,950
未払解約金	3,000,000
未払利息	486
流動負債合計	555,022,466
負債合計	555,022,466
純資産の部	
元本等	
元本	21,061,862,287
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,097,886,249
元本等合計	32,159,748,536
純資産合計	32,159,748,536
負債純資産合計	32,714,771,002

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 9月15日現在

1. 投資信託財産に係る元本の状況

期首	2020年 9月16日
期首元本額	16,047,301,600円
期中追加設定元本額	22,655,954,996円
期中一部解約元本額	17,641,394,309円
期末元本額	21,061,862,287円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド（安定型）	1,028,237,263円
りそなラップ型ファンド（安定成長型）	863,466,512円
りそなラップ型ファンド（成長型）	656,336,292円
DCりそな グローバルバランス	18,243,457円
つみたてバランスファンド	1,087,826,530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	86,251,564円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	55,912,118円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	15,960,733円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	10,338,803円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	5,539,030円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	8,229,565円
リスクコントロール・オープン	2,284,797円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	80,022,848円
FWりそな国内リートインデックスオープン	4,419,639,670円
FWりそな国内リートインデックスファンド	3,586,804,979円
Smart-i リートインデックス	2,499,026,341円
Smart-i 8資産バランス 安定型	28,807,408円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	75,451,573円
Smart-i 8資産バランス 成長型	87,830,121円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	120,252,934円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	225,388,191円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	134,125,257円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	96,924,784円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	110,250,723円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	18,800,064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）	1,624,224円
りそなDAAファンド（適格機関投資家専用）	429,440,769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）	19,992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）	29,391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）	43,889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	21,061,862,287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	1.5269円
(10,000口当たり純資産額)	(15,269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 9月15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 9月15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 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券		2,934,748,284
合計		2,934,748,284

(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 9月15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	476,326,030	-	468,969,000	7,357,030
	合計	476,326,030	-	468,969,000	7,357,030

（注）時価の算定方法

先物取引

国内先物取引について

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	551	75,762,500	
	サンケイリアルエステート投資法人	866	109,808,800	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1,147	202,674,900	
	東海道リート投資法人	209	22,342,100	
	日本アコモデーションファンド投資法人	944	612,656,000	
	森ヒルズリート投資法人	3,216	507,484,800	
	産業ファンド投資法人	3,883	833,680,100	
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,734	1,017,048,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,868	421,047,200	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,458	675,054,000	
	G L P 投資法人	8,858	1,689,220,600	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,231	432,696,500	
	日本プロロジスリート投資法人	4,333	1,687,703,500	
	星野リゾート・リート投資法人	422	302,996,000	
	O n e リート投資法人	426	126,692,400	
	イオンリート投資法人	3,216	471,465,600	
	ヒューリックリート投資法人	2,404	429,354,400	
	日本リート投資法人	844	370,938,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	6,083	137,962,440	
	積水ハウス・リート投資法人	8,044	756,940,400	
トーセイ・リート投資法人	571	79,369,000		
ケネディクス商業リート投資法人	1,092	327,272,400		
ヘルスケア&メディカル投資法人	583	87,216,800		

サムティ・レジデンシャル投資法人	620	75,268,000	
野村不動産マスターファンド投資法人	8,844	1,455,722,400	
いちごホテルリート投資法人	453	41,404,200	
ラサールロジポート投資法人	3,348	655,873,200	
スターアジア不動産投資法人	2,826	161,364,600	
マリモ地方創生リート投資法人	256	33,408,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,017	635,625,000	
大江戸温泉リート投資法人	441	35,676,900	
投資法人みらい	3,118	169,619,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	642	86,477,400	
三菱地所物流リート投資法人	695	350,975,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,059	223,343,100	
ザイマックス・リート投資法人	397	45,456,500	
タカラレーベン不動産投資法人	1,078	116,855,200	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,066	168,214,800	
日本ビルファンド投資法人	3,099	2,237,478,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	2,735	1,876,210,000	
日本都市ファンド投資法人	13,799	1,488,912,100	
オリックス不動産投資法人	5,449	1,071,273,400	
日本プライムリアルティ投資法人	1,797	727,785,000	
N T T 都市開発リート投資法人	2,470	380,627,000	
東急リアル・エステート投資法人	1,834	346,626,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,899	230,348,700	
ユナイテッド・アーバン投資法人	6,157	950,025,100	
森トラスト総合リート投資法人	1,955	300,874,500	
インヴィンシブル投資法人	12,037	506,757,700	
フロンティア不動産投資法人	959	457,922,500	
平和不動産リート投資法人	1,772	288,127,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	1,787	612,047,500	
福岡リート投資法人	1,414	245,329,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	846	652,266,000	
いちごオフィスリート投資法人	2,241	206,172,000	
大和証券オフィス投資法人	578	447,372,000	
阪急阪神リート投資法人	1,235	205,504,000	
スターツプロシード投資法人	426	110,035,800	
大和ハウスリート投資法人	4,106	1,400,146,000	

ジャパン・ホテル・リート投資法人	8,378	538,705,400	
大和証券リビング投資法人	3,577	424,589,900	
ジャパンエクセレント投資法人	2,538	355,320,000	
合計	163,931	31,693,124,740	

(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 9月15日現在

資産の部	
流動資産	
預金	92,462,035
コール・ローン	43,715,302
株式	90,588,377
投資証券	24,931,563,298
派生商品評価勘定	1,309,469
未収入金	265,463,564
未収配当金	47,691,453
流動資産合計	25,472,793,498
資産合計	25,472,793,498
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	101
未払解約金	358,914,900
未払利息	118
流動負債合計	358,915,119
負債合計	358,915,119
純資産の部	
元本等	
元本	18,716,106,951
剰余金	
剰余金又は欠損金()	6,397,771,428
元本等合計	25,113,878,379

2021年 9月15日現在

純資産合計	25,113,878,379
負債純資産合計	25,472,793,498

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 9月15日現在	
1. 投資信託財産に係る元本の状況	
期首	2020年 9月16日
期首元本額	22,234,195,479円
期中追加設定元本額	19,296,493,271円
期中一部解約元本額	22,814,581,799円
期末元本額	18,716,106,951円
期末元本の内訳	
りそなラップ型ファンド(安定型)	1,175,105,348円
りそなラップ型ファンド(安定成長型)	1,087,402,823円
りそなラップ型ファンド(成長型)	977,003,201円
DCりそな グローバルバランス	20,813,692円
つみたてバランスファンド	602,113,009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	127,859,693円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	36,686,587円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	23,291,679円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	12,513,026円
りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	18,930,923円
リスクコントロール・オープン	10,176,315円
埼玉りそな・グローバルバランス・プラスESG	182,637,122円
FWりそな先進国リートインデックスオープン	5,363,153,876円
FWりそな先進国リートインデックスファンド	4,217,777,881円
Smart-i 先進国リートインデックス	1,842,833,880円
Smart-i 8資産バランス 安定型	66,098,856円
Smart-i 8資産バランス 安定成長型	172,003,229円
Smart-i 8資産バランス 成長型	196,990,182円
りそな・リスクコントロールファンド2019-06	268,220,882円
りそな・リスクコントロールファンド2019-09	503,439,809円
りそな・リスクコントロールファンド2019-10	298,939,440円
りそな・リスクコントロールファンド2019-12	215,976,081円
りそな・リスクコントロールファンド2020-03	245,953,216円
りそな・リスクコントロールファンド2020-06	41,850,069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)	2,915,142円
りそなDAAファンド(適格機関投資家専用)	447,620,316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)	7,499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)	44,047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)	84,239円
2. 計算日における受益権の総数	18,716,106,951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	1.3418円
(10,000口当たり純資産額)	(13,418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 9月15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 9月15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 9月15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 9月15日現在	
	損益に含まれた評価差額（円）	
株式		13,763,667
投資証券		3,527,459,597
合計		3,541,223,264

(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 9月15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	63,794,725	-	63,798,947	4,222
	米ドル	51,750,080	-	51,753,525	3,445
	ユーロ	1,941,945	-	1,942,090	145
	英ポンド	1,816,560	-	1,816,647	87
	オーストラリアドル	6,736,044	-	6,736,690	646
	シンガポールドル	1,550,096	-	1,549,995	101
	売建	303,880,603	-	302,575,457	1,305,146
	米ドル	226,022,160	-	225,218,429	803,731
	カナダドル	2,609,250	-	2,590,761	18,489
	ユーロ	15,592,320	-	15,536,556	55,764
	英ポンド	18,274,200	-	18,166,644	107,556
	オーストラリアドル	22,200,302	-	21,974,608	225,694
	ニュージーランドドル	2,818,548	-	2,797,884	20,664
	香港ドル	3,494,062	-	3,482,625	11,437
	シンガポールドル	12,869,761	-	12,807,950	61,811
	合計	367,675,328	-	366,374,404	1,309,368

(注) 時価の算定方法

為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはありません。

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	26.42	621,662.60	
米ドル 小計		23,530		621,662.60 (68,165,304)	
オーストラリアドル	CENTURIA CAPITAL GROUP	81,276	3.44	279,589.44	
オーストラリアドル 小計		81,276		279,589.44 (22,423,073)	
合計		104,806		90,588,377 (90,588,377)	

(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	264,381.95	
		AGREE REALTY CORP	10,111	718,993.21	

ALEXANDER & BALDWIN INC	10,826	246,616.28	
ALEXANDER'S INC	282	71,715.42	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,245	4,037,865.25	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,448	291,514.72	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20,493	1,027,928.88	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	17,753	152,498.27	
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	40,773	1,652,529.69	
AMERICOLD REALTY TRUST	37,578	1,326,879.18	
APARTMENT INCOME REIT CO	23,324	1,175,996.08	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	24,021	164,543.85	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	30,431	459,812.41	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	8,064	105,799.68	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,609	4,622,392.61	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	3,420	36,936.00	
BOSTON PROPERTIES INC	21,146	2,334,095.48	
BRANDYWINE REALTY TRUST	25,044	334,337.40	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	44,137	1,027,067.99	
BRT APARTMENTS CORP	877	16,873.48	
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,553	2,199,394.89	
CARETRUST REIT INC	14,780	322,056.20	
CENTERSPACE	2,032	202,570.08	
CHATHAM LODGING TRUST	8,074	97,210.96	
CIM COMMERCIAL TRUST CORP	2,000	13,780.00	
CITY OFFICE REIT INC	7,494	123,950.76	
CLIPPER REALTY INC	1,350	10,962.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	16,756	319,704.48	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST INC	3,585	170,825.25	
COREPOINT LODGING INC	4,988	74,720.24	
CORESITE REALTY CORP	6,368	942,400.32	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,264	445,308.32	
COUSINS PROPERTIES INC	22,013	821,525.16	
CTO REALTY GROWTH INC	900	49,041.00	
CUBESMART	30,000	1,583,700.00	
CYRUSONE INC	18,199	1,393,315.44	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	31,908	285,257.52	

DIGITAL REALTY TRUST INC	41,581	6,412,206.01	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	71,594	466,792.88	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	38,684	133,072.96	
DOUGLAS EMMETT INC	24,430	803,747.00	
DUKE REALTY CORP	55,283	2,795,661.31	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	82,000		
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	11,947	251,125.94	
EASTGROUP PROPERTIES INC	5,974	1,038,340.94	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	21,548	214,402.60	
EPR PROPERTIES	10,823	525,023.73	
EQUINIX INC	13,238	11,052,273.82	
EQUITY COMMONWEALTH	17,669	462,221.04	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	25,260	2,112,241.20	
EQUITY RESIDENTIAL	50,782	4,152,951.96	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	17,308	531,528.68	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,586	3,110,273.56	
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,731	3,621,822.36	
FARMLAND PARTNERS INC	3,259	40,933.04	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,526	1,262,488.44	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,925	1,022,328.50	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	11,109	301,831.53	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12,675	58,431.75	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	32,519	1,566,440.23	
GEO GROUP INC/THE	16,463	116,887.30	
GETTY REALTY CORP	5,766	174,133.20	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,761	128,643.13	
GLADSTONE LAND CORP	4,296	97,218.48	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	8,379	128,869.02	
GLOBAL NET LEASE INC	13,432	224,045.76	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20,868	635,639.28	
HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	32,025	982,527.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	79,428	2,809,368.36	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,878	55,370.76	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,760	690,760.80	

HOST HOTELS & RESORTS INC	104,628	1,739,963.64	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	21,966	580,781.04	
INDEPENDENCE REALTY TRUST INC	15,188	306,038.20	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	9,736	254,304.32	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	3,566	814,581.38	
INVITATION HOMES INC	83,734	3,397,925.72	
IRON MOUNTAIN INC	43,011	1,954,419.84	
JBG SMITH PROPERTIES	16,277	477,241.64	
KEPPEL PACIFIC OAK US REIT	88,500	69,472.50	
KILROY REALTY CORP	15,723	1,027,498.05	
KIMCO REALTY CORP	89,498	1,944,791.54	
KITE REALTY GROUP TRUST	12,509	257,435.22	
LEXINGTON REALTY TRUST	42,016	574,778.88	
LIFE STORAGE INC	11,438	1,401,040.62	
LTC PROPERTIES INC	5,856	196,878.72	
MACERICH CO/THE	24,705	428,631.75	
MACK-CALI REALTY CORP	12,808	215,558.64	
MANULIFE US REAL ESTATE INV	213,400	150,447.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	87,410	1,799,771.90	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,885	3,234,828.30	
MONMOUTH REAL ESTATE INV COR	14,510	275,254.70	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	26,115	1,192,149.75	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,333	647,340.96	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,605	383,288.15	
NETSTREIT CORP	3,551	89,201.12	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,195	108,779.40	
NEXPOINT RESIDENTIAL	3,196	200,293.32	
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	7,181	184,838.94	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34,880	1,131,507.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,195	66,530.45	
PARAMOUNT GROUP INC	24,691	213,577.15	
PARK HOTELS & RESORTS INC	34,385	655,721.95	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	19,727	432,415.84	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	9,178	16,979.30	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,305	571,629.30	

PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	18,539	315,163.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	4,100	95,694.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUN-A	6,628	76,619.68	
PRIME US REIT	58,100	49,675.50	
PROLOGIS INC	109,360	14,495,668.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,956	463,766.84	
PUBLIC STORAGE	22,489	7,138,458.38	
REALTY INCOME CORP	55,115	3,759,394.15	
REGENCY CENTERS CORP	23,517	1,587,632.67	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	16,997	297,617.47	
RETAIL PROPERTIES OF AME - A	31,714	408,793.46	
RETAIL VALUE INC	2,135	55,510.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	19,969	1,211,319.54	
RLJ LODGING TRUST	23,731	340,539.85	
RPT REALTY	12,942	164,622.24	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,002	661,045.22	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	32,693	514,260.89	
SAFEHOLD INC	2,242	180,055.02	
SAUL CENTERS INC	2,130	94,614.60	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	5,880	88,258.80	
SERVICE PROPERTIES TRUST	25,427	277,408.57	
SIMON PROPERTY GROUP INC	48,521	6,286,380.76	
SITE CENTERS CORP	24,326	381,431.68	
SL GREEN REALTY CORP	10,513	716,881.47	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,074	847,724.10	
STAG INDUSTRIAL INC	23,788	989,580.80	
STORE CAPITAL CORP	36,149	1,248,947.95	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	15,091	138,233.56	
SUN COMMUNITIES INC	16,495	3,294,711.30	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,870	399,370.50	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,692	263,939.44	
TERRENO REALTY CORP	10,333	684,561.25	
UDR INC	44,231	2,364,589.26	
UMH PROPERTIES INC	6,220	150,648.40	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,693	97,906.19	

	URBAN EDGE PROPERTIES	16,309	296,008.35
	URSTADT BIDDLE - CLASS A	3,952	76,392.16
	VENTAS INC	55,308	3,174,126.12
	VEREIT INC	34,068	1,631,516.52
	VICI PROPERTIES INC	79,061	2,365,505.12
	VORNADO REALTY TRUST	23,283	954,137.34
	WASHINGTON REIT	12,066	308,406.96
	WELLTOWER INC	61,642	5,396,140.68
	WHITESTONE REIT	5,243	51,276.54
	WP CAREY INC	26,480	2,018,040.80
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,173	281,086.74
	米ドル 小計	3,676,304	170,793,661.32 (18,727,524,963)
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	8,835	371,335.05
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	8,346	95,311.32
	AUTOMOTIVE PROPERTIES REAL E	3,500	44,345.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,575	173,745.00
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	12,332	751,758.72
	CHOICE PROPERTIES REIT	23,285	346,480.80
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,992	147,475.68
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTME	6,406	116,461.08
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	8,346	147,724.20
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,935	253,895.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INV	3,882	88,975.44
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE IN	16,077	289,868.31
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,700	436,536.00
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	20,221	333,242.08
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	10,340	184,569.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	7,872	172,003.20
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,257	52,452.68
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESIDENTIAL REIT	2,413	42,879.01
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	15,384	205,068.72
	PLAZA RETAIL REIT	10,000	45,300.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,837	537,524.35
	SLATE GROCERY REIT	2,561	34,573.50

	SLATE OFFICE REIT	4,169	22,345.84
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,562	320,239.84
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REI	12,930	275,796.90
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,365	39,325.45
	WPT INDUSTRIAL REAL ESTATE I	6,574	180,719.26
	カナダドル 小計	262,696	5,709,951.43 (493,111,405)
ユーロ	AEDIFICA	5,277	618,992.10
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	26,656	427,828.80
	ALTAREA	502	101,153.00
	BEFIMMO	3,878	135,536.10
	CARE PROPERTY INVEST	3,482	97,496.00
	CARMILA	7,876	98,450.00
	COFINIMMO	4,336	580,590.40
	COVIVIO	7,055	535,333.40
	CROMWELL REIT EUR	43,440	115,116.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV	5,323	106,992.30
	GECINA SA	8,057	1,000,679.40
	HAMBORNER REIT AG	9,533	89,219.34
	HIBERNIA REIT PLC	89,793	106,674.08
	ICADE	4,576	321,921.60
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	6,951	25,336.39
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	36,853	325,596.25
	INTERVEST OFFICES&WAREHOUSES	3,876	96,318.60
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	68,224	105,064.96
	KLEPIERRE	29,279	563,327.96
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	8,017	43,612.48
	MERCIALYS	5,259	49,250.53
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	51,236	478,954.12
	MONTEA NV	1,436	176,340.80
	NSI NV	2,837	94,330.25
	RETAIL ESTATES	1,743	114,166.50
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,606	1,377,305.04
	VASTNED RETAIL NV	2,828	65,609.60
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	20,125	763,945.00
	WERELDHAVE NV	6,360	80,454.00

	XIOR STUDENT HOUSING NV	2,620	133,096.00	
	ユーロ 小計	488,034	8,828,691.00 (1,143,050,623)	
英bond	AEW UK REIT PLC	20,000	21,480.00	
	ASSURA PLC	389,011	294,870.33	
	BIG YELLOW GROUP PLC	24,070	351,903.40	
	BMO COMMERCIAL PROPERTY TRUS	123,187	120,107.32	
	BRITISH LAND CO PLC	139,064	719,795.26	
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIE	131,258	219,463.37	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	92,934	85,406.34	
	CUSTODIAN REIT PLC	53,561	51,525.68	
	DERWENT LONDON PLC	16,538	609,756.06	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	98,564	92,255.90	
	GCP STUDENT LIVING PLC	67,882	143,909.84	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	37,809	290,562.16	
	HAMMERSON PLC	612,635	204,620.09	
	HOME REIT PLC	35,027	38,879.97	
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	55,357	65,985.54	
	INTU PROPERTIES PLC	117,549		
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,214	773,827.01	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	131,813	332,168.76	
	LXI REIT PLC	88,148	127,638.30	
	NEWRIVER REIT PLC	39,505	29,352.21	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	91,730	86,776.58	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	201,064	327,734.32	
	REGIONAL REIT LTD	63,471	55,854.48	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	31,033	349,431.58	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	68,450	34,361.90	
	SEGRO PLC	176,886	2,258,834.22	
	SHAFTESBURY PLC	43,927	269,931.41	
	STANDARD LIFE INV PROP INC	69,000	49,818.00	
	SUPERMARKET INCOME REIT PLC	121,418	144,487.42	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	58,694	59,398.32	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	251,962	594,126.39	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	116,460	88,742.52	

	UNITE GROUP PLC	59,023	689,388.64
	WORKSPACE GROUP PLC	20,047	178,117.59
	英ポンド 小計	3,758,291	9,760,510.91 (1,477,643,746)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	62,398	224,008.82
	APN INDUSTRIA REIT	27,219	100,438.11
	ARENA REIT	48,279	202,771.80
	AVENTUS GROUP	52,026	174,807.36
	BWP TRUST	69,723	282,378.15
	CENTURIA INDUSTRIAL REIT	67,253	262,959.23
	CENTURIA OFFICE REIT	63,819	160,185.69
	CHARTER HALL GROUP	68,538	1,207,639.56
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	81,543	432,177.90
	CHARTER HALL RETAIL REIT	76,733	300,793.36
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTR	53,073	197,431.56
	CROMWELL PROPERTY GROUP	282,409	248,519.92
	DEXUS/AU	158,849	1,710,803.73
	GDI PROPERTY GROUP	66,335	76,948.60
	GOODMAN GROUP	248,261	5,588,355.11
	GPT GROUP	283,941	1,408,347.36
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	46,211	199,631.52
	HOME CONSORTIUM	25,753	198,298.10
	HOMEKO DAILY NEEDS REIT	68,755	110,008.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS	30,020	106,270.80
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	42,161	268,987.18
	IRONGATE GROUP	69,568	106,439.04
	MIRVAC GROUP	581,102	1,766,550.08
	NATIONAL STORAGE REIT	158,895	374,992.20
	RURAL FUNDS GROUP	63,091	167,822.06
	SCENTRE GROUP	772,334	2,247,491.94
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	166,342	449,123.40
STOCKLAND	352,570	1,600,667.80	
VICINITY CENTRES	573,525	983,595.37	
WAYPOINT REIT LTD	117,252	327,133.08	
	オーストラリアドル 小計	4,777,978	21,485,576.83 (1,723,143,261)

ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	135,240	223,146.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	154,709	402,243.40	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	226,618	265,143.06	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	176,010	296,576.85	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TR	63,535	196,958.50	
ニュージーランドドル 小計		756,112	1,384,067.81	(107,569,750)
香港ドル	CHAMPION REIT	294,000	1,231,860.00	
	FORTUNE REIT	223,000	1,808,530.00	
	LINK REIT	307,200	21,227,520.00	
	PROSPERITY REIT	163,000	510,190.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVEST	141,000	699,360.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMEN	247,000	955,890.00	
香港ドル 小計		1,375,200	26,433,350.00	(372,710,235)
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LT	58,500	82,485.00	
	ARA LOGOS LOGISTICS TRUST	184,100	167,531.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	487,100	1,495,397.00	
	ASCOTT TRUST	264,096	258,814.08	
	CAPITALAND CHINA TRUST	135,400	174,666.00	
	CAPITALAND INTEGRATED COMMER	670,932	1,355,282.64	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	122,600	140,990.00	
	EC WORLD REIT	50,000	40,000.00	
	ESR REIT	392,600	188,448.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	160,200	99,324.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	167,300	44,334.50	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	199,700	457,313.00	
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	133,700	64,176.00	
	FRASERS LOGISTICS & COMMERCIAL	418,779	623,980.71	
	IREIT GLOBAL	95,000	60,325.00	
	KEPPEL DC REIT	191,300	485,902.00	
	KEPPEL REIT	300,900	321,963.00	
	LENDLEASE GLOBAL COMMERCIAL	139,100	121,017.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL	889,100	47,122.30	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	321,300	668,304.00	

	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	285,700	811,388.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	429,100	883,946.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERC	325,300	328,553.00	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	367,400	161,656.00	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	54,200	257,450.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	91,400	39,302.00	
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	64,300	57,227.00	
	SPH REIT	164,700	151,524.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	186,200	119,168.00	
	SUNTEC REIT	329,100	470,613.00	
	シンガポールドル 小計	7,679,107	10,178,202.23 (830,337,737)	
韓国ウォン	ESR KENDALL SQUARE REIT CO L	15,000	98,700,000.00	
	IGIS VALUE PLUS REIT CO LTD	4,000	22,160,000.00	
	JR REIT XXVII	18,000	96,120,000.00	
	KORAMCO ENERGY PLUS REIT	4,199	26,201,760.00	
	LOTTE REIT CO LTD	15,761	88,576,820.00	
	MIRAE ASIA PAC REAL EST-1	10,111	47,521,700.00	
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	5,014	41,215,080.00	
	韓国ウォン 小計	72,085	420,495,360.00 (39,358,365)	
イスラエルシェケル	REIT 1 LTD	25,765	501,129.25	
	イスラエルシェケル 小計	25,765	501,129.25 (17,113,213)	
合計			24,931,563,298 (24,931,563,298)	

(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	0.4%		0.3%
	投資証券 152銘柄		99.6%	74.7%

カナダドル	投資証券	27銘柄		100.0%	2.0%
ユーロ	投資証券	30銘柄		100.0%	4.6%
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	1.3%		0.1%
	投資証券	30銘柄		98.7%	6.9%
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%	1.5%
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 9月30日現在です。

【りそな・リスクコントロールファンド2019-10】

【純資産額計算書】

資産総額	17,370,757,817円
負債総額	22,316,511円
純資産総額（ - ）	17,348,441,306円
発行済口数	17,724,985,630口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9788円

（参考）

R M国内債券マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	115,713,344,639円
負債総額	341,658,340円
純資産総額（ - ）	115,371,686,299円
発行済口数	109,673,093,965口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0520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	282,353,970,654円
負債総額	4,695,679,758円
純資産総額（ - ）	277,658,290,896円
発行済口数	266,988,598,286口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0400円

R M国内株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	57,935,239,332円
負債総額	550,450,901円
純資産総額（ - ）	57,384,788,431円
発行済口数	38,705,406,200口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4826円

R M先進国株式マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	122,811,318,116円
負債総額	347,262,696円
純資産総額（ - ）	122,464,055,420円
発行済口数	64,252,473,982口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9060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	17,480,203,550円
負債総額	112,004,650円
純資産総額（ - ）	17,368,198,900円
発行済口数	10,662,437,126口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6289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	6,677,200,806円
負債総額	50,304,299円
純資産総額（ - ）	6,626,896,507円
発行済口数	6,070,120,498口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0917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	32,512,081,105円
負債総額	166,113,996円
純資産総額（ - ）	32,345,967,109円
発行済口数	21,585,518,110口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4985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	26,029,186,507円
負債総額	183,123,362円
純資産総額（ - ）	25,846,063,145円
発行済口数	19,400,550,860口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3322円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

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

（2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

受益権の譲渡

- ・受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- ・前述の申請のある場合には、振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社債、株式等の振替に関する法律の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。
- ・前述の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合などにおいて、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

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

（4）受益証券の再発行

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

（5）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、解

約請求の受付、解約金および償還金の支払いなどについては、約款の規定によるほか、民法その他の法令などにしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額

2021年9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9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9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	104	1,137,978
単位型株式投資信託	8	99,720
合計	112	1,237,699

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。
株式会社みなと銀行	39,984百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(3) 保証会社

名 称	資本金の額 (2021年3月末現在)	事業の内容
株式会社りそな銀行	279,928百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社

ファンドの信託財産に属する有価証券の管理・計算事務などを行いません。

(2) 販売会社

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

(3) 保証会社

基準価額または償還価額が『確保ライン』未満とならないために要する額を信託財産に支払います。

3【資本関係】

(1) 受託会社

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

(3) 保証会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2020年12月15日	有価証券報告書
2021年 6月15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11月5日

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

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているりそな・リスクコントロールファンド2019-10の2020年9月16日から2021年9月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな・リスクコントロールファンド2019-10の2021年9月15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。